

株式会社ダルマ・キャピタルでのインターンシップを終えて

理学系研究科 物理学専攻 博士課程2年 畠山遼子

2018年2月19日～3月2日の2週間、ハイ・フリークエンシー・トレーディング(HFT)を行うプロップファーム、ダルマ・キャピタル株式会社にてインターンシップを経験しました。

HFTは、証券取引所からミリ秒単位で入る株式売買注文の情報に対してアルゴリズムに従いマイクロ秒単位で反応して注文を出すトレーディングです。プロップファームとは、自己勘定で売買している企業を指します。

私は、過去一カ月分の証券取引の時系列データを分析してトレード戦略を練り、アルゴリズムを組んで戦略の評価を行いました。金融の知識がまったくないためデータの取り扱い等苦労しましたが、利益を出すという目標が明快な点が魅力的で、戦略を考えるのも楽しく、有意義な時間を過ごすことができました。また、研究室と大きく異なる、私語がなく長くはない勤務時間内で集中的に各自与えられた業務を終える環境も新鮮でした。少数先鋭の従業員からなる企業のためひとりひとりの情報処理能力が高く、多くの刺激を受けることができました。

最後に、お忙しい中インターンシップを受け入れてくださったダルマ・キャピタル株式会社や、サポートしてくださったALPSプログラムのみなさまに厚く御礼申し上げます。