

# 2019 資產管理 AI 應用

## 實務研習課程



### 目的

- ◎ 本計畫係為配合主管機關推動金融科技政策，協助金融人員轉型並培育金融科技專業人才規劃辦理。
- ◎ 本課程特色著重程式語言撰寫能力、機器學習、深度學習、資料探勘、大數據分析演算法、風險控管與投資決策分析預測等實務運用，期為資產管理業界培育金融科技應用人才，啟動業務發展新動能。

### 學員對象、人數

證劵主管機關、投信投顧公司及其他金融機構代表，主管、投資研究、財務、資訊、企劃開發等之從業人員40人(每單位以5人為限)。無程式語言基礎或無程式交易經驗者亦可。

**上課地點：**台北市南海路3號4樓 證基會401教室

**上課日期：**108年6月26日(三)~9月27日(五)(為期約3個月)

**上課時間：**於每週三、五晚上6:30-9:30(合計81小時)

**報名方式：**至證基會網址報名 [www.sfi.org.tw](http://www.sfi.org.tw)

**服務專線：**(02)2393-1888 分機117 證基會人才培訓中心簡先生

**報名日期：**即日起至**108年6月20日止**

**費用：**每位新台幣**25,000元整**



參訓人員費用，將代為向資產管理人才培育與產業發展基金申請部分補助，依所屬機構別補助成數、名額，應繳費用：

參加機構	補助成數	補助名額	每位金額	
			全選(81小時)	精選(57小時)
投信顧公司	60%	25	NT\$ 10,000	NT\$ 7,200
其他金融機構(註)	40%	13	NT\$ 15,000	NT\$ 10,800

註：包含臺灣證券交易所、臺灣期貨交易所、證劵櫃檯買賣中心及臺灣集中保管結算所等。

### 優秀獎勵辦法

分組報告成果優異：第1名獎勵金新台幣5,000，第2名獎勵金新台幣3,000，第3名獎勵金新台幣2,000。

# 2019 資產管理 AI 應用實務研習課程

課程架構、主題 (共計八十一小時)

## 基礎

### 一、機率統計與R 語言基礎

◎ 數據分析之機率統計原理	6 小時
◎ R 語言與RStudio介紹及基本觀念	6 小時
◎ R語言資料處理實務、流程控制及語法架構	6 小時
◎ R語言函式與套件	6 小時



## 進階

### 二、機器學習建構

◎ 機器學習簡介、機器學習重要元素、特徵選擇與特徵工程、深度學習	3 小時
◎ 資料探勘及資料視覺化應用	6 小時
◎ 監督式、非監督式及其他學習之演算法及模型	6 小時

### 三、資產選擇與風險管理應用實務

◎ 績效指標之資產選擇法	3 小時
◎ 穩健投資組合設計與優化	6 小時
◎ 風險管理	6 小時

### 四、分析預測、交易及資金控管

◎ 股市分析預測	12 小時
◎ 程式交易策略建構與回測實務	6 小時
◎ 資金控管的理論與實務	6 小時

### 五、分組簡報

◎ 各小組專題簡報	3 小時
-----------	------

◎ 參加人員可自行衡量金融科技專業背景程度，報名全選系列或精選系列擇其一參加本研習課程：

1. 全選系列：基礎+進階 (模組一至五)，共81小時。
2. 精選系列：進階 (模組二至五)，共57小時 (具備R語言基礎)。

## 2019 資產管理 AI 應用實務研習課程 報名表

公司/機構名稱			
發票地址：			統一編號：
聯絡人姓名：		部門：	
電話：		E-mail：	
參加人姓名	服務部門及職稱	連絡電話 (分機)	E-mail

◎ 本表如不敷使用，請自行影印

指導單位：金融監督管理委員會

主辦單位：資產管理人才培育與產業發展基金管理委員會

執行單位：



財團法人中華民國  
證券暨期貨市場發展基金會  
SECURITIES & FUTURES INSTITUTE