

## 「金融投資 明日之星」頒獎典禮

### 成果回顧

金融監督管理委員會為引導金融創新發展、提升我國金融市場競爭力，推動金融科技至今，於 2020 年發布「金融科技發展路徑圖」，由金融周邊單位共同研商建立「金融科技能力認證機制」，分為基礎能力與專業能力之認證，其中基礎能力就包括所謂「程式力」，而提升金融從業人員「程式力」，除透過課程的學習更須著重實際操作及演練，方能增強專業。爰上，承資產管理人才培育及產業發展基金支援，於 112 年 8 月 30 日舉辦「AI 程式策略交易競賽」及頒獎典禮；

頒獎典禮旨為表揚各界對 AI 應用於資產管理之設計之傑出參賽者，並延伸 Python 應用數位課程，鼓勵其深入探索學習成效與對於 Python 程式語言之熟稔度及達到與業者應用交流之效益，增進資產管理資產配置與投資技能應用 AI 之實務經驗。

本活動由本會與寶金雲國際金融科技合作(協辦)，借鏡該公司過往之程式交易競賽頒獎典禮經驗，除頒獎表揚傑出表現外，也邀請安侯企業管理股份有限公司林大旭 執行副總經理針對生成式 AI 的應用與風險進行專題演講，再由得獎者分享操作心得，提供貴賓、參賽者、與會者，理解 AI 程式交易之展望與樣貌及本賽事之 AI 程式投資交易策略與回測策略成效。

本頒獎典禮，參與者來自投信顧業者、金融周邊單位、證券期貨業、大專院校及其它機構等，共計 40 位。

## 典禮流程

## 「金融明日之星 AI 程式策略交易競賽」頒獎典禮

時間：112 年 8 月 30 日（星期三）

地點：政大公企 A747CB 教室+VIP 交誼廳(台北市大安區金華街 187 號)

時間	預定主題	預定講席
14:00-14:30	Registration	
14:30-14:35	主持人開場及活動說明&長官合照	
14:35-14:40	主辦單位致詞	證券暨期貨市場發展基金會 王姓 副總經理
14:35-14:40	貴賓致詞	投信投顧公會/元大投信 劉宗聖 理事長/董事長
14:40-14:45	協辦單位致詞	寶金雲國際金融科技公司 黃建華 董事長
14:45-14:55	<p>1. 每周最佳穩定獎：領獎者13名，每名提供新台幣1,000-2,000元，以上由寶金雲國際金融科技公司李總監曜旭、陳總監齡修頒獎。</p> <p>2. 基礎組優勝獎：每組冠亞季軍各1名，共3名。            冠軍:獎狀一張，新台幣60,000元整、            亞軍:獎狀一張，新台幣30,000元整、            季軍:獎狀一張，新台幣15,000元整，            以上由寶金雲國際金融科技公司 黃董事長建華頒獎。</p> <p>3. 進階組優勝獎：每組冠亞季軍各1名，共3名。            冠軍:獎狀一張，新台幣60,000元整、            亞軍:獎狀一張，新台幣30,000元整、            季軍:獎狀一張，新台幣15,000元整，</p> <p>4. 致贈贊助單位感謝狀：共六間單位，每間感謝狀一張。            以上由本會王副總經理頒贈。</p>	

15:00-15:05	大合照	
15:05-15:30	專題分享 生成式AI的應用與風險	安侯企業管理股份有限公司 林大旭 執行副總經理
15:30-15:40	贊助單位分享致辭 1.富邦投信 指數暨量化投資處 呂其倫 資深副總經理 2.康和證券 經紀事業群 楊光程 幕僚長	
15:40-16:00	得獎者程式交易操作心得分享 程式設計_進階組：冠軍-亞軍-季軍 策略積木_基礎組：冠軍-亞軍-季軍	
16:00-16:30	交流時間	

# 金融投資明日之星

## AI程式交易策略挑戰賽

主辦單位致辭：

講 座：王姓 副總經理 中華民國證券暨期貨發展基金會



王姓 副總經理對在場所有的協辦單位、贊助單位、參賽者，問好並致意。

首先，副總經理談到以最初與協辦單位-寶金雲國際金融科技公司磋商之時，就認為本案是一件非常有意義的事情，特別是能發掘未來的 AI 人才，同時也感謝資產管理人才培育與產業發展基金委員會，本案有部分資源也是來自於委員會，並說明得到本活動贊助單位同時也是委員會成員的投信投顧公會劉宗聖理事長的大力支持。

接續，副總經理恭喜今天所有獲獎的同學們，能在超過 200 位以上的參賽者脫穎而出，副總經理也十分開心能有許多年輕的朋友來參賽，也勉勵年輕學子除了繁忙的課業外，還要用心於為期四週的競賽實屬不易，並提到現今 AI 量化的資產管理已為趨勢，希望大家透過活動的機會與交流學習。並提到本活動在程式能力、數位知識、金融科技、產學合作等方面已經呼應且超前金管會於 2020 年發布「金融科技發展路徑圖」1.0、2.0 版之規劃。

最後副總經理再次感謝協辦單位寶金雲以及贊助的六個證券期貨投信投顧業者共襄盛舉來參加這次的競賽活動與頒獎典禮。

貴賓致辭：

講座：劉宗聖 理事長/董事長 投信投顧公會/元大投信



劉理事長首先對主辦單位、協辦單位以及六家贊助的共同協辦單位致意，並也感謝在激烈比賽中脫穎而出的傑出年輕參賽者，同時也是未來的明日之星。

理事長接續表示自己今天代表兩個身分，其一為元大投信，這部份是屬於參與者，第二個則是公會理事長，並提到本次活動有許多公會會員也來襄助，站在公會業者的角度，除了恭喜各位得獎者外，也提出幾個思考點來跟大家分享。

其一為運用 AI 來進行投資風險管理，其次投資管理也有龐大的營運需求，是否也能運用 AI 來營運管理，整體來看，從前臺的業務管理、投資管理，中臺的風險管理，後臺的營運管理，從點到線到面，其實一點通，希望大家能去思考在創造績效的同時，能做到先求不傷身體，再求療效，先將風險控制好，再來追求可能的獲利。

理事長接續談到，AI 在內部管理方面也有許多應用，如基金事務、基金會計，中臺方面則會用到大量的風險管理，如何去偵測、識別，從預應、因應、反應，AI 都可以做到，所以今日的 AI 除了兩個部分，其一為演算法，其二為人工智能，理事長特別提醒其三重要為 AI 的投資程式自動化與機器互動化的發展情況在未來都是非常值得關注的，最後理事長再次感謝主辦單位與所有得獎者。

# 金融投資明日之星

## AI程式交易策略挑戰賽

協辦單位致辭：

講 座：黃建華 董事長 寶金雲國際金融科技公司

黃董事長首先對現場的嘉賓及得獎者問好，並提到今日團聚在此的目的就是因為金融科技在投資領域的應用上，已經慢慢成形，所以希望藉本次的比賽，可以讓投資者或業者看到這個趨勢，並群策群力在這方面努力。



董事長接續說明，自己自1993年進入業界，本職原為IT相關，因此也開始學習IT能力在金融科技方面的應用，而在1996年，台股市場經過了一個大的循環，投資人也變得更為謹慎，故主管機關對於開放衍生商品的態度也非常小心，所以相關的技術與方法都是掌握在外資手中，也因此開始去學習如何利用電腦及模型數據去做回測，新種業務在市場各種變化情況下，對交易成本、避險難度或各方面會有怎樣的情況，透過電腦科技與數據的結合，可以讓我們可以有更宏觀清晰的角度。

董事長又談到，這些參賽的年輕學子也是一樣，雖然經驗相對較少，但透過手中的AI工具運算及金融數據就可快速去累積經驗，並且能成為未來的助力。

董事長最後也恭喜各位得獎者，並鼓勵大家可以在這個道路上面越走越遠，同時也祝福今天所有參與的嘉賓健康如意。

2023 The rise of Algorithmic Trading

# 金融投資明日之星

## AI程式交易策略挑戰賽

每周最佳穩定獎：共 13 人。

頒獎人：李曜旭總監、陳齡修總監 寶金雲國際金融科技公司



得獎者：葉紹平、殷暉智、鄭達嶸、梁鉉智、章雅婷、許丕煥、歐豐豪、賴青瑋、劉祥暉、蔡翔宇、邱顯益、甯文駿、黃品喆。

2023 The rise of Algorithmic Trading

# 金融投資明日之星

## AI程式交易策略挑戰賽

基礎組優勝獎：冠亞季軍各1名，共3名。

頒獎人：黃建華 董事長 寶金雲國際金融科技公司



冠軍得獎者：  
邱顯益



亞軍得獎者：  
甯文駿



季軍得獎者：  
黃品喆



2023 The rise of Algorithmic Trading

# 金融投資明日之星

## AI程式交易策略挑戰賽

進階組優勝獎：冠亞季軍各1名，共3名。

頒獎人：王姓 副總經理 中華民國證券暨期貨發展基金會



冠軍得獎者：

賴青瑋



亞軍得獎者：

劉祥暉



季軍得獎者：

蔡翔宇

主辦單位致贈贊助感謝狀：

頒獎人：王姓 副總經理 中華民國證券暨期貨發展基金會

王副總經理頒發企業感謝狀給本次頒獎典禮贊助之共同協辦單位。



受獎單位與代表(由左至右)：

富邦投信 呂其倫 資深副總經理

寶鍊投顧 鄭琮寰 總經理

元大投信 劉宗聖 董事長

群益投信 葉雲龍 副總經理

康和證券 楊光程 幕僚長

永豐期貨 賴彥宏 副總經理

## 金融投資明日之星 AI程式交易策略挑戰賽

專題分享 生成式 AI 的應用與風險：

講 座： 林大旭 執行副總經理 安侯企業管理股份有限公司

林副總經理首先提到生成式AI目前發展突飛猛進，的確在資產管理上有許多值得探討的重點，但更應該去思考的部分應屬生成式AI的風險管理，並強調說明，人工智慧已經陸續滲透到現今社會各個生活場景。



林副總經理接著分享，生成式AI的歷程、基本架構(資料收集)、資料清洗、訓練與產出、運作模式等等，並提到生成式AI的角色設定說明與提示建議、強化提示等，接續談到AI面臨到的資安挑戰，尤其應用在社群平台上的標註，以臉書為例，可以從年紀、嗜好、喜歡的影片、文字等內容，運用演算法找出同溫層，藉此推播適合的內容，接著又回顧20年前的AI與今日AI的差異，並展望AI未來的可能性。

林副總經理開始進一步分析AI面臨的資訊安全風險，如ChatGPT提示注入惡意語法為例講解說攻擊手法及談到多數企業輕忽社群媒體所衍生的網路攻擊，如FB、Twitter、LinkedIn所洩漏出去的個人訊息等等，並強調資安在AI時代將更為複雜，除了面臨到深偽技術、社交工程、自動生成駭客工具、AIGC的假消息的氾濫等等。

副總最後提到在AI時代要設計或規劃任何含有AI的產品或服務一定要做到「F.I.R.S.T」五個要點(Fair公正、Inclusive包容、Responsible負責、Safe人身安全、Transparent透明)，主體就是要建構一個負責的、可解釋的AI，而以上五點就是必須去參考及運用的。

贊助單位致辭：

講 座：

呂其倫 資深副總經理 富邦投信 指數暨量化投資處

呂資深副總分享，現在的 AI 工具非常進步，以現在的技術可以得到無限多種，而且其中有許多策略是獲利非常好的，但越是表面上績效良好的策略則越需要特別注意，他建議在執行的時候可以用一部份



的資料，並且保留一段時間，讓新的資料加入的時候，這個策略還可以運作的成功並強化前後的測試是十分重要的。

接著呂資深副總談到量化投資常會發生過度擬合的狀況，就是指為了要讓績效看起來最好，所以會不確實的調整參數，讓模型看起來非常複雜，但他認為越是複雜的模型越是需要注意，因為常伴隨著更高的風險。

最後他也特別提醒大家，投資第一個要注意的是風險而不是獲利，這個是非常重要的，如果不注意風險是很難在這個市場生存的，如果表面上看起來績效很好的策略，就直接用真金白銀投入的話，他認為風險是很高的，必須十分小心。

贊助單位致辭：

講座：

楊光程 幕僚長 康和證券 經紀事業群

楊幕僚長首先鼓勵所有參賽者，在競賽的 7/3-7/28 日期間，正好是台股最火紅的一段時間，最能夠展現出實力的時刻。



幕僚長接著分享，科技始終來自於人性，科技始終來自於滿足人

類的需求，隨著 NVIDIA 股價創新高的同時，他認為 AI 一定會加速發展。

接著提到康和證券也與時俱進，開發出了非常多的 AI 平台，像「好康放心投」平台，得到了卓越雜誌及中時評鑑大賞的最佳智能理財與創新平台獎，同時我們也為了從事高頻交易的投資人，創造出來「飆賺下單」與「雷影下單」的系統，滿足各種投資人的需求。

最後幕僚長再次勉勵大家共創美好的一個的未來，並祝福大家有個愉快美好的一天。

**結語：**

「金融投資 明日之星 AI 程式交易策略競賽」頒獎典禮已圓滿完成，證基會未來仍將秉持專業服務熱忱，持續配合政府政策，順應數位化潮流，推動我國金融科技發展，培育更多年輕優秀的 AI 金融科技人才。