

「2020 資產管理 AI 應用實務研習課程」圓滿結業

金融科技 人工智慧

本研習課程係配合主管機關推動金融科技政策，由資產管理人才培育發展基金管理委員會核定為年度工作計畫之一，課程特色著重於程式語言撰寫能力、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，期為資產管理業培育金融科技應用人才。

本研習課程自 109 年 10 月 17 日開辦，至 110 年 1 月 22 日結束，參訓學員共有 23 位，分別來自：政府機構、證券投信投顧、人壽保險、銀行、及期貨業等各界代表。課程主題包括：基礎系列-機率統計與 R 語言基礎、進階系列-機器學習建構、資產選擇與風險管理應用實務、分析預測交易與資金控管等 4 個模組。研習期間除邀請資產管理與金融科技、人工智慧等專家擔任主講，分享實務經驗外，並運程式撰寫、習作演練、擷取資料數據等進行模擬分析與預測，讓參訓人員透過實作方式體驗學習內容，以提高學習成效。

本課程並於 110 年 1 月 22 日安排參訪「金融科技創新園區 FinTech Space」及「芬恩特創新聚落」，使參訓人員進一步了解金融科技新創機構資源與其輔導功能，其後並進行分組簡報並頒發獎勵金予表現優異團隊。

分組報告

本研習課程結束前所有參加人員自行編組完成專題研究並簡報，各組成員擬訂主題，與授課講師討論後進作簡報，並邀請臺北科技大學資訊與財金管理系吳牧恩副教授及智慧指標股份有限公司執行長林俊良執行長擔任評審，評量參訓學員學習成效後頒發獎勵金。

參訓學員共編成 10 組，由各組推派代表進行專題研究報告，第一名由國泰證券投資信託股份有限公司的蘇傳宇、林易衡、與廖韋傑等三人團隊勝出，報告題目是「R 語言的 PCA 計算與應用」。



第二名由金融監督管理委員會保險局壽險監理組的張時霖個人獲得，報告題目是「應用人工智慧執行台股交易策略」。



第三名有二組共同並列獲得，第一組由為勞動基金運用局風險控管組的游嘉鵬個人獲得，報告題目是「2020 資產管理 AI 應用實務研習應用於日常業務可能性初探」；第二組由永豐證券投資信託股份有限公司的林名文與潘信丞、華南永昌證券投資信託股份有限公司的陳慧玉、及元大期貨股份有限公司的曾郁婷等四人團隊共同獲得，報告題目是「在夏普指數之下各產業最佳投資組合研究：以半導體、食品、航運、汽車、金融產業為例」。



本課程歷經專業授課、上機實習、分組簡報，最後並安排參訪活動，學員收穫豐碩，本基金會未來將持續因應金融科技之進展，規劃適合專業所需課程，以培育金融科技人才，提升業者之競爭利基。