



國立臺灣大學進修推廣學院推廣教育非學分班招生簡章

## 「金融科技系列—大數據與理財機器人」第 2 期

### 新世代投資新挑戰 你不可不知的大數據與理財機器人

隨著大數據、資訊科技及人工智慧技術的進步，理財機器人(Robo Advisors)是金融業近年來非常受到關注的新興領域，不論是提供服務的金融機構家數及所管理的資產規模都日益增加。隨著理財機器人越來越普及，具備相關知識與技能即將成為金融從業人員必備技能之一，並且對於個人理財績效的提升也有所助益。本課程首先針對財經大數據進行介紹與分析，另講授機器學習法運用於股價線型判斷個案簡介分析，最後帶領學習者完整探討理財機器人的各種面向，俾益進一步思考金融科技下帶來的轉變。

**授課老師：**張森林 臺灣大學財務金融學系特聘教授及證券期貨暨財務工程研究中心主任(英國蘭開斯特大學財務博士)

**課程目的：**介紹財經大數據分析及理財機器人的理論與實務。

**課程內容：**詳細內容請參閱後課程大綱。

**招生對象：**對大數據分析的產業及理財機器人有興趣者。

**課程時數：**每週 1 次全天，共 2 日，合計 12 小時。

**上課時間：**109 年 5 月 31 日、6 月 7 日，週日上午 9：00-12：00 及下午 13：30-16：30

**上課地點：**臺灣大學進修推廣學院(臺北市羅斯福路 4 段 107 號)

**招生人數：**以 50 人為原則，依照報名者繳費順序錄取至額滿為止。

未達 25 人得不開班。本學院保留增額或不足額開班之權利。

※開課日前一週本學院會寄發開課通知(或因報名人數不足的不開課通知)。

**學 費：**10,000 元

**早鳥優惠：**於 109 年 4 月 24 日前完成報名繳費者，學費優惠價 8,000 元。

**其他優惠：**1. 臺大教職員工優惠：6 折。

2. 臺大校友/ILO、本學院舊生、年滿 65 歲、身心障礙或低收入戶領有證明者：可再折價 1,000 元。

註 1：早鳥優惠可與其他優惠身分者合併使用，如逾早鳥優惠日則依原價折扣。

註 2：優惠身分僅能擇一使用，請以優惠金額繳費，並於繳費時提供優惠證明。

**報名手續：**一律採線上報名，請至「臺灣大學推廣教育網」<https://www.ntuspecs.ntu.edu.tw> 點選本期「大數據與理財機器人」進行線上報名步驟後並下載列印繳費單，並完成繳



費手續。本課程將依照報名者繳費順序錄取至額滿為止。

**※提醒您，線上報名系統之〈收據抬頭〉一經開立收據即無法變更!!**

**繳費方式：**詳細說明請參閱下載的「繳費單」。完成繳費後請妥善保存繳費憑據。

**結業：**修業期滿，缺課次數未超過全期上課次數五分之一並通過學習評量者，由本學院核發推廣教育證明書。

**其他事項：**(1) 本班為研習班(非學分班)，不授予學分、學位證書及不發成績單。

(2) 本課程可登錄公務員終身學習時數。

(3) 本學院有權保留課程變動及時間調整之權利，課程若有變更將會提前告知學員。

(4) **學費退費規定：**學員自報名繳費後至實際上課日前退學者，退還已繳學費之九成。自實際上課之日算起未逾全期三分之一者退還已繳學費之半數。在班時間已逾全期三分之一者，不予退還。

(i) 申請退費必須附上收據正本及申請書，缺一不可，否則不予受理。

(ii) 本學院退費係以支票或匯款方式辦理，受款人依當時學費收據抬頭為主，若需更改受款人，須將相關切結書及同意書填妥並蓋公司大小章連同收據、申請書一併繳交始得辦理。

(5) 本班無補課機制，課程均須於當期修習完畢。

(6) 如遇天然災害(颱風、地震、洪水、豪雨)，台北市政府宣佈停課，當日課程原則上將另擇日補課乙次，惟時間須與任課老師協商後再行通知。

(7) 學員於修習期間應遵守本學院規定，如有不當行為或影響授課或影響其他學員之學習，經通知仍未改善者，本學院得取消其修讀資格，且不予退費。

(8) 經確定可上課之學員如經發現資格不符規定，或所繳證件有偽造、假借、塗改等事情，即取銷錄取資格或開除就讀資格，且不發給任何有關之證明。如係在取得後始發覺者，公告並勒令撤銷核發之推廣教育證明書。

(9) 患有或疑似患有 SARS 或其他法定傳染病者，本學院得拒絕其入學及上課。

(10) 就讀本班不得辦理兵役緩徵。

(11) 本簡章若有未盡事宜，本學院保留得以隨時修改之權利。

**課程詳細內容洽詢電話：(02)2362-0502 分機 227 瞿小姐**



## 「金融科技系列—大數據與理財機器人」第 2 期 課程大綱

授課老師：張森林 臺大財務金融學系特聘教授及證券期貨中心主任

上課日期：109 年 5 月 31 日、6 月 7 日

上課時間：全日上課(上午 9:00-12:00 及下午 13:30-16:30)

日期	研討主題	課程重點
5/31(日) 上午	Session 1 財經大數據分析 (張森林教授主講)	1.1 財經大數據簡介與分析 量化分析介紹 重要財經資料庫簡介、基本分析簡介 技術分析簡介、基本分析與技術分析績效的實證研究 1.2 財經大數據分析:機器學習法與個案分析 機器學習法簡介、機器學習法運用於股價線型判斷個案簡介分析
5/31(日) 下午 & 6/7(日) 全日	Session 2 理財機器人 (張森林教授主講)	2.1 理財機器人市場簡介與分析： 財務顧問角色介紹、理財機器人的架構、理財機器人市場分析、國內外理財機器人服務公司簡介與評比等。 2.2 理財機器人的資產池特性分析： ETF 簡介、因子投資簡介、主動式與被動式投資的優缺點分析、國內外理財機器人服務公司使用的資產池分析。 2.3 理財機器人的資產配置模型建構方法和過程： mean-variance 投資組合模型介紹、Black-Litterman 資產配置模型介紹。 2.4 生命週期投資、人力資本與退休財務規劃： 生命週期投資簡介、人力資本、壽險與年金險需求、退休所得來源與規劃、社會保險退休金的角色及重要性、以房養老簡介、退休支出法則。 2.5 理財機器人的風險管理： 風險的種類與衡量方式、風險控管指數(risk control indices)、低波動度指數、投資人風險教育 2.6 理财機器人的績效評估方法

※本學院保留課程安排及師資調整異動之權利，授課日期、時間、地點或單元主題如有調整將會另行提前通知，並公告於本學院 1 樓大廳課程電子看板。