

2012 金融與科技論壇 (2012/5/19)

Venue: 孫運璿演講廳

8:40~9:10	報到	
9:10~9:30	Opening: (主辦單位致詞) 黃朝熙 (清華大學科技管理學院 院長) 謝夢龍 (中華金融操盤手協會 理事長)	
Session Chair	呂桔誠 (清華大學計量財務金融系教授, 前財政部部長)	
9:30~10:10 (大會主講)	程式交易：被逼進華爾街的火箭科學家 黃乃寬 (臺灣期貨交易所 副總經理)	
10:10~10:35	高效能運算環境介紹 黃維誠 (國家高速網路與計算中心)	
10:35~11:00	Tea Break	
Session Chair	黃乃寬	
11:00~11:40	程式交易在台灣金融市場的發展與應用 姜林杰祐 (高雄應用科技大學金融系)	
11:40~12:20	程式交易應用於可轉債的套利與避險 呂育道 (台灣大學資工系, 財金系 教授) 金國興 (萬能科技大學資訊管理系 教授)	
12:20~13:30	Lunch	
Session Chair	呂育道 Room 224	謝夢龍
13:30~13:55	Numerical Excellence for Financial Services 周立勇 (NAG 大中華區總經理)	程式交易在金融套利上的運用 高子鈞 (元大寶來證券自營部 資深副總)
13:55~14:20	Algorithmic Trading with MATLAB 莊賀鈞 (鈦思科技首席應用工程師)	資金管理的計量運用 黃怡中 (寶富期信公司投資長)
14:20~14:45	High Performance Computing in Finance Simon See (NVIDIA Chief Solution Architect Director for Solution Architect)	市場風險之管理系統簡介 賈惠美 (台灣經濟新報 協理)
14:45~15:10	Tea Break	
Session Chair	張焯然(清大計財系教授) Room 224	郭啟賢(成功大學會計系 教授)
15:10~15:35	波動率估計與應用 韓傳祥 (清大計財系 教授)	交易模型的風險管理 牛繼聖 (中國信託銀行證券部副總經理)

15:35~16:00	Nature of Jumps in VIX: Market Timing Hedge Funds 林月能(中興大學財務金融系 教授)	避險基金的風險管理 胡文 (香港展騰資產管理投資長)
16:00~16:10	Break	
16:10~17:00	Panel Discussion and Final Remark. Discussants: TBD	
17:20 ~	Banquet (蘇格貓底 Cafe , 位於校內總圖書館旁，小吃部對面)	