



網路金融創新產學小聯盟

Industry-Academia Alliance for Internet Financial Innovation

第 2023/03.04 期 - 雙月刊電子報

本聯盟獲科技部產學司補助

本期活動

2023/3/7 量化金融機器學習國際研討會暨工作坊

International Conference and Workshop of Machine Learning in Quantitative Finance

本國際活動匯集來自美國、法國等地，在機器學習和量化金融領域的專家先進，共同研討全球最新進展。會議由三場主題演講和十一場技術工作坊構成，展示獨特的產學統合，應用前沿技術解決金融和經濟的問題，內容包括 asset pricing, risk management, financial stability, sentiment analysis, high frequency trading, DeFi 等人工智慧與機器學習的應用。本活動由政治大學與清華大學合辦，在3月7日於政治大學公企中心舉辦。



2023 AI創新應用論壇

ChatGPT/生成式AI

技術展望與未來衝擊和契機

時間：
3/26/2023(週日)
10AM-12PM

地點：
國立清華大學
台達館環德講堂

主辦單位：
國立清華大學桃竹苗地區校友會

協辦單位：
清華大學網路金融創新產學小聯盟、
清華大學月涵學校、清大電機系友會

報名QR code & 連結：





王可言博士



林文源博士



張俊盛博士



陳佩君博士



謝宗震博士

時間	活動環節	主持人&與談人
10:00-10:05	引言	引言主持人 林子渝 格睿思國際企業管理顧問有限公司執行長 NTHU 外語 96
10:05-10:35	生成式 AI 技術展望與未來衝擊和契機	陳佩君博士 微軟台灣人工智慧研發中心技術長 NTHU 物理 97B/EE99G
10:35-11:00	展望公共化 AI:人文社會領域參與 AI 協作與發展的願景	林文源博士 清華大學人文社會 AI 應用與發展研究中心主任 NTHU 中語 95B/社人所 98G
11:00-11:40	論壇	論壇主持人 彭建凱 聯發科客製化晶片事業部行銷處處長 NTHU 核工97B, 電機99G 與談者1:(依筆畫順序) 台灣金融科技董事長 NTHU 數學 77B/79G 與談者2: 林文源博士 清華大學人文社會 AI 應用與發展研究中心主任 NTHU 中語 95B/社人所 98G 與談者3: 張俊盛博士 清華資工系教授 NTHU 動機 77B/計管所
11:40-12:00	Q&A	與談者4: 陳佩君博士 微軟台灣人工智慧研發中心技術長 NTHU 物理 97B/EE99G 與談者5: 謝宗震博士 詠銓智能執行長 NTHU 數學 07B 統計 09G/13D
12:00-14:00	會後餐聚	清華水漾餐廳

相信大家都很想多了解最近最吸睛的ChatGPT，也很想知道是否ChatGPT將取代掉我們白領的工作。在這次由清大桃竹苗校友會舉辦的論壇裡，我們很榮幸邀請到了我們清大優秀的學長姐，也是這領域裡超級重量級人物，來與我們分享他們的見解與看法。名額有限，請速報名囉～

2023/4/11 第五屆411AI日全智動交易論壇

推動量化交易有成，永豐金證券擴大舉辦第五屆411AI日，今年以全智動交易為主軸，與產學精英共議AI在投資策略上的廣泛與深度運用、創新趨勢及台股交易實戰分享，並首創實況一日實盤程式交易當沖大賽，論壇與賽事同步展開，冠軍得主當日以多空連擊策略奪冠。永豐金證券表示，全智動代表全面智慧自動化交易，重點囊括AI應用於ETF投資、高頻交易、AI與交易者的勝負、不寫程式也能程式交易；創辦411AI日五年以來，引領更多投資人深入認識量化交易，今年活動吸引超過四百多位投資人線上及線下共襄盛舉，現場參與人數相較去年增加約4成。

論壇邀請五大講師發表量化交易策略精髓，包括清華大學韓傳祥教授分享AI/ML在指數追蹤與投資組合的應用。交易常勝軍廖建松(超五)思考AI開創的新局面，提出程式交易的發展架構與實踐範例。嘉實資訊鍾淳豐資深協理以「XQ量化積木」為主軸，帶領與會者進入NO CODE的程式交易世界。威旭資訊董事長曾永泉以AI如何與交易結合並提升交易績效作為核心問題，講授重要的交易心法並解密高頻交易的世界。FinLab創辦人韓承佑博士通過Quant4.0，介紹自動化AI與演算法。

資料來源：<https://money.udn.com/money/amp/story/5607/7093577>



隨著台灣高齡人口日益見增，政府逐漸重視退休銀髮族群的權益，特別是在醫療健康與理財保險等項目，研討會中會強調保險科技的落地應用以及區塊鏈技術的創新，依據可行性、配適性以及創新性，探討台灣保險科技數位轉型的發展願景。

◆日期與時間：2023/05/17 (週三)，下午 1:30 - 5:00

◆地點：台大集思會館-蘇格拉底廳

(106台北市大安區羅斯福路四段85號B1)

◆報名表單：<https://www.accupass.com/event/2304110738033864346440>

5/17(三) | 喬安x清大

保險科技 區塊鏈創新及 健康大數據研討會



報名連結



1:30-5:00
台大集思會館-蘇格拉底廳

主辦單位



國立清華大學
NATIONAL TSING HUA UNIVERSITY



黃能富 教授

清華大學資訊工程學系



韓傳祥 副教授

清華大學計量財務金融學系



王儷玲 教授

政治大學風險管理與保險學系
前金管會主委



黃啟誠 董事長

博斯資訊安全創辦人

台美固定收益ETF大增的資金流動解讀

摘要

美國市場：

固定收益ETF淨流入表現最為強勁，達到240億美元水準，占總資產管理規模(AUM)的2.01%。這意味著在目前的經濟環境下，投資者對於固定收益產品有高度的需求，可能是由於對股票市場的不確定性和尋求更穩定收益的需求所驅動，尤其是近期3月份以來美國與歐洲的銀行財務危機，讓恐慌指數（VIX）達到今年以來的高峰，美元指數亦持續下滑。此外，美國股票ETF和國際股票ETF分別吸引了近33億美元和9億美元的淨流入，表明投資者對股票市場仍有信心。而美國的槓桿ETF資金流入也達到23億美元，占AUM的4.31%。相較之下，反向ETF和其他類型的ETF資金流出較為明顯。

台灣市場：

國內成分證券ETF和債券ETF表現較佳，淨流量分別為243億與221億新台幣，與美國市場的趨勢相仿，台股債券ETF的表現也同樣強勢。值得注意的是，與期貨相關的槓反型期貨與原型期貨的AUM佔比都達到25%以上。顯示投資人仍長期佈局國內證券與債券市場，但對於短期風險的意識高漲，尋求多元化投資組合以分散風險。

Asset Classes (March 2023)	Net Flows (\$, mm)	AUM (\$, mm)	% of AUM
U.S. Equity	3,294.94	3,967,836.34	0.08%
International Equity	940.29	1,230,424.80	0.08%
U.S. Fixed Income	24,432.91	1,216,982.19	2.01%
International Fixed Income	174.01	145,695.02	0.12%
Commodities	-238.65	135,803.07	-0.18%
Currency	-122.53	3,597.38	-3.41%
Leveraged	2,387.92	55,373.98	4.31%
Inverse	-1,593.59	21,784.00	-7.32%
Asset Allocation	-221.57	15,865.59	-1.40%
Alternatives	-228.21	7,189.14	-3.17%
Total:	28,825.52	6,800,551.51	0.42%

(資料來源: ETF.com)

Asset Classes (March 2023)	Net Flows (NTD, mm)	AUM (NTD, mm)	% of AUM	YTD 2023 Net Flows (NTD, mm)
國內成分證券	24,347.63	934,675.20	3%	49,329.33
債券成分	22,125.79	1,336,321.75	2%	133,534.73
槓桿型及反向型	12,896.12	137,987.31	9%	-2,634.77
國外成分證券	7,553.50	233,562.49	3%	7,625.69
槓桿型及反向型期貨	5,779.46	19,566.37	30%	3,990.39
原型期貨	2,037.55	7,831.22	26%	1,791.65
ESG ETF	178.08	8,230.17	2%	500.51

(資料來源-睿富者整理)

通過對美國和台灣在2023年3月ETF淨流入的深入分析，我們可以得出兩個市場存在顯著差異，但投資者在兩地市場中都展示出對股票市場的信心。未來，投資者應密切關注全球經濟環境和各國政策變化，以便在兩地市場中把握更好的投資機會。

詳細文章內容請見：

<https://medium.com/@qffers1/固定收益etf熱潮-揭秘美台市場強勁淨流入背後的投資機密-311d830d13eb>

聯絡我們

聯絡人：秘書 張小姐

Email：netfin@my.nthu.edu.tw

聯絡地址：300044 新竹市東區光復路二段101號

國立清華大學計量財務金融學系 台積館413室

聯絡電話：03-5162551