

SAS 財金資料大數據分析課程

■課程特色：

財富管理市場急速擴張，與金融商品多元化、數位化趨勢，金融人才轉型勢在必行；想在財富管理市場脫穎而出，關鍵在於具備「妥善管理及運用大數據財金資料」的專業能力。

課程會簡單介紹 SAS EG 的基本操作方式與投資學的相關概念。課程可接受尚不熟悉 SAS 或投資學的學員。兩天十二小時的迅速養成，教學方式以實際上機操作，搭配實際數據演練方式，超越一般純理論與概念的課程，能夠協助您以最快速有效的方式，將課堂所學習技巧，於分析工作中速現績效。

■課程師資：

美國紐約州立大學水牛城分校 財務金融博士

國立中央大學財務金融系 沈信漢 副教授

■課程時間：

上課時數：2 天、共 12 小時。

107 年度課程各梯次日期	
第一梯次	4/28~4/29

■課程目標：

金融市場為公開市場，每日都提供大量數據。金融資料分析者可應用歷史資料實際執行財務學資產訂價理論中的不同模型，並依據此模型進行對未來報酬率的估計與價格預測。然而面對如此大量的數據，一個高效率程式工具在執行大規模系統性分析的過程中是不可或缺的。簡單的程式工具(如 Excel)雖能分析一支至數支證券，但當考慮的證券數量多或者分析步驟繁複嚴謹時便力有未逮。因此高效率的程式工具對執行精緻深入的財金資料分析為不可或缺的。

SAS 為國際間深受認可的商業分析軟體。不同於其「統計軟體」的刻板印象，除了大量統計分析功能外，SAS 的強項其實更在大數據的整理與重組。本次課程將帶領學員熟悉 SAS 的基本操作，配合實際臺灣股票市場資料(來自 TEJ 資料庫)

進行分析。學員們將實際操作幾個實證投資學中最常使用的分析方法，包括投資組合建立分析、時間序列模型建立估計、事件研究法與事件後股價走勢分析。

■適合對象：

- 財務金融領域學術研究人員（如大專院校教師、博士生、研究生等）
- 進行證券市場分析之金融從業人員（如理財規劃人員、分析師、交易員等）
- 對系統性股票投資策略有興趣之個人

■課程內容：

上課日期	課程目標	授課內容
第一天上午 (3 小時)	投資組合建立與分析	(1) 投資組合建立與報酬率計算 (2) 報酬率單變數分析
第一天下午 (3 小時)	交易策略執行與評估	(1) 調整後報酬率計算 (2) Fama-French 三因子模型估計 (3) 動能策略執行與分析
第二天上午 (3 小時)	時間序列預測模型	(1) ARIMA 模型估計 (2) GARCH 模型估計
第二天下午 (3 小時)	事件後股價走勢分析	(1) 事件研究法 (2) 事件後長期報酬率計算 (3) 外部資料讀取

■報名程序：

步驟一：請連結網址填寫詳細報名資料

<http://erp.mgt.ncu.edu.tw/zh-TW/contact/apply>

步驟二：將由專員與您聯繫，並依照您所選擇之繳費方式提供繳費資訊。

步驟三：依照繳費資訊完成報名，並回傳繳費存根，即可完成報名手續!!

■課程諮詢：

課程諮詢專線：(03)426-5397 孫小姐

傳真：03-426-4250

聯繫 Email 至 ncu_erp@mgt.ncu.edu.tw 孫小姐

■入校停車費用：(桃園班適用)

停車費用一天 8 小時 \$60。參與本次課程之學員，需要申請入校停車者，請於報名系統填妥資料，中心會為您辦理。

■住宿資訊：(桃園班適用)

1. 中央大學中大會館(均為 2 人房)
—欲申請會館住宿者請在報名系統上註明
2. 車站附近：中信飯店、古華飯店

■交通資訊 <http://www.ncu.edu.tw/directions.php>**■注意事項：**

- 若未達最低開課人數，將於開課前三日公告聯繫。
- 本中心得保留修訂課程及未達最低開課人數時取消課程之權利。
- 主辦單位：中央大學企業資源規劃暨大數據分析中心
- 退費說明：
 - 1)實際開課日前第 30 日以前要求退費者，可全額退還；實際開課日前第 29 日至前第 1 日，退還費用總額百分之九十；實際開課日後但未逾全期(或總課程時數)三分之一者；應退還費用總額百分之五十；實際開課日後已逾全期(或總課程時數)三分之一者，得全數不予退還。
 - 2)因故未能開班上課，則全額退還已繳費用。

注意事項：1.本中心得保留修訂課程及未達最低開課人數時取消課程之權利 2.本中心保留對本課程簡章修改權。