

2014 財務數學與財務統計研討會

議 程

日期：2014 年 8 月 29 日(星期五)

地址：國立臺北大學臺北校區（臺北市中山區民生東路三段 67 號）

主辦單位：國立臺北大學商學院統計學系

主辦人員：顏汝芳 助理教授（國立臺北大學商學院統計學系）

協辦人員：傅承德 講座教授（國立中央大學統計研究所）

贊助單位：科技部自然司數學研究推動中心

參加對象：歡迎各科系大學生、碩博士生、教授、以及社會人士踴躍報名

報名網址：<http://goo.gl/gQx1pI>（請於 8/22 前進入網頁報名）

時 間	會 議 內 容
08：30～09：00	來賓報到、資料領取 (地點：教學大樓 101 教室)
09：00～09：10	[開幕典禮致詞暨團體照相] 臺北大學商學院院長 蔡建雄教授 臺北大學統計學系系主任 黃怡婷教授
09：10～10：00	[學術專題演講] 張森林教授暨系主任（臺灣大學財務金融學系）
10：10～11：00	[實務專題演講] 黃天仁副總（元大寶來證券金融交易部）
11：10～11：55	[學術演講一] 蔡子皓教授（清華大學計量財務金融學系）
11：55～13：30	午餐
13：30～14：15	[學術演講二] 謝佩芳教授（清華大學計量財務金融學系）
14：15～15：00	[學術演講三] 林士貴教授（政治大學金融學系）
15：00～15：30	茶敘
15：30～16：15	[學術演講四] 鄧惠文教授（中央大學統計研究所）
16：15～17：00	[學術演講五] 戴天時教授（交通大學資訊管理與財務金融學系）

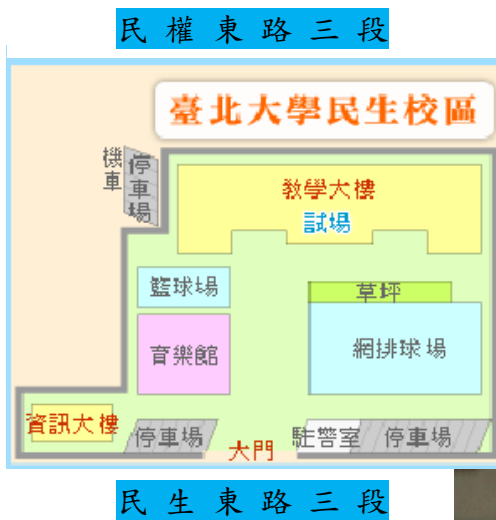
詳細議程

時 間	會 議 內 容
[學術專題演講] 09：10～10：00	主持人：傅承德（國立中央大學統計研究所講座教授） 演講者：張森林（國立臺灣大學財務金融學系教授暨系主任） <i>Optimal Portfolio Allocation with Option-Implied Moments: A Forward-Looking Approach</i>
[實務專題演講] 10：10～11：00	主持人：顏汝芳（國立臺北大學統計學系助理教授） 演講者：黃天仁（元大寶來證券金融交易部副總） <i>台灣權證市場業務暨交易統計策略</i>
[學術演講一] 11：10～11：55	主持人：鄭宏文（東吳大學財務工程與精算數學系助理教授） 演講者：蔡子皓（國立清華大學計量財務金融學系副教授） <i>Variance Premium, U-shape Pricing Kernel and Index Options Valuation</i>
11：55～13：30	午餐
[學術演講二] 13：30～14：15	主持人：蔡維哲（國立中山大學財務管理學系助理教授） 演講者：謝佩芳（國立清華大學計量財務金融學系助理教授） <i>A Survey of Empirical Studies on Trading Activities in the Taiwan Index Options Market</i>
[學術演講三] 14：15～15：00	主持人：李美杏（國立臺北大學統計學系助理教授） 演講者：林士貴（國立政治大學金融學系副教授） <i>Deposit Insurance Premiums Considering Moral Hazard: A Risk-Based Pricing Formula and Hedging with Credit Default Swaps</i>
15：00～15：30	茶敘
[學術演講四] 15：30～16：15	主持人：白惠明（國立臺北大學統計學系副教授） 演講者：鄧惠文（國立中央大學統計研究所助理教授） <i>Optimal Exponentially Tilted Importance Sampling in Pricing Financial Derivatives</i>
[學術演講五] 16：15～17：00	主持人：王鈞茹（臺北市立大學資訊科學系助理教授） 演講者：戴天時（國立交通大學資訊管理與財務金融學系教授） <i>Improving Pricing Accuracy for Various Numerical Methods with the General Control Variate Method</i>

臺北校區・交通路線圖



臺北校區・校內平面圖



■ 臺北校區・交通路線資訊

NTPU Taipei Campus Direction



機場路線〈松山機場→國立台北大學〉：

NTPU Taipei Campus Direction

請搭乘公車「617」路至「復興北路口」站下車，沿復興北路直行右轉至民生東路右轉即至國立台北大學〈步行約十分鐘〉。



捷運路線〈台北車站→中山國中站〉：

MRT (From Taipei Main station)

請於台北車站進入捷運車站後，搭乘捷運「板南線」〈藍線〉，於「忠孝復興站」下車後再轉搭「文湖線」，第一月台即為往「中山國中站」。

中山國中站出站後，請右轉沿復興北路直行至民生東路再右轉步行十分鐘即至國立台北大學。



火車路線：

TRAIN:

搭乘火車者可於台北火車站下車後，依「捷運路線」至國立台北大學；於松山火車站下車者，可搭乘「63 路」公車至「復興北路口」站下車，沿復興北路直行至民生東路口右轉步行約十分鐘即至國立台北大學。



公車路線：

Bus:

可搭乘 286、277、518 三線於「台北大學」站下車。



計程車：

Taxi:

台北火車站至國立台北大學，車費約 200 元內，正常車程約 30 分鐘。

松山火車站至國立台北大學，車費約 200 元內，正常車程約 30 分鐘。