

# 應用動態網絡與變數選取技術之資產配置法

黃士峰 教授

國立中央大學統計研究所

## 摘要

資產配置是財務上廣受人們關注的議題，隨著科技的進步，投資人有機會藉由資通訊的軟硬體設備收集越來越多的即時資料，如何從眾多複雜的資料中過濾出有益於資產配置的訊息，自然成為需要突破的挑戰。本演講將透過實際資料，呈現如何應用動態網絡與變數選取技術，協助釐清不同資產間的相互影響關係，同時從市場中挑選出有潛力之投資標的，以建立合適的資產配置。