高雄市政府地方產業創新研發推動計畫
SBIR成果發表會

富盈財務科技股份有限公司

FOLION

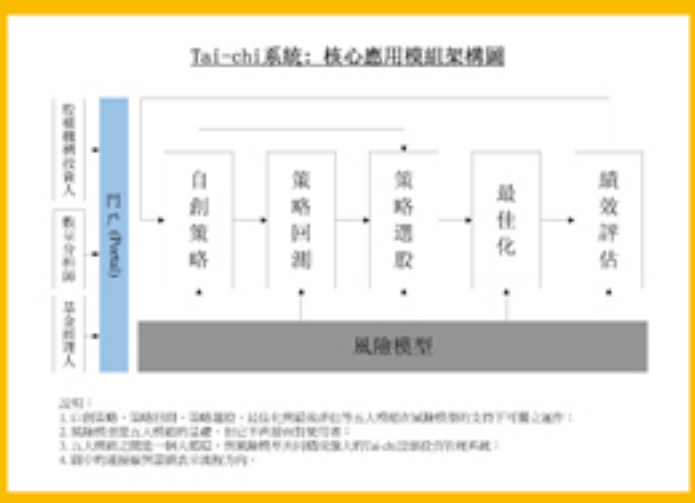
計畫名稱：Folion Tai-Chi System 模組研發計畫
聯絡人：吳婧嘉
聯絡電話：(07)525-0036
E-mail：esther@folion.com.tw

公司簡介

富盈財務科技公司服務項目：
諮詢顧問－財富管理業務、策略性投資
系統整合－組合基金管理、策略選股、財富管理
教育訓練－退休理財規劃、資產配置

計畫簡介與創新重點

此計畫旨在「研發一股票研究投資系統」，有別於市場，其為第一個針對台灣經理人操作習慣所研發設計之系統。主要進行數量投資方法之研究，並將多因子模型應用於投資並且系統化，對於投資管理系統之「方法、流程、技術」有重大突破與創新。本系統主要價值：數量化策略選股、多因子QEPM績效歸因、多因子alpha模型平台、策略回測平台。

技術與市場效益

- 系統直接效益
  1. 投資流程系統化
  2. 直覺式最佳化演算法
  3. 功能齊全滿足實務需求
- 產業貢獻效益
  1. 配合政府「南北雙核心」構想，孕育財金專業人才於高雄
  2. 財金與資訊跨領域結合，有助於資訊產業人才培育與轉型
  3. 改善台灣金融業產品同質性過高的現象