

# 國立中山大學應用數學系

## 學術演講

講者：Prof. Wolfgang Haredle (Blockchain Research Center,  
Humboldt-Universität zu Berlin, Berlin, Germany)

講題：臺灣高市值電子與金融業的金融風險指標

時間：2024/03/07 (Thursday) 14:10~15:00

地點：理 SC 4009-1 教室

茶會：13:30

### Abstract

經過全球金融危機和 COVID-19 大流行後,理解和預測系統風險變得越來越重要。作為全球半導體和電子製造中心,臺灣股市的穩定性與全球供應鏈和經濟息息相關。本論文調整了基於 Lasso 分位數迴歸(Lasso quantile regression) 的金融風險指標 (Financial Risk Meter, FRM) 框架來評估臺灣股市中高市值電子與金融業的系統風險和尾部共同運動(tail comovement)。

為了使 FRM 能有效辨識與預測經濟衰退期,我們利用機器學習的技術並與臺灣國家發展委員會提供的景氣指標燈號進行比較加以驗證。此外,我們也將 FRM 與其他風險指標,如 VIXTWN 和 Google SVI 進行對比,以全面理解臺灣電子和金融領域中的系統風險。本論文的貢獻在於提供一個以本土化的角度來評估系統風險,為政策制定者和投資者提供見解。

關鍵詞:FRM(金融風險指標);Lasso 分位數迴歸;系統風險;經濟衰退;金融網路

敬請公告！歡迎參加！

應用數學系：<http://math.nsysu.edu.tw>

校園地圖：[http://math.nsysu.edu.tw/var/file/183/1183/img/779/nsysu\\_math\\_map.jpg](http://math.nsysu.edu.tw/var/file/183/1183/img/779/nsysu_math_map.jpg)

交通資訊：<https://www.nsysu.edu.tw/p/412-1000-4132.php?Lang=zh-tw>

協辦單位：跨領域及數據科學研究中心



應用數學系



校園地圖



交通資訊