

# 人工智能(AI)資產配置課程

## 課程主旨及內容

本課程結合人工智慧 (AI) 技術與傳統資產配置理論。內容涵蓋機器學習基礎、大數據分析、風險模型建構及演算法交易策略。透過實務案例與 Python 工具實作，學員將學習如何開發智能投資組合，優化風險調整後收益，並應對市場動態。

學員將掌握 AI 驅動的資產配置核心技術，包括數據預處理、模型訓練與回測方法。課程強調實戰應用，使學員能獨立設計基於 AI 的動態資產配置策略，提升投資決策效率與精準度，並理解相關倫理與監管挑戰，為金融科技創新奠定基礎。

- 第 1 堂：引言與基礎概念：介紹 AI 在資產配置的應用場景、傳統方法與智能策略的對比，以及課程框架
- 第 2 堂：金融數據處理與特徵工程：使用 Python 進行市場數據清洗、因子提取與時序數據預處理
- 第 3 堂：機器學習基礎與投資模型：講解監督式學習 (如回歸、分類) 於收益預測與風險分類的應用
- 第 4 堂：深度學習於市場預測：探討神經網絡、RNN 與 LSTM 在價格趨勢分析中的實作
- 第 5 堂：投資組合理論與 AI 整合：結合馬科維茲模型與 AI 優化技術，動態調整權重
- 第 6 堂：風險管理與模擬測試：運用 AI 建置風險模型 (如 VaR)、壓力測試與蒙地卡羅模擬
- 第 7 堂：演算法交易與執行策略：設計 AI 驅動的 trading 策略，包括再平衡與市場微結構適應
- 第 8 堂：實務案例與回測分析：分析全球資產案例 (如股債、另類投資)，並以 Backtesting.py 進行策略驗證
- 第 9 堂：倫理、監管與未來趨勢：討論 AI 偏誤、監管合規性 (如 MiFID II)、及 DeFi 等新興應用
- 第 10 堂：與課程內容相關的開卷考試

## 課程詳情

截止報名	2026 年 3 月 3 日
開課日期及時間	2026 年 3 月 9 日至 4 月 13 日， 逢星期一及三，19:00 – 22:00 (詳情見背頁)
對象	18 歲或以上人士
導師	本課程導師為哲學博士，具備豐富教學經驗
授課語言	粵語
學時	30 小時
學費	MOP3,000
上課地點	澳門大學
證書頒發	出席率達 80% 及考核合格，可獲頒澳門大學持續進修中心發出之課程結業證書



課程編號：2510100388-0  
2023-2026 年度“持續進修發展計劃”獲批准之項目  
相關報讀詳情請翻閱背頁



## 付款資訊

報名費	MOP100 (不包括在持續進修發展計劃進修資助範圍內，學員須自付此費用)
付款方法	報名時，學費連同報名費 一、以銀聯 / VISA / MASTER 信用卡付款 (可選擇網上付款) 二、以電子支付方式付款 三、以劃線支票或本票遞交，抬頭為『澳門大學』，期票恕不接受 四、以教育及青年發展局持續進修發展計劃進修資助付款 (如適用)，報讀者需帶備澳門居民身份證親臨中心辦理手續
所需文件	報名表、身份證明文件各一份
地址	澳門大學持續進修中心 澳門氹仔大學大馬路 澳門大學 E3 中銀百年紀念大樓地下
辦公時間	星期一至五：10:00 – 20:00 星期六：10:00 – 17:00 星期日：10:00 – 13:00 (澳門公眾假期休息)

### 【報名從速，名額有限，先到先得，額滿即止。】

如欲報讀，請先前往中心網頁 (<https://cce.um.edu.mo/>) 點擊“網上報名”登入賬號或註冊新賬號，登入或註冊成功才可繼續選擇課程進行報名，並上傳所需文件一併提交。中心將以電郵回覆作實是否報讀成功。恕不接受電話及傳真報讀。

## 注意事項

1. 持續進修發展計劃進修資助對象：年滿 15 歲的澳門特別行政區居民並已成為“持續進修發展計劃”受益人。所有獲計劃資助的項目只接受 15 歲或以上的人士參與，包括使用及非使用計劃資助之人士。如受益人未滿 18 歲，還須填寫專用的報名表格 (於“持續進修發展計劃”下載)，並由其父母任一方或監護人簽署確認。
2. 參加上述計劃的辦法及資助詳情，請瀏覽教育及青年發展局網頁：<https://www.dsedj.gov.mo/pdac/2023/index.php> 或致電教育及青年發展局查詢，電話：2842 5199。
3. 中心保留隨時更改課程細則之權利。課程相關資訊可於中心網頁查閱，如有更改恕不另行通知。
4. 如報名人數不足，中心保留對課程延期或取消之權利。相關退款詳情請瀏覽中心網頁：<https://cce.um.edu.mo/download/>。
5. 證書頒發：學生每課程出席率必須達 80% 並須每科考試合格，方可獲頒發證書；於不設考試之課程，學生每課程出席率必須達 80%，方可獲頒發出席證書。如學生申請缺席上課，須有合理原因及提供相關證明文件，病假須遞交醫生證明。申請者須於缺席日起計 10 天內向中心遞交申請表及證明文件。中心保留審批之決定權。
6. 若申請退學，學員必須遵守中心的退學規章辦理有關退學手續，詳情請瀏覽中心網頁：<https://cce.um.edu.mo/download/>。

## 上課時間表


2026	日	一	二	三	四	五	六
三月	1	2	3	4	5	6	7
	8	9	10	11	12	13	14
	15	16	17	18	19	20	21
	22	23	24	25	26	27	28
	29	30	31				
四月				1	2	3	4
	5	6	7	8	9	10	11
	12	13	14	15	16	17	18
	19	20	21	22	23	24	25
	26	27	28	29	30		



## 2023-2026 “持續進修發展計劃”

### 課程名稱(人工智能(AI)資產配置課程)(課程編號：2510100388-0)

#### -課程章程-

1. 機構名稱：澳門大學持續進修中心
2. 報讀資格：其他(18歲或以上人士)  
招生對象必須為於2023年至2026年任一年度12月31日或該日前年滿15歲的人士，  
包括使用及非使用本計劃資助之人士。
3. 上課日期：2026-03-09 - 2026-04-13
4. 上課時間：星期一 19:00-22:00；星期三 19:00-22:00
5. 課 節：10(每節 180 分鐘)
6. 學 費：3000
7. 導 師：譚樹明
8. 收生名額：30
9. 雜 費：100 明細：報名費
10. 上課地址：澳門大學(中國澳門氹仔大學大馬路) 課室：NEW ROOM
11. 課程大綱：
12. 報名方式：持有效澳門居民身份證到機構報名，並需提供本地手提電話作報名及接收驗證碼之用。
13. 電子簽到：以澳門居民身份證進行簽到及簽退，否則不計算入有效出席率內  
- 導師：課程開始前30分鐘內及課程結束後30分鐘內  
- 學員：課程開始前30分鐘至開始後15分鐘內；課程結束後30分鐘內
14. 備 註：
  - (1) 保證金為學費的30%，出席率達70%或以上(以課節計算)可獲退還；
  - (2) 如電子簽到設備故障，機構應立即致電支援熱線 **6521 8801**求助及報備，並透過教青局的手機簽到應用程式產生限時有效的二維碼，導師及學員於第12點所述的時段內進行手機簽到；機構應於簽到日翌日起計7日內在網上帳戶向教青局提交報告，並附同證明文件及資料。
  - (3) 簽到紀錄及課程資料
  - (4) 查詢、投訴、舉報

