

2006 "Herbert Simon 系列講座 " 之十二

主講人： Prof. Wolfgang Härdle

Institute for Statistics and Econometrics Humboldt-University

主辦單位：中央研究院統計科學研究所、
政治大學研究發展處、社會科學學院、經濟系、暨人工智慧經濟學研究中心、
真理大學財務金融系

協辦單位：中華民國人工智慧學會

各位先進：

2006 "Herbert Simon 系列講座 " 之十二 -"Statistics in Economics and Financial Markets" (HSSS 2006, Series #12) 即將於 4 月 24、25、26 日正式於中央研究院、政治大學以及真理大學舉行，分別由國際著名之應用統計學者 Wolfgang Härdle 教授主講！以下為本次活動簡介，期待您撥冗參加！

"Herbert Simon 系列講座 " 乃為紀念 Herbert Simon 而設，Herbert Simon 為 1975 年電腦科學界中之殊榮 -- 杜林獎 (A. M. Turing Award) – 之得獎人暨 1978 年諾貝爾經濟學獎得主，並於 1993 年因對心理學的終生傑出貢獻而榮獲美國心理學會獎 (American Psychological Association's Award) ，他率先於經濟學中建立「有限理性」的概念，並利用電腦演算來了解及測試「有限理性」的行為及決策模式，不但開啓了「行為經濟學」的大門，並為日後跨科際、跨學界的「計算智慧」奠定了先機。

計算智慧 (Computational Intelligence) 為一系列專門技術之統稱，包含了類神經網路、模糊邏輯、演化計算等，且為計算經濟學與計算財務學中最重要的工具之一。在過去的十年間，計算智慧已被廣泛地應用在各類經濟與財務之模型、預測、與分析上。其中最顯著的應用便是在財務資料探勘 (Financial Data Mining) 與代理人基計算經濟 (Agent-Based Computational Economics) 的研究域領中。

● 講座學者簡介：

Wolfgang Härdle 教授為德國 Humboldt 大學統計系教授，乃當今國際著名之應用統計學者。Härdle 教授之研究專長為統計方法於經濟與財務分析之運用，其在此領域相關著作頗豐，共有專書著作或編撰 15 本，期刊著作方面，僅由 2003 年至今便已有 18 篇。Humboldt 大學有一 Center for Applied Statistics and Economics (CASE) 研究中心，該中心下轄 14 位正教授及 1 位博士，Härdle 教授即為此一具備相當規

模與研究能力之研究中心主任。

Härdle 教授將統計理論與分析方法，在方法論方面之研究專長為計算統計學 (computational statistics)、無母數及半母數分析 (nonparametric and semiparametric models)、部分線性模型 (partially linear models)，而在應用領域方面，則包含保險、風險衡量等財務問題。Härdle 教授更結合正統統計分析方法與計算智慧工具，用於解決實際問題之上。有關 Härdle 教授之詳細專長領域請參考 http://appel.rz.hu-berlin.de/Zope/ise_stat/wiwi/ise/stat/personen/wh。

- 講座議程：

主題: Statistics in Economic and Financial Markets

| 場次 | 時間 | 地點 | 講題 |
|----|---------------------------------|-------------------------|---|
| 1 | 4 / 24 (一) 10 : 30 – 12 : 00 | 中央研究院 統計科學研究所二樓交誼廳 | Inhomogeneous Dependency Modelling with Time Varying Copulae |
| 2 | 4 / 25 (二) 14 : 00 – 17 : 00 | 真理大學(淡水校區) 管理學院十樓會議廳 | Statistics in finance and computing |
| 3 | 4 / 26 (三) 19 : 00 – 22 : 00 | 政治大學 綜合院館一樓 270113 室 | Pensions, Lotteries, Financial Markets: Measuring Statistical Risk |

※ 茶會：

4 / 24 (一) 10 : 10 統計所二樓交誼廳。

HSSS2006 誠摯邀請各位先進與同學的參與。本次大會將不收取任何費用，但必須先向大會註冊，註冊請email至aiecon.center@gmail.com 留下您的姓名、任職單位或就讀校系，以及聯絡方式，並註明參與的課程場次

p.s. 交通及校內地圖請見附檔