

F E N I U S

菲尼斯基金小幫手



金融科技

文字探勘與機器學習

第十七組

B05902027 尹慕哲

R07723037 陳韻竹

R06723051 姜奕帆



台灣人對LINE的依賴度、黏著度高

- 不管對個人、職場、企業甚至政府而言，LINE都被視為重要的即時溝通管道
 - LINE TODAY, LINE Pay, LINE MOBILE等功能，使LINE成為更全方位的智慧入口
- 大小企業皆進駐LINE平台生態圈，分食流量紅利

LINE台灣月活躍用戶破2,100萬，特愛三大功能、使用率名列全球第一

2018.12.28 by  唐子晴



LINE：吸收即時資訊的新管道



- 輕鬆、方便、快速、即時
 - 例子：微股力官方帳號
 - 輸入股票代碼，即可查詢各種股票資訊
 - 股價
 - 走勢圖
 - K線圖
 - 法人買賣超
- 但尚未有針對基金所做的資訊平台

專案發想

FENIU 菲尼斯基金小幫手 LINE ChatBot



- 創造輕鬆查詢**基金資訊**的平台



加入好友，試用看看！

六大功能



基金資料型態



種類

指數型
一般股票型
科技型
中概型
價值型
店頭市場型



區間

過去三年

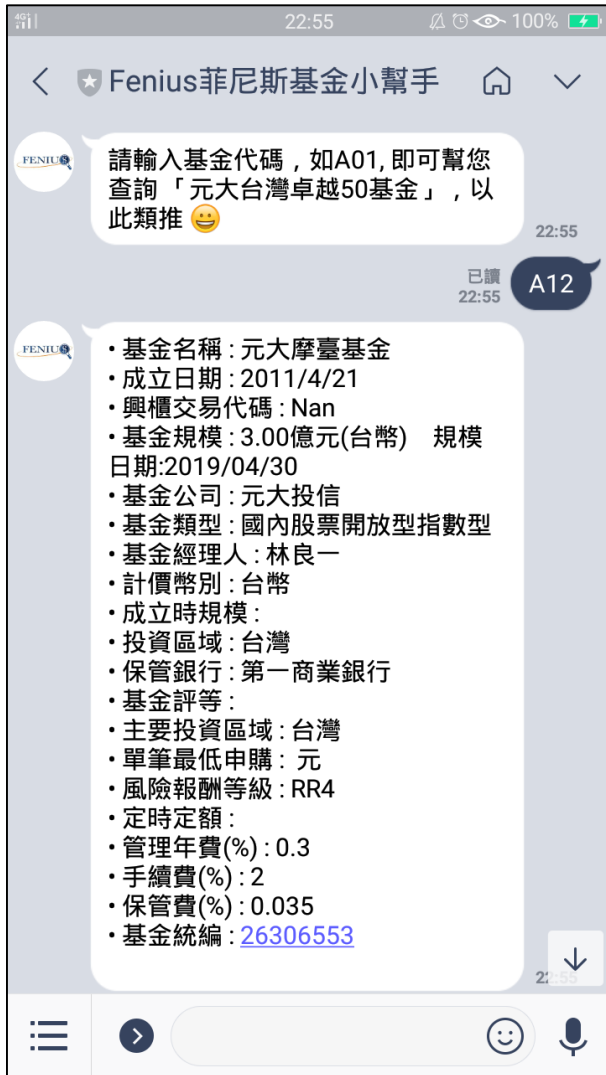


來源

MoneyDJ
TEJ

基金基本資訊

輸入相對應的基金代碼，即可顯示基金基本資訊。



基金指標介紹

介紹FENIUS所採用的績效指標：Aumann and Serrano (2008)的 Riskiness與 Schnytzer and Westreich (2013) 的Q值轉換

- 傳統的績效指標如 Sharpe ratio、Treynor ratio、Jensen's alpha等等，各別採用單純的標準差、貝他係數衡量風險，也各有不足之處，如標準差無法分辨正向與負向之波動，貝他係數只能捕捉低階動差風險。
- Riskiness在理論、數學、經濟概念上突破了傳統績效指標的限制，更貼近投資人對待風險的態度。
- 算法： $E\left[e^{-\frac{x}{R}}\right] = 1$
 $E[\cdot]$ 表期望值， e 為自然對數之底數， x 為基金報酬率， R 即是該檔基金的 Riskiness。
- Riskiness值越小越好

產業最佳基金



排名	基金名稱	風險Q值
1	聯邦中國龍基金	$2.8838 * 10^{-4}$
2	日盛新台商基金	$3.1232 * 10^{-4}$
3	台新中國通基金	$7.8993 * 10^{-4}$
4	第一金大中華基金	$1.3428 * 10^{-3}$
5	保德信台商全方位基金	$4.6115 * 10^{-3}$
6	國泰大中華基金	$7.1047 * 10^{-2}$

試算每檔基金之Riskiness值，
並予以排名

基金歷史淨值

輸入基金代碼，顯示基金近三年
淨值變化圖與變動率



投資組合建議



- 將各類別基金中的最佳基金挑出，總計6支基金
- 試算6支基金的各種組合，若以平均權重配置孰佳

基金網站連結



提供基金網站連結。

使用者透過FENIUS快速瀏覽資訊，發現有興趣的基金，想進一步深入瞭解，可透過此處提供的網站連結得到更多資訊。

F E N I U S

菲尼斯基金小幫手

Thank you!

