

證券期貨機構法人實務操作 進階研習課程

期貨產業發展基金
全額補助課程



辦理目的

培育更多具有證券期貨跨產業跨商品資產配置能力之基金管理人，並提供金融從業人員多元進修之管道，課程內容涵蓋風險管理、交易策略、大數據分析與演算，並結合模擬交易競賽，強化學習深度與廣度，進而提高本國法人機構期貨市場參與度，達到維護市場交易安全、保障交易人權益之目標，活絡期貨產業發展。

課程收費

由期貨產業發展基金全額補助，惟學員開課前須繳交保證金每名新臺幣3,000元，缺課未超過(含)3堂者課程結束後全額退還保證金。

課程期間

108年7月~9月，每週二、四下午2:30~5:30上課，每堂課程3小時(原則每週上課時數6小時)，共計18堂課，合計54小時。

上課地點：證基會教室(台北市南海路3號4樓)

報名日期：即日起至額滿為止

報名方式：至證基金網站報名: www.sfi.org.tw

報名資格：

1. 金融監督管理委員會、中央銀行、國家發展委員會及相關政府基金等主管機關代表。
2. 期貨業及證券業從業人員。
3. 銀行業、投信投顧業、保險業從業人員。

採機構推薦報名(不受理個人報名)，每機構以正取2名為原則(上列1、2項機構代表優先)，依各機構報名先後順序錄取，額滿為止，若有餘額開放其他金融機構參加。本基金會保留統籌分配之權利。

繳費方式：本基金會於報名審核後，以電子郵件通知聯絡人繳交保證金。



財團法人中華民國

證券暨期貨市場發展基金會
SECURITIES & FUTURES INSTITUTE

證券期貨機構法人實務操作 進階研習課程

培訓方式：分為「實務課程」及「模擬交易競賽」

實務課程

1. 課程分為三大模組－證券暨期貨市場與作業實務模組、證券暨期貨交易策略實務課程模組、大數據演算法進階實務課程模組，各模組將結合風險控管相關實務觀念及應用，共計18堂課，每堂課3小時，合計54小時。

2. 預訂課程

一、證券暨期貨市場與作業實務模組

- ◎ 國內外商品期貨及選擇權市場解析
- ◎ 國內外股價指數、股票期貨及選擇權市場解析
- ◎ 國內外匯率及利率期貨市場解析
- ◎ 衍生性商品風險管理實務

二、證券暨期貨交易策略實務課程模組

- ◎ Taifex新商品交易策略
(含匯率類、國外指數類及商品類期貨)
- ◎ 期貨基金與避險基金交易策略
- ◎ VIX期貨及VIX期貨ETF交易策略
- ◎ 選擇權多重策略建構實務
- ◎ 跨商品跨市場期貨部位建構實務

三、大數據演算法進階實務課程模組

- ◎ 大數據R語言基礎 (一)
- ◎ 大數據R語言基礎 (二)
- ◎ 大數據-市場分析 (一)
- ◎ 大數據-市場分析 (二)
- ◎ 大數據-資產配置 (一)
- ◎ 大數據-資產配置 (二)
- ◎ 大數據-資金控管及風險管理 (一)
- ◎ 大數據-資金控管及風險管理 (二)

四、結業式：模擬交易競賽績優前三名分享及簡報

註：若突發狀況影響課程進行，本基金會將保留調整課程時間與內容之權利。

模擬交易競賽

課程結合模擬交易競賽，強化學習效果。

參加對象：

本課程學員 (如學員中途因故退訓，該名學員即退出競賽)。

競賽期間：108年8月1日至8月30日。

資產管理：

原始投資金額為新臺幣一千萬元。

可投資標的：

- (1) 上市(櫃)之股票、ETF、權證及臺灣存託憑證(TDR)。
- (2) 期貨及選擇權。

競賽結果：

依「總報酬率」高低序排名，若有總報酬率相同之情形，則再依照「獲利天數」排名，獲利天數較多者為優勝；若獲利天數仍相同則以並列同名次處理，總交易筆數小於10筆者取消獲獎資格。

獎勵：

績優前三名於結訓典禮頒獎並搭配簡報分享競賽心得。

第一名：獎狀及獎金5,000元；第二名：獎狀及獎金3,000元；第三名：獎狀及獎金2,000元。



證券期貨機構法人實務操作進階研習課程報名表

公司／機構名稱			
發票地址：		統一編號：	
聯絡人姓名：		部門：	
電話：		E-mail:	
參加人姓名	服務部門及職稱	連絡電話(分機)	E-mail

服務專線：證基會人才培訓中心/李小姐 (02)2393-1888 分機 120

報名方式：1. 網路報名www.sfi.org.tw 2. 傳真報名：(02)2392-7491 (請來電確認)