

109 年「證券期貨機構法人實務操作」進階研習課程

成果回顧

為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人員，提供金融從業人員多元進修之管道，在期貨產業發展基金支持下，證基會辦理「證券期貨機構法人實務操作進階研習課程」，課程內容分為「實務課程」及「模擬交易競賽」，是一長期且貼近實務之培訓課程，有助法人機構參與期貨市場。

實務課程

課程內容分涵蓋風險管理、交易策略(含程式交易) 內容涵蓋風險管理、交易策略(含程式交易)、機器學習演算法，結合風險控管相關實務觀念及應用，並規劃模擬交易競賽，強化學習深度與廣度，共計 18 堂課，每堂課 3 小時，合計 54 小時，於 109 年 7 月 14 日起至 9 月 10 日於每週二、四下午上課，學員 41 名分別來自證券、期貨、投信、投顧、銀行、郵政、主管機關與周邊單位等機構從業人員共同參與。

一、證券暨市場暨交易策略實務模組：(18 小時，6 堂)
<ul style="list-style-type: none">■國內外股價指數、股票期貨及選擇權市場解析■選擇權多重策略建構實務■VIX 期貨與 ETF 交易策略■期貨基金與避險基金交易策略■跨商品跨市場期貨部位建構實務■衍生性商品風險管理實務
二、量化交易策略與機器學習演算法實務模組：(36 小時，12 堂)
<ul style="list-style-type: none">■Python 開發工具的安裝與基本使用■數值運算與 Numpy 套件的使用■資料庫套件 Pandas 與繪圖套件 Matplotlib 的使用■市場資料與資訊套件 TuShare 的使用■MySQL 資料庫的安裝與使用■古典交易策略開發與回溯測試的執行■時間數列預測基礎■主成分分析與時間數列預測方法■ARIMA 與 GARCH 的合併預測使用■機器學習模型(一)羅吉斯迴歸與鑑別分析■機器學習模型(二)支持向量機與決策樹■機器學習模型(三)配對交易策略的應用
●結業式 模擬交易競賽績優前三名心得分享及簡報

模擬交易競賽

除專業課程外，課程期間於8月1日至8月31日舉行模擬交易競賽，學員將課程內容實際運用，強化學習效果並增進學員間交流，由學員3~5位組隊參賽，共計10隊參賽，依總報酬率排序，績優前三名於9月10日結業式頒發獎狀及獎金，並簡報分享競賽心得，得獎名單如下：

獎項	得獎人	獎勵
第一名	陳○儀-元富證券 徐○舜-元富證券 古○晏-元富證券	獎狀及獎金 新臺幣 6,000 元
第二名	康○鈺-華南永昌證券 許○綸-華南永昌證券 張○爵-華南永昌證券	獎狀及獎金 新臺幣 5,000 元
第三名	林○良-凱基證券 林○辰-凱基證券 陳○浚-日盛期貨	獎狀及獎金 新臺幣 4,000 元

結語

透過本課程對於期貨市場發展趨勢、量化交易策略與機器學習演算法之研討，相信有助於金融機構從業人員深入瞭解期貨市場實務操作，未來證基會將持續規劃各項專題課程，以提供從業人員業務發展之所需。

精采課程剪影



廖恩平 經理
講授「國內外股價指數、股票期貨及選擇權市場解析」



林豪威 協理
講授「跨商品跨市場期貨部位建構實務」

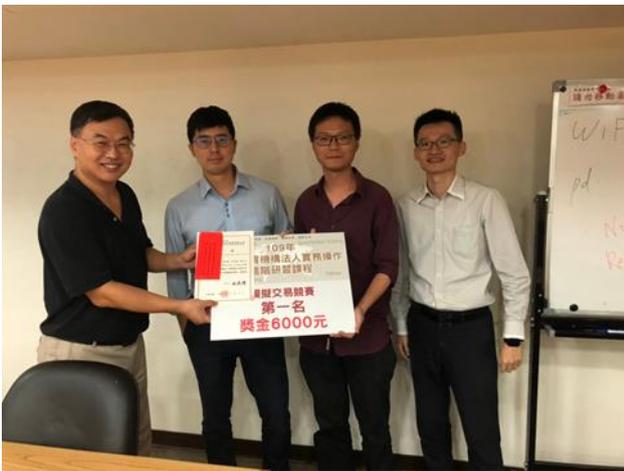


楊邦珩 經理
講授「VIX 期貨與 ETF 交易策略」



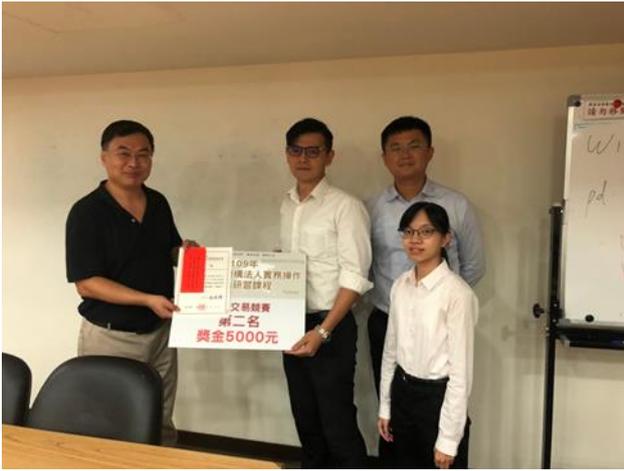
董夢雲技術長
講授量化交易策略與機器學習算法實務模組課程，並為模擬交易競賽頒獎與期勉學員。

模擬交易競賽頒獎



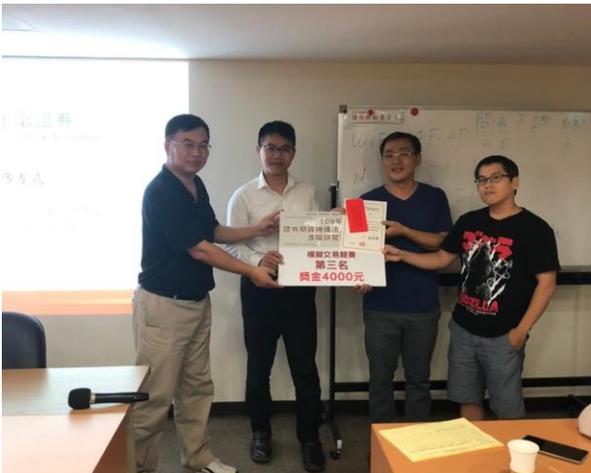
模擬交易競賽第一名：
陳○儀-元富證券、徐○舜-元富證券、古○晏-元富證券，獲頒獎金6仟元及獎狀，並簡報分享比賽心得。





模擬交易競賽第二名：

康○鈺-華南永昌證券、許○綸-華南永昌證券、張○爵-華南永昌證券，獲頒獎金5仟元及獎狀，並簡報分享比賽心得。



模擬交易競賽第三名：

林○良-凱基證券、林○辰-凱基證券、陳○泓-日盛期貨，獲頒獎金4仟元及獎狀，並簡報分享比賽心得。