

朝陽科技大學
110學年度第2學期教學大綱

當期課號	1087	中文科名	程式交易實務
授課教師	林俊良	開課單位	財務金融系
學分數	2	修課時數	2
		開課班級	日間部四年制3年級 A班
修習別	專業選修		
類別	一般課程		

本課程培養學生下列知識：

程式交易實務是一門討論金融商品市場的程式交易課程，主旨在於探討金融商品市場的程式交易理論，程市交易實務以及相關的交易策略的發展與實作。本課程之課程目標在於，讓學生理解程式交易的理論以及程式交易的相關實務操作。在此基礎之下，讓學生進一步的學習，程式交易領域中慣用的交易策略理論與相關的操作實務。另外，還讓學生認識相關的程式交易平台與進行相關的程式交易實作。

- 1.認識程式交易理論
- 2.認識程式交易實務
- 3.認識交易策略理論
- 4.認識交易策略實務
- 5.認識程式交易平台
- 6.程式交易實作

This lecture introduces the basic concept of the program trading in the financial instruments market. The basic targets are the theory of the program trading, the practices of the program trading, and the developments of the related trading strategies. The course will deliver the basic concepts of the program trading theory and practices.

Furthermore, it provides the usual trading strategies in the program trading field and related practical operation. This course also conveys the understanding of program trading platform and the coding practice for program trading.

每週授課主題

- 第01週：VIX恐慌指標編制介紹
- 第02週：投資組合理論與應用
- 第03週：多頭與空頭應用差異性
- 第04週：Python簡易語法介紹
- 第05週：股市走勢與VIX關係
- 第06週：資本資產定價模型
- 第07週：VIX抓台股轉折程式撰寫
- 第08週：Fama-French三因子模型
- 第09週：期中考
- 第10週：時間數列1
- 第11週：VIX交易策略程式撰寫
- 第12週：時間數列2
- 第13週：Black-Scholes Model介紹
- 第14週：動量交易策略
- 第15週：隱含波動度程式撰寫
- 第16週：動量交易策略
- 第17週：隱含波動度交易策略撰寫
- 第18週：期末考

成績及評量方式

- 期中考：30%
- 期末考：30%
- 出席與作業：40%

證照、國家考試及競賽關係

本課程無證照、國家考試及競賽資料。

主要教材

- 1.Python與量化投資蔡立崙博碩978-986-434-270-92018/7初版5刷(教科書)

參考資料

本課程無參考資料!

建議先修課程

本課程無建議先修課程

教師資料

教師網頁：<http://www.cyut.edu.tw/~rlee/>

E-Mail：rlee@cyut.edu.tw

Office Hour：

星期一,第5~6節,地點:T2-705;

星期四,第3~4節,地點:T2-705;

分機:

[\[關閉\]](#) [\[列印\]](#)

尊重智慧財產權，請勿不法影印。