

朝陽科技大學
111學年度第2學期教學大綱

當期課號	1090	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，程式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：課程介紹
- 第02週：VIX指數緣由
- 第03週：臺灣VIX指數、臺灣加權指數與期貨長短期關係
- 第04週：臺灣期交所VIX恐慌指標編制介紹
- 第05週：用EXCEL說明實際編制臺灣VIX指數
- 第06週：多頭與空頭應用差異性與空頭跌幅預測方法
- 第07週：CBOE恐慌指數家族與VIX期貨介紹
- 第08週：CBOE恐慌指數家族與VIX期貨介紹
- 第09週：期中考
- 第10週：VIX文獻回顧與交易策略擬定
- 第11週：幾個國家VIX指數差異比較
- 第12週：VIX指數與臺灣加權指數關係Python程式撰寫介紹
- 第13週：VIX指數與股市關係
- 第14週：VIX指數搭配技術指標
- 第15週：波動叢聚效果與波動不對稱效果
- 第16週：波動叢聚效果與波動不對稱效果
- 第17週：VIX交易策略實證結果
- 第18週：期末考周

成績及評量方式

期中報告：30%
期末報告：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.(自製教材)

參考資料

書名：Python與量化投資 作者：蔡立崙 出版年(西元)：2018 出版社：博碩

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3~4節,地點:T2-705;

星期三,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。