

# 證券金融實務研討

本課程結合「產學合作」的脈絡，以金融知識應用於實務，主題包括了交易平台建置，交易策略發展，與風險管理等相關具前瞻性的議題。實務課程主要由8~10位業師進行教學。

課程要求：除平時作業外，須以小組為單位，挑選一到兩位授課業師作為導師（mentor），撰寫期中與期末報告。

**上課時間：T3, T4, Tn**

**地點：台積223**

## Syllabus

主題：波動率估計及應用

Keywords:

1. 歷史波動率、隱含波動率、VIX
2. 參數（parametric）與無參數（nonparametric）估計法
3. 配對交易（pairs trading）與選擇權避險策略

主題：外匯避險操作

Keywords:

1. 外匯市場
2. 外匯避險工具、Swap、Forward、Swap Point
3. 外匯避險部位管理

主題：How to grow your account as retail traders

Keywords:

1. 3 types of trading strategies for retail traders
2. Directional v.s Spread trading
3. Use VIX as an indicator to sell spread
4. Trader's psychology

主題：可轉債的評價與交易策略

Keywords:

1. 歷史波動率、隱含波動率
2. 可轉債評價、交易策略
3. 信用風險

主題：權證交易與避險

權證與交易制度簡介

權證介紹：認購、認售、牛、熊權證

買進權證時機：進場設定、出場設定、試盤、套利、避險

券商操作策略

交易對手風險

主題一：選擇權定價模型與交易策略

Keywords:

1. Black-Scholes、Binominal、B.A.W Model
2. 波動率,Delta、Gamma、Theta、Vega、Rho
3. 選擇權交易策略

主題二：權證、牛熊證產品設計與定價模型

Keywords:

1. 產品設計:標的物、c/p、歐式/美式、重設/界限、履約價、行使比例、天數、發行量
2. 隱含波動率、Delta、Gamma、獲利與避險

主題：簡介金融業風險管理實務

主題：計量交易系統的建構

Keywords:

1. Back test
2. Quantitative analysis

### 3. Evaluation and optimization

主題一：程式交易方法與應用

Keywords:

1. 程式交易方法
2. 程式交易應用案例
3. 程式交易塑造交易風格

主題二：證券業財富管理與優勢

Keywords:

1. 財富管理的架構
2. 財富管理的困境
3. 證券業從事財富管理的優勢

主題：期貨選擇權高頻交易實務

Keywords:

- |        |        |
|--------|--------|
| 1.基本知識 | 2.交易策略 |
| 3.交易流程 | 4.交易實務 |