

期貨計量系統性交易技術概論 課程大綱

目的

本課程與元大寶來期貨自營部合作教學，運用計量方法所形成的系統性交易技術，著重在策略商品的開發。針對已具有撰寫程式能力背景的學生，進行為期 1 個月的密集課程訓練，以利從中培養出優質的交易策略，以及具有潛力的程式交易人才。本課程鼓勵使用高等數量方法以形成跨國市場的交易技術。表現優異的同學，將獲得由賀氏基金會所提供之計量財務金融獎學金，以達到產學結合的理念。

班別名稱：期貨計量系統性交易技術概論

(Introduction to Quantitative System for Futures Trading Technology)

授課學分數：2 學分

授課教師：韓傳祥 教授。(負責規劃、協調上課事宜)

開課年級：科管院學士班四年級 (修課要求：研究生或大學部高年級，具有良好撰寫程式能力或熟捻計(數)量方法等背景的同學)

課程大綱及內容

期貨計量系統性交易技術概論 (2~3 月份)

目標：密集舉辦課程集訓，擬舉辦共計 18 堂課、54 小時/班。

課程大綱：

3 小時課程/堂課，共計 18 堂課 54 小時

- 利用深入說明程式交易的優勢與 M.C 使用方式及功能，帶領學生進入程式交易領域
- 以實機演練介紹 MultiCharts 介面及使用、指標匯入及內建指標閱讀、策略匯入及報表檢視、最佳化過程及應用。
- 透過計量方法的實用與多元類型策略撰寫示範，帶給學員多種類型的交易策略模組，加上互動式的交流，增進策略的可使用性及擴充性。
- 參訪元大寶來期貨全球交易部門。

課程內容：

1. 程式交易發展及 MultiCharts 介紹
2. MultiCharts 介面操作及程式撰寫流程示範
3. 內建函式、指標及重要保留字介紹
4. 交易策略示範及撰寫步驟
5. 進出場時點的選擇
6. 停損停利機制

7. 濾網設定
8. 當沖範例及期中測驗
9. 多時間序列應用
10. 多商品應用
11. 常用程式技巧(1)
12. 常用程式技巧(2)
13. 進階策略應用
14. 學員作品交流及討論(1)
15. 學員作品交流及討論(2)
16. 程式驗收

舉辦時間與場地

新竹(清華大學科技管理學院 上網閱讀室(電腦教室))(1班/18堂課)

地點	二月、三月
新竹	2/23(六), 2/24(日) 早上 09:00~12:00 下午 13:00~16:00
	3/2(六), 3/3(日) 早上 09:00~12:00 下午 13:00~16:00
	3/16(六), 3/17(日) 早上 09:00~12:00 下午 13:00~16:00
	3/23(六), 3/24(日) 早上 09:00~12:00 下午 13:00~16:00

另有兩週分別作為課程宣達和計量財務金融獎學金的申請方式說明, 以及參訪元大寶來期貨全球交易部門。