



## 股票指數期貨投資原理與應用課程 The Principles and Applications of Index Futures

### 課程目的 Course Objective

作為股票對沖或其衍生的投資工具，股票指數期貨在金融市場上的地位可謂舉足輕重，而其交易數量與規模亦在近年與日俱增，在國際金融市場中早已成為一項重要的衍生工具與對沖形式之一。本課程旨在以循序漸進的教學手法，以當前港股市場上流行的指數期貨作例子，詳細說明指數期貨的結構原理、對沖作用與實務操作等等，務求全面提升本澳金融從業員的風險管理能力與國際投資視野。

### 課程對象 Target Participants

本課程適合各銀行從業員、保險從業員、證券經紀及基金銷售人員修讀。

### 導師 Instructor

陳臻臻先生 Rafe Chan

認可財務策劃師 CFP<sup>CM</sup>，金融碩士 MSF，澳門財經專業進修中心總監。

陳先生曾於多間金融機構任職投資顧問。大學時期主修國際金融專業，持有金融碩士學位及認可財務策劃師專業資格。陳先生採用理論與實踐並重之教學方針，多年來為多間教育機構、金融機構以及政府機構設計及擔任財經方面培訓活動的主講嘉賓。

### 課程證書 Course Certificate / 持續專業培訓時數 CPD hours

出席率達 100% 的學員方可獲頒授課程證書及獲得持續專業培訓時數。學員若遲到或缺席超過 15 分鐘，將不獲頒授課程證書及不能獲得持續專業培訓時數。學員請務必於每節課準時到達，並緊記於每一節課上課前及完結後在出席記錄表上簽名。

### 其他課程資料 Other Course Info.

語言 Language	粵語授課，中文講義
查詢 Enquiry	請電溫先生 8297 2612，或李先生 8297 2626，或譚先生 8297 2610
上課地點 Venue	澳門士多烏拜斯大馬路 1-B 號東曦閣大廈地下澳門金融學會



## 課程內容 Course Contents :

### 單元一：（3小時）

- 期貨的基礎概念
- 指數期貨的結構與運作原理
- 指數期貨的風險需知
- 瞭解指數期貨的保證金制度
- 如何閱讀指數期貨的報價
- 認識恒生指數期貨的相應實務交易知識
- 認識國企指數期貨的相應實務交易知識
- 何謂大型指數期貨與小型指數期貨

### 單元二：（3小時）

- 瞭解指數期貨的結算機制
- 認識指數期貨與現貨的高低水現象
- 日市期貨與夜市期貨的交易比較
- 何謂期指結算日與期指結算價
- 指數期貨在不同期限上的選擇
- 何謂期貨的未平倉合約
- 如何網上查閱指數期貨的報價及相關資訊
- 指數期貨在股票組合風險管理(對沖)上的實務應用