

大学课程  
优化可变收益投  
资组合的衍生品



## 大学课程 优化可变收益投 资组合的衍生品

- » 模式:在线
- » 时长: 6周
- » 学位: TECH 科技大学
- » 课程表:自由安排时间
- » 考试模式:在线
- » 目标对象: 大学毕业生和曾在金融经济学、会计学、商业或社会与法律科学领域获得过任何学位的毕业生

网页链接: [www.techtitute.com/cn/school-of-business/postgraduate-certificate/equity-portfolio-optimization-derivatives](http://www.techtitute.com/cn/school-of-business/postgraduate-certificate/equity-portfolio-optimization-derivatives)

# 目录

01 欢迎	02 为什么在TECH学习?	03 为什么选择我们的课程?	04 目标
4	6	10	14
	05 结构和内容	06 方法	07 我们学生的特质
	18	24	32
	08 课程管理	09 对你事业的影响	10 对你公司的好处
	36	40	44
			11 学位
			48

# 01 欢迎

技术的发展使得利用大量数据生成统计机器学习模型来解决金融商品层面的各种问题成为可能。因此, 这些资产选择过程现在被称为 Smart Beta , 与主动管理相比, 它能以更低的成本产生更高的回报。因此, 这个学术课程将为专业人士提供独家的一流内容, 围绕不同期限的买入和卖出期权组合所提供的可能性开发专业技能, 以提高投资组合的绩效。所有这一切, 都将通过 100% 的在线教学方法和教学材料, 在教育层面上提供最有效、最活跃的学术体验。



优化可变收益投资组合的衍生品大学课程  
TECH 科技大学



“

这个学术课程在短短 6 周内为你提供有关风险收益优化的独家内容”

02

# 为什么在TECH学习?

TECH是世界上最大的100%在线商业学校。它是一所精英商学院，具有最大的学术需求模式。一个国际高绩效和管理技能强化培训的中心。



“

TECH是一所站在技术前沿的大学, 它将所有资源交给学生支配, 以帮助他们取得商业成功”

## TECH科技大学



### 创新

该大学提供一种在线学习模式,将最新的教育科技与最大的教学严谨性相结合。一种具有最高国际认可度的独特方法,将为学生提供在不断变化的世界中发展的钥匙,在这个世界上,创新必须是所有企业家的基本承诺。

“由于在节目中加入了创新的互动式多视频系统,被评为“微软欧洲成功案例”。



### 最高要求

TECH的录取标准不是经济方面的。在这所大学学习没有必要进行大量投资。然而,为了从TECH毕业,学生的智力和能力的极限将受到考验。该机构的学术标准非常高。

**95%** | TECH学院的学生成功完成学业



### 联网

来自世界各地的专业人员参加TECH,因此,学生将能够建立一个庞大的联系网络,对他们的未来很有帮助。

**+100,000**

每年培训的管理人员

**+200**

不同国籍的人



### 赋权

学生将与最好的公司和具有巨大声望和影响力的专业人士携手成长。TECH已经与7大洲的主要经济参与者建立了战略联盟和宝贵的联系网络。

**+500**

| 与最佳公司的合作协议



### 人才

该计划是一个独特的建议,旨在发挥学生在商业领域的才能。这是一个机会,你可以利用它来表达你的关切和商业愿景。

TECH帮助学生在这个课程结束后向世界展示他们的才华。



### 多文化背景

通过在TECH学习,学生将享受到独特的体验。你将在一个多文化背景下学习。在一个具有全球视野的项目中,由于该项目,你将能够了解世界不同地区的工作方式,收集最适合你的商业理念的创新信息。

TECH的学生来自200多个国家。

TECH追求卓越,为此,有一系列的特点,使其成为一所独特的大学:



### 分析报告

TECH探索学生批判性的一面,他们质疑事物的能力,他们解决问题的能力和他们的人际交往能力。



### 优秀的学术成果

TECH为学生提供最好的在线学习方法。大学将再学习方法(国际公认的研究生学习方法)与哈佛大学商学院的案例研究相结合。传统和前卫在一个艰难的平衡中,在最苛刻的学术行程中。



### 规模经济

TECH是世界上最大的网上大学。它拥有超过10,000个大学研究生课程的组合。而在新经济中,数量+技术=颠覆性价格。这确保了学习费用不像在其他大学那样昂贵。



### 向最好的人学习

TECH教学团队在课堂上解释了导致他们在其公司取得成功的原因,在一个真实、活泼和动态的环境中工作。全力以赴提供优质专业的教师,使学生在事业上有所发展,在商业世界中脱颖而出。

来自20个不同国籍的教师。



在TECH,你将有机会接触到学术界最严格和最新的案例研究"

03

# 为什么选择我们的课程？

完成科技课程意味着在高级商业管理领域取得职业成功的可能性倍增。

这是一个需要努力和奉献的挑战，但它为我们打开了通往美好未来的大门。学生将从最好的教学团队和最灵活、最创新的教育方法中学习。





“

我们拥有最著名的教师队伍和市场上最完整的教学大纲,这使我们能够为您提供最高学术水平的培训”

该方案将提供众多的就业和个人利益,包括以下内容。

01

### 对学生的职业生涯给予明确的推动

通过在TECH学习,学生将能够掌握自己的未来,并充分开发自己的潜力。完成该课程后,你将获得必要的技能,在短期内对你的职业生涯作出积极的改变。

本专业70%的学员在不到2年的时间内实现了职业的积极转变。

02

### 制定公司的战略和全球愿景

TECH提供了一般管理的深刻视野,以了解每个决定如何影响公司的不同职能领域。

我们对公司的全球视野将提高你的战略眼光。

03

### 巩固高级商业管理的学生

在TECH学习,为学生打开了一扇通往非常重要的专业全景的大门,使他们能够将自己定位为高级管理人员,对国际环境有一个广阔的视野。

你将在100多个高层管理的真实案例中工作。

04

### 承担新的责任

在该课程中,将介绍最新的趋势、进展和战略,以便学生能够在不断变化的环境中开展专业工作。

45%的参训人员在内部得到晋升。

05

### 进入一个强大的联系网络

TECH将其学生联系起来,以最大限度地增加机会。有同样关注和渴望成长的学生。你将能够分享合作伙伴、客户或供应商。

你会发现一个对你的职业发展至关重要的联系网络。

06

### 以严格的方式开发公司项目

学生将获得深刻的战略眼光,这将有助于他们在考虑到公司不同领域的情况下开发自己的项目。

我们20%的学生发展自己的商业理念。

07

### 提高软技能和管理技能

TECH帮助学生应用和发展他们所获得的知识,并提高他们的人际交往能力,使他们成为有所作为的领导者。

提高你的沟通和领导能力,为你的职业注入活力。

08

### 成为一个独特社区的一部分

学生将成为由精英经理人、大公司、著名机构和来自世界上最著名大学的合格教授组成的社区的一部分:TECH科技大学社区。

我们给你机会与国际知名的教授团队一起进行专业学习。

# 04 目标

这个大学课程将为专业人士提供最重要的创新知识,使他们能够轻松地在盈亏环境中管理交易领域的战略。通过这种方式,TECH 将为学生提供有关被动 保护性投入战略的风险和优势的视听资源和技术技能。因此,在这个大学课程结束时,毕业生只需参加 150 个小时的在线培训,就能提高与每种积极策略的风险收益相关的能力。



“

TECH 一切以你为中心:为你的  
职业生涯注入新的动力, 专攻投  
资组合优化领域。现在报名吧!”

TECH 会把学生的目标作为自己的，  
并与学生一同致力达成。

优化可变收益投资组合的衍生品大学课程 将培训学生：

01

分析金融衍生品市场, 从最初的远期交易发展到今天, 每天都有数以百万计的交易发生, 涉及大量等值资本

02

深入研究股票投资的原则, 特别强调收益和风险这两个关键要素

03

深化国际市场交易平台和衍生合约的特点

04

确定并比较这些期望值的管理情况与综合期权数字

05

区分利用看涨和看跌波动预期的策略的内在风险



06

研究不同期限的买入期权和卖出期权之间的日历组合所提供的可能性

08

研究不同期限的买入期权和卖出期权组合的可能性,以提高投资组合的绩效

09

详细介绍最常见的奇异期权的特殊性

07

分析和比较各种可能的方案组合,逐步提高投资组合的绩效

10

比较每种特殊选择的表现,以提高股票投资的风险收益比



# 05

## 结构和内容

优化可变收益投资组合的衍生品大学课程学位主要侧重于与优化股票投资组合管理相关的具体技能。因此, 这个学术课程强调理论与实践相结合的结构, 并由一支高度专业化的教学团队提供扎实的和丰富的经验。



“

专业开发的课程和高质量的内容  
是成功学习优化投资组合的关键”

## 教学大纲

这个学术课程包括 6 周的强化学习, TECH 将通过注重卓越和效率的教育, 引导毕业生走向职业生涯的巅峰。因此, 学生将能够获得金融领域最理想的职位, 应对工作中遇到的多重挑战。在这方面, 这个资格证书为部分被动策略与利差的风险收益权衡提供了丰富的专业知识。

该学院设计了一个教学大纲, 其中包含一个模块, 目的是让毕业生通过使用组合来拓宽其在优化股票投资组合战略方面的能力。

另一方面, 这个大学课程的学生将学习到一些细节领域, 如利用日历组合进行主动股票投资组合管理。因此, 专业人士将能对被动保护性认沽策略的风险和收益获得独特的见解。

此外, TECH 始终追求卓越, 因此该课程提供完整、高质量的教育, 同时在学习方式上具有灵活性。毕业生只需一台能连接互联网的设备, 就能全天 24 小时从世界任何地方轻松访问虚拟平台。

这个大学课程为期 6 个星期, 分为 1 个内容模块:

### 模块1

优化可变收益投资组合的衍生品



### 何时,何地,如何授课?

TECH 提供完全在线学习优化可变收益投资组合的衍生品大学课程的可能性。在培训持续的6个星期天中,学生可以将能够访问这个课程的所有内容,这将使你能够自我管理你的学习时间。

这将是一个独特而关键的教育旅程,将成为你专业发展的决定性一步,助你实现明显的飞跃。

模块 1. 优化可变收益投资组合的衍生品

1.1. 股票投资组合的优化管理

- 1.1.1. 优化风险收益比
- 1.1.2. 最大限度地减少潜在损失。资金管理
- 1.1.3. 在盈亏环境中轻松管理战略

1.2. 系统性备兑策略

- 1.2.1. 被动备兑策略的风险与收益
- 1.2.2. 主动 受保电话 管理 (I): 确定何时该做什么时不该做
- 1.2.3. 主动 备付金 管理 (II): 进一步确定在任何特定时间启动的头寸数量

1.3. 系统的保护性投入战略

- 1.3.1. 保护性投入被动策略的风险和收益
- 1.3.2. 积极的 保护性投入 管理 (I): 确定何时投入何时不投入
- 1.3.3. 主动 保护性投入 管理 (II): 进一步确定在任何特定时间启动的位置数量

1.4. 备兑看涨期权 和 保护性看跌期权策略的比较

- 1.4.1. 每种被动策略的风险收益比
- 1.4.2. 每种主动策略的风险收益比
- 1.4.3. 管理每种策略的最大潜在损失

1.5. 利用价差优化股票投资组合策略

- 1.5.1. 有价差的部分被动策略的风险收益比
- 1.5.2. 减少最大潜在损失
- 1.5.3. 利用 利差进行积极的股票投资组合管理

1.6. 利用长期到期比率优化股票投资组合策略

- 1.6.1. 有比率的部分被动策略的风险收益权衡
- 1.6.2. 减少最大潜在损失
- 1.6.3. 利用比率进行积极的股票投资组合管理

1.7. 利用组合优化股票投资组合策略

- 1.7.1. 有价差的部分被动策略的风险收益比
- 1.7.2. 减少最大潜在损失
- 1.7.3. 利用 利差进行积极的股票投资组合管理

1.8. 利用日历价差优化股票投资组合策略

- 1.8.1. 采用日历价差的部分被动策略的风险收益比
- 1.8.2. 减少最大潜在损失
- 1.8.3. 利用日历价差进行主动股票投资组合管理

1.9. 利用日历比率优化股票投资组合策略

- 1.9.1. 采用日历比率的部分被动策略的风险收益比
- 1.9.2. 减少最大潜在损失
- 1.9.3. 利用日历比率进行主动股票投资组合管理

1.10. 利用日历组合优化股票投资组合策略

- 1.10.1. 采用日历组合的部分被动策略的风险收益比
- 1.10.2. 减少最大潜在损失
- 1.10.3. 利用日历组合进行主动股票投资组合管理



“

这个大学课程从理论和实践的角度,为你提供覆盖性看涨和保护性看跌策略的比较”

# 06 方法

这个培训计划提供了一种不同的学习方式。我们的方法是通过循环的学习模式发展起来的: **Re-learning**。

这个教学系统被世界上一些最著名的医学院所采用,并被**新英格兰医学杂志**等权威出版物认为是最有效的教学系统之一。





“

发现 Re-learning, 这个系统放弃了传统的线性学习, 带你体验循环教学系统: 这种学习方式已经证明了其巨大的有效性, 尤其是在需要记忆的科目中”

## TECH商学院使用案例研究来确定所有内容的背景

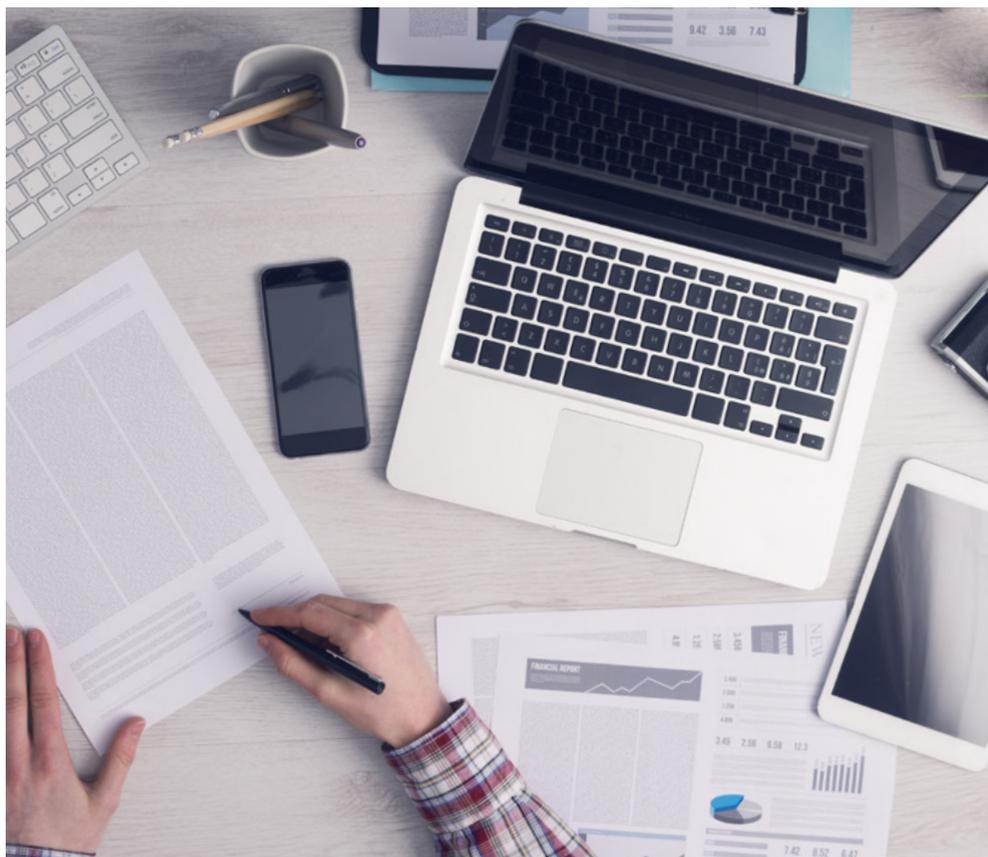
我们的方案提供了一种革命性的技能和知识发展方法。我们的目标是在一个不断变化, 竞争激烈和高要求的环境中加强能力建设。

“

和TECH,你可以体验到一种正在动摇  
世界各地传统大学基础的学习方式”



该课程使你准备好在不确定的环境中  
面对商业挑战, 使你的企业获得成功。



我们的课程使你准备好在不确定的环境中面对新的挑战,并取得事业上的成功。

## 一种创新并不同的学习方法

该技术课程是一个密集的培训课程,从头开始创建,为国内和国际最高水平的管理人员提供挑战和商业决策。由于这种方法,个人和职业成长得到了促进,向成功迈出了决定性的一步。案例法是构成这一内容的基础的技术,确保遵循最新的经济,社会和商业现实。

“

你将通过合作活动和真实案例,学习如何解决真实商业环境中的复杂情况”

在世界顶级商学院存在的时间里,案例法一直是最广泛使用的学习系统。1912年开发的案例法是为了让法律学生不仅在理论内容的基础上学习法律,案例法向他们展示真实的复杂情况,让他们就如何解决这些问题作出明智的决定和价值判断。1924年,它被确立为哈佛大学的一种标准教学方法。

在特定情况下,专业人士应该怎么做?这就是我们在案例法中面临的问题,这是一种以行动为导向的学习方法。在整个课程中,学生将面对多个真实案例。他们必须整合所有的知识,研究,论证和捍卫他们的想法和决定。

## Re-learning 方法

TECH有效地将案例研究方法与基于循环的100%在线学习系统相结合, 在每节课中结合了个不同的教学元素。

我们用最好的100%在线教学方法加强案例研究: Re-learning。

我们的在线系统将允许你组织你的时间和学习节奏, 使其适应你的时间表。你将能够从任何有互联网连接的固定或移动设备上获取容。



在TECH, 你将用一种旨在培训未来管理人员的尖端方法进行学习。这种处于世界教育学前沿的方法被称为 Re-learning。

我们的商学院是唯一获准采用这种成功方法的西班牙语学校。2019年, 我们成功地提高了学生的整体满意度 (教学质量, 材料质量, 课程结构, 目标.....), 与西班牙语最佳在线大学的指标相匹配。

在我们的方案中,学习不是一个线性的过程,而是以螺旋式的方式发生(学习,解除学习,忘记和重新学习)。因此,我们将这些元素中的每一个都结合起来。这种方法已经培养了超过65万名大学毕业生,在生物化学,遗传学,外科,国际法,管理技能,体育科学,哲学,法律,工程,新闻,历史,金融市场和工具等不同领域取得了前所未有的成功。所有这些都是在一个高要求的环境中进行的,大学学生的社会经济状况很好,平均年龄为43.5岁。

Re-learning 将使你的学习事半功倍,表现更出色,使你更多地参与到训练中,培养批判精神,捍卫论点和对比意见:直接等同于成功。

从神经科学领域的最新科学证据来看,我们不仅知道如何组织信息,想法,图像y记忆,而且知道我们学到东西的地方和背景,这是我们记住它并将其储存在海马体的根本原因,并能将其保留在长期记忆中。

通过这种方式,在所谓的神经认知背景依赖的电子学习中,我们课程的不同元素与学员发展其专业实践的背景相联系。



该方案提供了最好的教育材料,为专业人士做了充分准备:



### 学习材料

所有的教学内容都是由教授该课程的专家专门为该课程创作的,因此,教学的发展是具体的。

然后,这些内容被应用于视听格式,创造了TECH在线工作方法。所有这些,都是用最新的技术,提供最高质量的材料,供学生使用。



### 大师课程

有科学证据表明第三方专家观察的有用性。

向专家学习可以加强知识和记忆,并为未来的困难决策建立信心。



### 管理技能实习

他们将在每个学科领域开展具体的管理能力发展活动。获得和培训高级管理人员在我们所处的全球化框架内所需的技能和能力的做法和新情况。



### 延伸阅读

最近的文章,共识文件和国际准则等。在TECH的虚拟图书馆里,学生可以获得他们完成培训所需的一切。





### 案例研究

他们将完成专门为这个学位选择的最佳案例研究。由国际上最好的高级管理专家介绍,分析和辅导的案例。



### 互动式总结

TECH团队以有吸引力和动态的方式将内容呈现在多媒体中,其中包括音频,视频,图像,图表和概念图,以强化知识。这个用于展示多媒体内容的独特教育系统被微软授予“欧洲成功案例”称号。



### 测试和循环测试

在整个课程中,通过评估和自我评估活动和练习,定期评估和重新评估学习者的知识:通过这种方式,学习者可以看到他/她是如何实现其目标的。



07

# 我们学生的特质

这个大学课程面向社会与法律科学、行政管理 and 经济学领域的大学毕业生、毕业生和已获得以下学位的毕业生。

不同学术背景和来自多个国籍的参与者的多样性构成了这个项目的跨学科取向。

拥有任何专业的大学学位并在金融领域有两年工作经验的专业人员也可参加这个大学课程的学习。





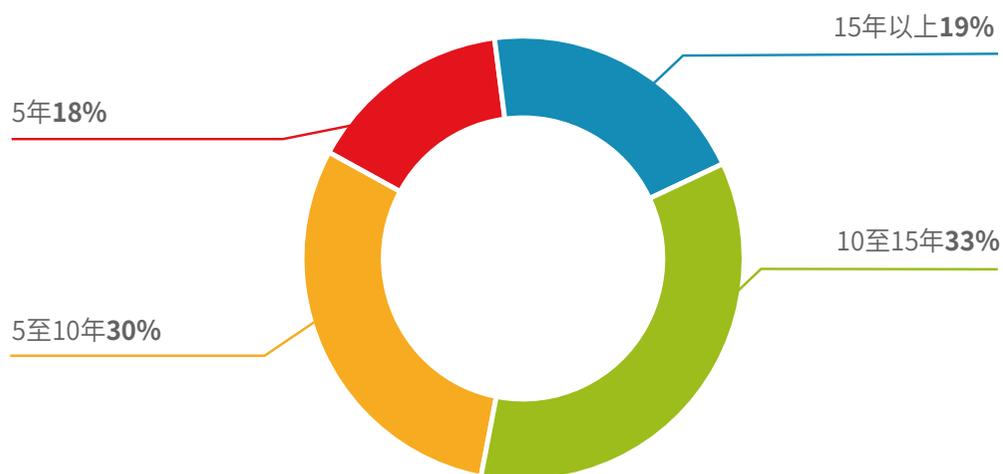
“

如果你拥有优化可变收益投资组合的衍生品的经验,并希望在继续工作的同时获得有趣的职业发展,那么本课程就是你的理想选择”

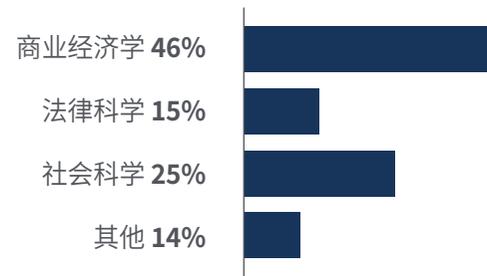
### 平均年龄

**35** 岁至 **45** 岁之间

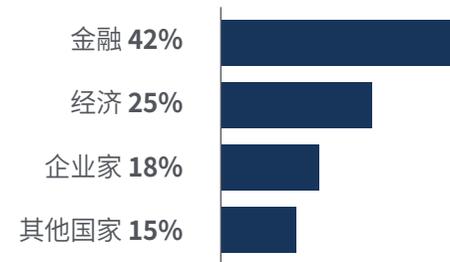
### 经验年限



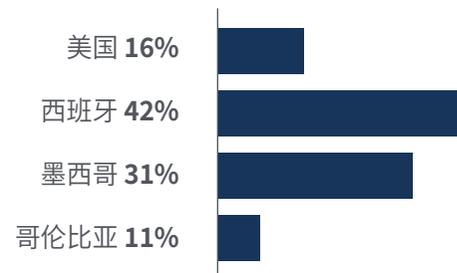
### 培训



### 学术概况



## 地域分布



## Diego Téllez

私人银行经理

"完成这一学术课程是我在职业生涯中迈出的重要一步。它让我能够更有效地分散投资，我在其中加入了衍生工具，从而降低了投资组合的风险"

# 08 课程管理

这个大学课程汇集了来自金融领域的专家,他们在经济学和商业研究、财务咨询和财富管理、会计和金融方面拥有丰富的知识。因此,专业人员将在该研究领域知名专家的支持下获得宝贵的学习成果。通过这种方式,TECH 为毕业生提供了最优质的教育,因为这个大学课程提供了技术工具,确保学生能够应对劳动部门每天提出的各种挑战。





“

通过学习这个大学课程, 你将掌握更多主动股票投资组合管理和利差方面的知识”

## 管理人员



### Sarto Marzal, José Luis 博士

- ◆ 有组织衍生品市场投资组合经理
- ◆ Celulosa Fabril 财务总监
- ◆ 萨拉戈萨大学金融与会计研究生学位讲师
- ◆ 萨拉戈萨大学经济学和工商管理博士, 成绩优异
- ◆ 萨拉戈萨大学经济与商业研究学位, 金融专业

## 教师

### Andreu Sánchez, Laura 博士

- ◆ 会计和财务专家
- ◆ 科学与创新部和阿拉贡政府支持项目的研究员
- ◆ 萨拉戈萨大学硕士、文凭和学位讲师
- ◆ 萨拉戈萨大学会计与金融博士, 成绩优异
- ◆ 萨拉戈萨大学工商管理专业毕业
- ◆ 萨拉戈萨大学金融咨询与财富管理专业文凭

### Gimeno Losilla, Ruth 博士

- ◆ 会计和财务专家
- ◆ 萨拉戈萨大学会计与金融系讲师
- ◆ 研发与创新部、阿拉贡政府和伊比卡哈银行基金会项目研究员
- ◆ 教学创新项目研究员
- ◆ 他拥有萨拉戈萨大学会计与金融博士学位



### Serrano Cored, Miguel 博士

- ◆ 会计和财务专家
- ◆ Majorel SP Solutions 的外派顾问(劳动力管理 - WFM)
- ◆ Majorel SP Solutions 收款代理组长
- ◆ Majorel SP Solutions 的收款代理
- ◆ 伊贝卡亚的行政管理
- ◆ 会计和金融博士
- ◆ 萨拉戈萨大学工商管理学位, 主修金融
- ◆ 商业学文凭
- ◆ 萨拉戈萨大学会计与金融硕士学位

### Ramírez Herrera, Luis Miguel 博士

- ◆ Sevilla地铁管理负责人
- ◆ 本科课程副讲师
- ◆ Sevilla大学金融学博士
- ◆ Sevilla大学工商管理学位。
- ◆ 在期刊上发表过多篇学术论文, 著有电子表格项目财务分析一书。

“

一个独特的、关键且决定性的  
培训经历, 对推动你的职业发展  
和迈向终极目标至关重要”

09

# 对你事业的影响

这个大学课程旨在为学生提供必要的、最独特的能力,使他们能够严谨地面对金融行业的挑战。因此,TECH 主要致力于提供最高质量的教育,并强调每个学位都要精益求精。为此,将确保专业人士在如何管理每种策略的最大潜在损失方面获得著名的学习经验。



“

这个大学课程在贸易领域拥有一支专业的教学团队,并提供高质量的多媒体支持”

## 你准备好迈出这一步了吗？ 卓越的职业提升在等着你

TECH 的优化可变收益投资组合的衍生品大学课程是一门强化课程，旨在帮助学生做好准备，迎接金融领域的挑战和商业决策。主要目的是有利于你的个人和职业成长。帮助你获得成功。

有了这一高度灵活的  
资格证书，你只需要一个  
可以连接互联网的电子设备，  
就可以全天 24 小时访问  
虚拟平台。

这个资格证书将为你提供  
有关最大限度减少潜在  
损失的创新教材。

### 改变的时候到



### 改变的类型



## 工资提高

---

完成这个课程后, 我们学生的工资会增长超过**26.24%**



10

# 对你公司的好处

这个计划通过对高级领导人进行辅导,帮助提升组织人才的能力,充分发挥其潜力。

此外,参加大学选修课也是一个独特的机会,可以利用这个强大的人际关系网络寻找未来的专业合作伙伴、客户或供应商。





“

在数字时代, 管理者必须整合新的流程和战略, 从而带来重大变革和组织发展。只有通过大学的培训和更新才能做到这一点”

培养和留住公司的人才是最好的长期投资。

01

### 人才和智力资本的增长知识资本

该专业人员将为公司带来新的概念、战略和观点,可以为组织带来相关的变化。

---

02

### 留住高潜力的管理人员,避免人才流失

这个计划加强了公司和经理人之间的联系,并为公司内部的职业发展开辟了新的途径。

03

### 培养变革的推动者

你将能够在不确定和危机的时候做出决定,帮助组织克服障碍。

---

04

### 增加国际扩张的可能性

由于这一计划,该公司将与世界经济的主要市场接触。



05

### 开发自己的项目

可以在一个真实的项目上工作, 或在其公司的研发或业务发展领域开发新。

---

06

### 提高竞争力

该课程将使具备接受新挑战的技能, 从而促进组织的发展。

# 11 学位

优化可变收益投资组合的衍生品大学课程除了保证最严格和最新的培训外,还可以获得由TECH科技大学颁发的大学课程学位证书。





“

顺利完成这个课程并获得大学学位, 无需旅行或通过繁琐的程序”

这个**优化可变收益投资组合的衍生品大学课程**包含了市场上最完整和最新的课程。

评估通过后, 学生将通过邮寄收到**TECH科技大学**颁发的相应的**大学课程**学位。

**TECH科技大学**颁发的证书将表达在大学课程获得的资格, 并将满足工作交流, 竞争性考试和专业职业评估委员会的普遍要求。

学位: **优化可变收益投资组合的衍生品大学课程**

模式: **在线**

时长: **6周**





## 大学课程

### 优化可变收益投资组合的衍生品

- » 模式:在线
- » 时长: 6周
- » 学位: TECH 科技大学
- » 课程表:自由安排时间
- » 考试模式:在线

大学课程  
优化可变收益投  
资组合的衍生品