Саркисов, Артур Рачикович Формирование портфеля акций на фондовом рынке с использованием непараметрических методов

ОГЛАВЛЕНИЕ ДИССЕРТАЦИИ

кандидат наук Саркисов, Артур Рачикович

Оглавление

4

Глава 1. Теории построения инвестиционных портфелей и отбора активов

1.1. Основы современной портфельной теории

1.2. Модели формирования инвестиционного портфеля и прогнозирования доходности финансовых активов при помощи макроэкономических факторов

17

1.3. Модели формирования инвестиционного портфеля и прогнозирования доходности финансовых активов при помощи показателей фирмы

1.4. Модели формирования инвестиционного портфеля и прогнозирования доходности финансовых активов при помощи технических индикаторов

1.5. Использование непараметрических методов в финансах

Глава 2. Подбор параметров непараметрических моделей для отбора акций в инвестиционный портфель

2.1. Метод деревьев классификаций

2.2. Метод искусственных нейронных сетей

2.3. Байесовский метод ядерного сглаживания

Глава 3. Формирование инвестиционного портфеля при помощи непараметрических методов

3.1. Алгоритм построения оптимального портфеля

3.2. Обзор переменных, включенных в анализ

3.3. Результаты построения портфелей акций при помощи непараметрических методов

3.4. Построение портфелей при помощи непараметрических методов для инвесторов с различным уровнем несклонности к риску

3.5. Проверка устойчивости результатов на random-walk data 114 Заключение

2

Список использованной литературы

Приложение 1. Таблица откликов, полученная при использовании непараметрических методов

Приложение 2. Полный перечень переменных, использованный для отбора оптимального вектора переменных для каждого метода

Приложение 3. Вектор переменных, использованный для построения портфелей при помощи линейной регрессии

Приложение 4. Значимость факторов динамики индекса ММВБ при тестировании на 2008 году

Приложение 5. Результаты симуляций на рядах случайного блуждания

147