Коржнев Станислав Владимирович Моделирование взаимодействия инвестора и доверительного управляющего на финансовых рынках

ОГЛАВЛЕНИЕ ДИССЕРТАЦИИ

кандидат наук Коржнев Станислав Владимирович

Введение

Глава 1 Особенности поведения экономических агентов на финансовых рынках

1.1 Влияние колебаний цен на финансовых рынках на поведение экономических агентов

1.2 Анализ факторов, влияющих на результаты деятельности управляющих активами

1.3 Формирование структуры модели поведения экономических агентов

1.4 Основные подходы к формализации взаимодействия экономических агентов

1.5 Выводы об особенностях поведения экономических агентов на финансовых рынках

Глава 2 Теоретические аспекты взаимодействия инвестора и доверительного управляющего

2.1 Формализация основных предпосылок и гипотез сигнальной модели взаимодействия инвестора и доверительного управляющего и их обоснование

2.2 Формализация и решение задачи управляющего в рамках разработанной модели

2.3 Анализ свойств решения задачи управляющего для линейных функций

2.4 Формализация и решение задачи управляющего в альтернативной спецификации

2.5 Анализ свойств решения задачи управляющего в альтернативной спецификации

2.6 Выводы из представленной сигнальной модели

Глава 3 Эмпирическая проверка модели взаимодействия инвестора и

доверительного управляющего

3.1 Описание используемых данных

3.2 Методика проведения расчетов

3.3 Проверка гипотез и оценка параметров модели взаимодействия

инвестора и доверительного управляющего

3.4 Расчёт показателей модели

3.5 Практические выводы из представленной сигнальной модели и

рекомендации инвесторам

Заключение

Список литературы

Приложение А Обозначения, используемые в теоретической модели

Приложение Б Данные по доходностям стратегий

Приложение В Данные по комиссиям клиентов

Приложение Г Модель с нелинейными функциями