Проскуряков Иван Михайлович Совершенствование торговых моделей арбитража на рынках долговых инструментов и их деривативов

ОГЛАВЛЕНИЕ ДИССЕРТАЦИИ

кандидат наук Проскуряков Иван Михайлович

ВВЕДЕНИЕ

ГЛАВА 1 ТЕОРЕТИЧЕСКИЕ ОСНОВЫ ПОРТФЕЛЬНОЙ ПОЛИТИКИ И АРБИТРАЖА

1.1 Гипотеза адаптивных рынков как предпосылка арбитража и совершенствования торговых моделей

1.2 Особенности портфельной политики, арбитража как ее элемента и типология арбитражных стратегий

1.3 Классификация рисков арбитражных стратегий

ГЛАВА 2 АНАЛИЗ ПРИМЕНЕНИЯ ТОРГОВЫХ МОДЕЛЕЙ АРБИТРАЖА НА РЫНКАХ ДОЛГОВЫХ ИНСТРУМЕНТОВ И ИХ ДЕРИВАТИВОВ

2.1 Сравнительный анализ фондовых рынков России, Италии и США с точки зрения применимости торговых моделей арбитража

2.2 Особенности современных подходов к статистическому арбитражу

2.3 Анализ моделей кредитного риска и их применения для арбитража

ГЛАВА 3 УСОВЕРШЕНСТВОВАННЫЕ ТОРГОВЫЕ МОДЕЛИ АРБИТРАЖА НА РЫНКАХ ДОЛГОВЫХ ИНСТРУМЕНТОВ И ИХ ДЕРИВАТИВОВ

3.1 Методология и результаты тестирования торговой модели арбитража кривой доходности

3.2 Статистический арбитраж на рынках фьючерсов на государственные облигации: сравнение результативности торговых моделей и рынков

3.3 Реализация предлагаемых торговых моделей при учете влияния факторов ликвидности и стоимости поставочных опционов

ЗАКЛЮЧЕНИЕ

СПИСОК СОКРАЩЕНИЙ И УСЛОВНЫХ ОБОЗНАЧЕНИЙ

СПИСОК ЛИТЕРАТУРЫ

ПРИЛОЖЕНИЕ А Типология арбитражных стратегий

ПРИЛОЖЕНИЕ Б Параметры торговых моделей

ПРИЛОЖЕНИЕ В Показатели эффективности торговых моделей на оптимизационном периоде