**Нечаев, Михаил Леонидович.**

## Хеджирование в среднеквадратическом в стохастических моделях финансовой математики : диссертация ... кандидата физико-математических наук : 01.01.05. - Москва, 1999. - 90 с.

## Оглавление диссертациикандидат физико-математических наук Нечаев, Михаил Леонидович

Содержание

1 Введение

2 Общие проблемы хеджирования на дискретных рынках

2.1 Хеджирование в среднеквадратическом

2.1.1 Постановка задачи оптимального хеджирования

2.1.2 Структура оптимальной стратегии

2.1.3 Примеры и дополнения

2.2 Хеджирование при ограничениях на доступную информацию

2.2.1 Постановка задачи

2.2.2 Структура оптимальной стратегии

2.2.3 Примеры и замечания

3 Хеджирование на рынке облигаций

3.1 Хеджирование в среднеквадратическом в Модели Хо-Ли

3.1.1 Формулировка модели

3.1.2 Свойства структуры процентных ставок

3.1.3 Задача хеджирования в среднеквадратическом

3.2 Непрерывный аналог модели Хо-Ли

3.2.1 Формулировка модели

3.2.2 Свойства структуры процентных ставок

3.2.3 Задача хеджирования в среднеквадратическом

4 Хеджирование на рынке фьючерсов

4.1 Структура модели рынка фьючерсов

4.2 Свойства самофинансируемых стратегий

4.3 Хеджирование на фьючерсном рынке