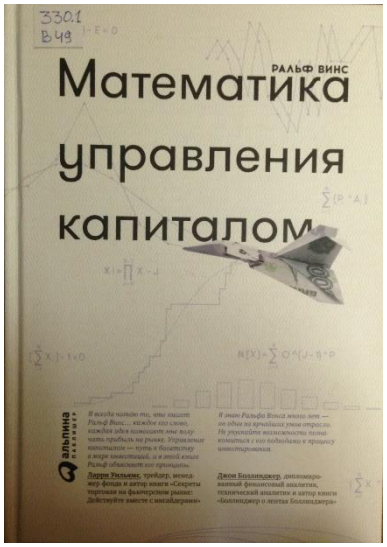
Шифр

330.1
В49



Винс Р.

Математика управления капиталом : методы анализа риска для трейдеров и портфельных менеджеров / Ральф Винс ; пер. с англ. [В.И. Ритман]. - 5-е изд. - Москва : Альпина Паблишер, 2018. - 400 с. : ил., табл. - Парал. тит. л. англ. - ISBN 978-5-9614-7052-9.

Книга, основанная на теории вероятностей, статистике и современной теории портфеля, рассказывает о том, как использовать различные методы управления капиталом на фьючерсном, валютном, фондовом и других рынках. Концепции, изложенные в этой книге, в большинстве своем просты, как и практические примеры, наглядно иллюстрирующие их использование в торговле. Сочетая практику современной теории портфеля с концепцией оптимального f, автор показывает, как соизмерять ставки и возможные последствия торговых решений. Стратегии, рассмотренные в этой книге, позволяют определять оптимальное количество контрактов для торговли на любых рынках, максимизировать прибыль при торговле с реинвестированием, рассчитывать весовые коэффициенты компонентов инвестиционного портфеля.

Книга ориентирована на профессиональных трейдеров и аналитиков, частных и институциональных инвесторов, работающих на фондовом рынке, рынке FOREX, а также на рынках фьючерсов и опционов.