

## Содержание

Выражение благодарности

Предисловие

Введение

Убирайся вон и не смей возвращаться назад

Все беды - от незнания

Структура, терминология и обозначения

1

Новая методология

Преимущества новой методологии

Общее представление о новой методологии

Несколько одновременных игр

Сравнение со старыми подходами

На пути к анализу нового типа

Статистическая независимость

История параметра  $f$

Оценочное среднее геометрическое (или как дисперсия  
исходов влияет на геометрический рост)

Фундаментальное уравнение торговли

Существует ли оптимальное  $f$ ?

Ответ критикам

Введение в портфели с оптимальным /

Заблуждения относительно текущих потерь и диверсификации

Следующий шаг

Сценарное планирование

Сценарные спектры

Дополнение первое

Сокращение дефицита за счет увеличенной дисперсии  
Валового Внутреннего Продукта

Дополнение второе

Обманчивая суть наращивания оплаты менеджмента  
и временного взвешивания

2

Законы роста, полезность и конечные потоки

Рост человеческой популяции

Минимизация ожидаемого среднего общего роста

Теория полезности

Теорема ожидаемой полезности

Свойства функций полезности

Иные взгляды на классическую теорию полезности

Как найти свою кривую полезности

Полезность и новая методология

3

Условные вероятности и корреляция

Количество реализаций (частота) и вероятность

Теория условной вероятности

Совместные вероятности двух непрерывных распределений

Оценка совместных вероятностей

4

Новая модель

Математическая оптимизация

Целевая функция

Математическая оптимизация или отыскание корней

Методы оптимизации

Естественный отбор

Генетический алгоритм

Важные замечания

5

Управление капиталом для профессионалов

Реализация новой модели

Активный и неактивный капитал

Перераспределение

Страхование портфеля и оптимальное /

Верхняя граница активного капитала и ограничение по марже

Торговля акциями

Смещение / и построение устойчивого портфеля

Настройка торговой программы с помощью

перераспределения

Градиентная торговля и непрерывное доминирование

Важные точки слева от пика на  $(p + 1)$ -мерной поверхности

Управление текущими потерями и новая методология

Новая роль инвестиционного аналитика

Список использованной литературы