

Перечень публикаций в рецензируемых изданиях
по направлению диссертационного исследования
Арбузова Вячеслава Олеговича
на тему «Имитационное моделирование микроструктуры фондового рынка на основе
высокочастотной и транзакционной информации»

1. Пеникас Г. И. Модели "копула" в задачах хеджирования ценового риска // Прикладная эконометрика. 2011. № 2. С. 3-21.
2. Гомаюн Н. И., Penikas H. I., Titova Y. Do Hedging and Trading Derivatives Have the Same Impact on Public European Banks' Value and Share Performance? / Working papers by NRU Higher School of Economics. Series FE "Financial Economics". 2012. No. 09.
3. Сироткин И. Н., Пеникас Г. И. Моделирование оптимального хеджирующего соотношения с учетом междневного и внутривнедневного рисков торговых позиций // В кн.: Первые чтения памяти профессора Б.Л. Овсиевича «Экономико-математические исследования: математические модели и информационные технологии». СПб. : Нестор-История, 2013. С. 191-193.
4. Penikas H. I., Vasilyeva K., Selmier II W. T. Risk as a good / Working papers by Indiana University. Series "Addressing the Complexities of Property Rights in Financial Markets". 2013. No. W13–11.
5. Sergey Proskurin, Penikas H. I. How Well do Analysts Predict Stock Prices? Evidence from Russia. / Working papers by NRU Higher School of Economics. Series FE "Financial Economics". 2013.
6. Пеникас Г. И. Иерархические копулы в моделировании рисков инвестиционного портфеля // Прикладная эконометрика. 2014. Т. 35. № 3. С. 18-38.
7. Bronevich A. G., Lepskiy A., Penikas H. I. The Application of Conflict Measure to Estimating Incoherence of Analyst's Forecasts about the Cost of Shares of Russian Companies // Procedia Computer Science. 2015. Vol. 55. P. 1113-1122.
8. Onishchenko V. S., Penikas H. I. Application of Copula Models for Modeling One-Dimensional Time Series, in: Financial Econometrics and Empirical Market Microstructure / Науч. ред.: S. Ivliev, A. K. Bera, F. Lillo. NY : Springer, 2015. P. 225-239.