12-19 августа 2016

1. Запустили пробную сделку OIL\_RUB\_CAD carry strategy
2. Произведен обзор стратегий предложенных ML по carry
3. Interest Rates Carry – do not use
4. Volatility carry – мы уже используем в некоторой вариации (вертикальные спреды на акциях)
5. FX carry – слишком низкие ставки и высокая волатильность
6. Commodity carry – та же причина. Для стратегии на одном активе платим и получаем примерно одно значение кэрри – стратегия переходит в стратегию использования форвардной кривой и ее отличий от нормальной. Для intercommodity – высоки риски движения активов в разные стороны

Next week ideas -

1. Попробовать стратегии используя valuation of Price Wizard App
2. Проверить данные Бернштейна
3. Посмотреть систему обработки циклов