

- Проблемы работы с волатильностью.
Рост корреляции изменений индекса VIX с изменениями стоимости финансовых инструментов снижает возможности хеджирования волатильности. На этом фоне падает привлекательность использования производных для хеджирования и ценовых рисков.
- Проблемы прогнозирования заставляют продавца деривативов завышать их стоимость, в то же время, покупатель всё чаще сталкивается с риском убытков в виде упущенной прибыли в ситуации дорожающих базовых инструментов.
- Всё это происходит одновременно с ростом разнообразия видов хозяйственной деятельности в развивающихся странах. Инструментарий экономических субъектов неуклонно растёт, что будет фактором сохранения высокого спроса на производные, базовым активом которых являются финансовые активы.