

<<现代投资组合理论>>

图书基本信息

书名：<<现代投资组合理论>>

13位ISBN编号：9787030190857

10位ISBN编号：7030190858

出版时间：2007-3

出版时间：科学

作者：张卫国

页数：183

版权说明：本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介，请支持正版图书。

更多资源请访问：<http://www.tushu007.com>

## <<现代投资组合理论>>

### 内容概要

《现代投资组合理论：模型、方法与应用》主要是作者近年来在投资组合理论与决策分析领域发表于国内外重要期刊上40余篇学术论文的研究成果，另外也介绍了一些国内外其他学者在该领域的研究进展。

本书研究了随机不确定环境下的投资组合选择问题和模糊不确定环境下的投资组合选择问题两大方面。

作者从现代投资组合选择理论、优化模型与计算方法相结合来考虑，运用现代数学的一些理论（概率统计、最优化、模糊数学及随机控制）、信息科学计算方法及计算机技术，围绕提出不确定环境下资产的收益及风险度量，建立适合不同类型投资者要求和满足各种投资约束条件的优化模型，研究相应的有效算法（包括解析方法、数值方法及智能算法），分析决策要素变化导致结果的变动以及在中国证券市场的应用等问题，试图形成投资组合选择从理论、模型、方法到应有的一个完整分析框架。

本书不仅对于理论工作者掌握研究动态、从事相关研究有指导作用，而且可供从事实际开发的人员学习与使用。

本书可作为高等院校数理金融、运筹学、管理科学、系统工程、投资决策相关专业师生研讨和教学用书。

## &lt;&lt;现代投资组合理论&gt;&gt;

## 书籍目录

序前言第1章 绪论1.1 现代投资组合理论研究现状评述1.2 半数的主要研究内容第2章 风险资产有效投资组合模型及算法2.1 引言2.2 风险资产有效投资组合模型2.3 允许卖空的风险资产有效投资组合解析表示2.4 不允许卖空的风险资产有效投资组合解析表示2.5 限制投资下界的有效投资组合解析表示2.6 限制投资数量的有效投资组合遗传算法第3章 风险资产有效前沿的动态分析3.1 引言3.2 相关风险资产有效前沿的动态分析3.3 不相关风险资产有效前沿的动态分析3.4 数值例子第4章 风险资产可容许有效投资组合模型及算法4.1 引言4.2 基于相似度的投资收益和风险估计4.3 基于多因素模型的收益和风险估计4.4 可容许收益及可容许风险4.5 可容许有效投资组合模型4.6 可容许有效前沿的算法4.7 应用第5章 存在无风险资产的可容许有效投资组合模型及算法5.1 引言5.2 具有无风险资产的有效投资组合模型5.3 贷出无风险资产的有效投资组合解析表示5.4 借入无风险资产的有效投资组合解析表示5.5 贷出和借入无风险资产的有效投资组合解析表示5.6 应用第6章 具有风险价值约束的投资组合模型及算法6.1 引言6.2 具有VaR约束和无风险贷出的投资组合模型及算法6.3 具有VaR约束和无风险借入的投资组合模型及算法6.4 具有VaR约束和无风险贷出或借入的投资组合模型及算法6.5 资产组合Mean-CVaR有效边界特性分析第7章 几种简化的有效投资组合模型及算法7.1 引言7.2 大规模的投资组合模型及算法7.3 中小投资者的投资组合模型及算法7.4 投向投资组合的变动分析7.5 数值例子第8章 基于离差的投资组合模型及算法第9章 上、下模糊可能性投资组合模型及算法第10章 加权可能性有效投资组合模型及算法第11章 连续时间的最优投资消费者模型及显式最优解参考文献

<<现代投资组合理论>>

版权说明

本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介，请支持正版图书。

更多资源请访问:<http://www.tushu007.com>