

<<投资组合优化与无套利分析>>

图书基本信息

书名：<<投资组合优化与无套利分析>>

13位ISBN编号：9787030088918

10位ISBN编号：7030088913

出版时间：2001-5

出版时间：科学出版社

作者：李仲飞,汪寿阳

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>

## <<投资组合优化与无套利分析>>

### 内容概要

《投资组合优化与无套利分析》是作者近年来在投资决策分析领域的部分研究工作的总结，反映了国内投资组合优化与无套利分析研究方向的某些重要研究进展。

《投资组合优化与无套利分析》应用凸分析、非光滑优化、动态规划、线性规划、非线性规划等数理工具，对投资组合选择理论和无套利分析方法展开了深入的研究。

《投资组合优化与无套利分析》有两个主要特色：一是将投资组合理论的基本方法——均值方差方法和现代金融学的基本方法——无套利分析方法相结合；二是对更接近于实际的问题进行建模并设计有效的模型。

## <<投资组合优化与无套利分析>>

### 书籍目录

- 序言
- 前言
- 第一章 引论
- 第二章 摩擦市场的最优投资组合选择
- 第三章 资产定价与最优投资组合选择的极大极小方法
- 第四章 不允许卖空时证券组合有效前沿的解析表达
- 第五章 多阶段最优投资组合选择
- 第六章 摩擦市场的无套利市场
- 第七章 摩擦市场最优消费-投资组合选择的无套利分析
- 第八章 摩擦市场利率期限结构的无套利分析
- 参考文献

<<投资组合优化与无套利分析>>

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>