

图书基本信息

书名：<<现代组合预测和组合投资决策方法及应用>>

13位ISBN编号：9787030110299

10位ISBN编号：7030110293

出版时间：2003年01月

出版时间：科学出版社

作者：唐小我

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>

## 内容概要

本书是作者多年来在组合预测和组合投资研究领域研究成果的系统集成，主要内容有：常用的预测技术概述；组合预测基本理论和非负权重最优组合预测理论及其应用，无偏组合预测理论及其应用，基于斯坦规则收缩估计和误差校正机制的组合预测模型及其应用；关于证券组合投资的均值-方差模型的理论及其改进研究，包括利用证券收益的因素模型和CAPM及APT对均值-方差模型进行改进导出了证券组合投资的因素决策模型及其理论；套期

书籍目录

第0章 绪论

0.1 组合预测与证券组合投资的思想和方法

0.2 本书内容提要

第1章 预测建模概述

1.1 常用预测方法简介

1.2 预测方法研究

1.3 一种预测模型质量的评价方法-损失函数法

1.4 折扣系数法在建立预测模型中的应用

第2章 组合预测的基本理论

2.1 最优组合预测方法

2.2 简单平均组合预测方法

2.3 递归等权组合预测方法

第3章 非负权重最优组合

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>