

<<资产组合选择和资本市场的均值>>

图书基本信息

书名：<<资产组合选择和资本市场的均值>>

13位ISBN编号：9787208061248

10位ISBN编号：7208061246

出版时间：2006-3

出版地：上海人民

作者：哈利·M·马科维兹

页数：525

字数：364000

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>

## <<资产组合选择和资本市场的均值>>

### 前言

本书的主要内容分新旧两部分。

所谓旧的部分，就是关于“一般均值一方差模型”的表述。

这种模型寻求在任何线性等式或不等式约束集下均值一方差有效的资产组合。

我（1956）对一定约束前提下的模型进行了定义和解答，此后，马科维兹（1959）提出了在较为一般前提下模型的定义和解答。

大家都了解一般模型的某些特例，它们是现代金融教科书的基本内容。

学术界和大型证券投资机构的经理们对这些内容尤为熟悉。

到目前为止，除了我（1956，1959）对一般解法有过简明表述外，没有其他书籍对一般解法作出说明。

据我所知，迄今为止，金融教科书尚未引进一般解法的内容。

## <<资产组合选择和资本市场的均值>>

### 内容概要

该书是美国大学研究生教材，配有附录和练习题以及计算机程序。

同时，由于该书介绍了资产组合选择理论的一般模型及解法，在科技高度发达的今天，投资专家和投资咨询机构有可能利用计算机将这一理论应用于实践。

本书可供广大经济学研究者们阅读学习。

<<资产组合选择和资本市场的均值>>

书籍目录

资产组合选择和资本市场的均值—方差分析出版前言中文版序言译者的话序 言第1篇 一般资产组合选择模型 1 资产组合选择模型 标准的均值-方差 资产组合选择模型 有上界的标准分析 托宾-夏普-林特纳模型 布莱克模型 空头地位需要附属 担保品抵押的模型 名义与真实报酬 第1章附录 加权平均的均值和方差 一般样本空间 第1章练习题 2 一般均值-方差资产组合选择模型 一般模型的三种形式 非线性的例子 历史评述 第2章练习题 3 一般模型的容量和假定 半定协方差矩阵 理论和实践中的 资产组合约束条件 行业约束条件 协方差模型 外生资产 追踪指数 证券交易量约束条件 为什么是均值和方差 贝叶斯推断 隐式的单一时期的效用极大化 二次逼近 对 $E_y$ 逼近的研究 相关的一些问题第2篇 初步结论 4 可行资产组合集的性质 5 包含有均值、方差和标准差的集合 6 有仿射约束集的资产组合选择模型第3篇 一般资产组合选择模型的解法 7 非退化模型的有效集 8 临界线算法的起步 9 对退化模型的分析 10 所有可行均值-方差组合第4篇 特例 11 二维分析的标准形式 12 标准约束集和市场资产第5篇 资产组合选择的计算机程序附录 矩阵代数和向量空间基础参考文献专业术语索引译者后记

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>