

## 带有模糊收益率的投资组合选择模型

陈国华,陈收, 房勇,汪寿阳

收稿日期 修回日期 网络版发布日期 接受日期

**摘要** 考虑了预期收益率为模糊数的投资组合选择问题,利用模糊约束简化方差约束,建立了投资组合选择的模糊线性规划模型,然后利用模糊数学知识把模糊线性规划问题转化为多目标线性规划问题,并且设计了模糊算法对其求解,最后通过一个数值算例检验所提模型的可行性,并且对模糊数模型与清晰数模型进行了比较.

**关键词** [投资组合选择](#) [模糊线性规划](#) [模糊两阶段法](#) [模糊预期收益率](#)

分类号

**DOI:**

对应的英文版文章: [2009070008](#)

通讯作者:

作者个人主页: 陈国华;陈收; 房勇;汪寿阳

### 扩展功能

本文信息

- ▶ [Supporting info](#)
- ▶ [PDF\(405KB\)](#)
- ▶ [\[HTML全文\]\(0KB\)](#)
- ▶ [参考文献\[PDF\]](#)
- ▶ [参考文献](#)

服务与反馈

- ▶ [把本文推荐给朋友](#)
- ▶ [加入我的书架](#)
- ▶ [加入引用管理器](#)
- ▶ [引用本文](#)
- ▶ [Email Alert](#)

相关信息

- ▶ [本刊中 包含“投资组合选择”的相关文章](#)
- ▶ 本文作者相关文章

- [陈国华](#)
- [陈收](#)
- [房勇](#)
- [汪寿阳](#)