

科技进步理论

基于分形分布的投资组合选择理论研究

周洪涛, 费奇

华中科技大学系统工程研究所, 华中科技大学系统工程研究所 湖北 武汉 430074

收稿日期 修回日期 网络版发布日期 接受日期

摘要 首先介绍了Markowitz的均值-方差模型,并分析了该模型的不足之处。在此基础上讨论了基于分形分布的投资组合选择问题。最后指出了求解分形投资组合选择问题的难点,并提出了今后研究的方向。

关键词 [Markowitz模型](#) [分形\(稳定\)分布](#) [投资组合选择](#)

分类号

DOI:

对应的英文版文章: [2003-03-046](#)

通讯作者:

周洪涛

作者个人主页: [周洪涛, 费奇](#)

扩展功能

本文信息

▶ [Supporting info](#)

▶ [\[PDF全文\]](#)(116KB)

▶ [\[HTML\]](#)(OKB)

▶ [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](#)

▶ [文章反馈](#)

▶ [浏览反馈信息](#)

相关信息

▶ [本刊中 包含“Markowitz模型”
的 相关文章](#)

▶ 本文作者相关文章

· [周洪涛](#)

· [费奇](#)

