



首页
概况
研究机构
学者介绍
成果文库
文献数据
培训教育
对外交流

□ 您的位置: 首页 → 数技经济研究杂志 → 现实经济问题研究

风险厌恶型的证券投资数学模型

摘要: 本文讨论了证券分析的过程和证券投资计划的制定。我们视证券价格的波动为动态的模糊系统, 利用模糊数的概念分析了证券价格的变化规律和定义了模糊集理论下的证券价格的期望值、证券投资收益率的期望值、预期风险系数。利用这些结果, 我们得到了一个风险厌恶型的证券投资数学模型, 为证券投资者的决策问题提供了一种新的解决途径。该模型的建立依赖于投资者的知识和经验, 它的求解过程简单易行。

关键词: 模糊集, 模糊数, 语言变量, 证券分析, 证券投资模型, 线性规划

Search the Web

Find It

地址: 北京市建国门内大街5号 邮政编码: 100732 电话及传真: 010-65125895、010-65137561
版权所有 (c) 中国社会科学院数量经济与技术经济研究所
联系我们 E-mail to: iqte@cass.org.cn