

改进的Atlas模型下市场的稳定分布

中国科学院数学与系统科学研究院, 北京

收稿日期 修回日期 网络版发布日期 接受日期

摘要 Atlas模型在随机投资组合理论中有广泛的应用, 但它的假定具有一定的局限性.

我们对该模型进行了改进, 证明了满足改进的Atlas模型的市场是渐进稳定的;

在改进的Atlas模型下我们得到了市场稳定分布的确定性等价近似以及不同投资组合的渐近增长率

与渐近超额增长率, 这些结果与Atlas模型的类似结果相比有很大的优点; 同时我们使用中国股票

市场的交易数据对资本的稳定分布以及某些投资组合的长期平均增长率进行了实证研究, 对比市场

平均资本分布以及Atlas模型的相应结果, 我们改进的Atlas模型在实证上比Atlas模型具有更好的

适用性.

关键词 [随机投资组合理论](#) [Atlas模型](#) [渐近稳定性](#) [稳定分布](#) [投资组合的渐近增长率](#)

分类号

扩展功能

本文信息

▶ [Supporting info](#)

▶ [PDF\(0KB\)](#)

▶ [\[HTML全文\]\(0KB\)](#)

▶ [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](#)

▶ [复制索引](#)

▶ [Email Alert](#)

▶ [文章反馈](#)

▶ [浏览反馈信息](#)

相关信息

▶ [本刊中 包含“随机投资组合理论”
的 相关文章](#)

▶ [本文作者相关文章](#)

Abstract

Key words

DOI:

通讯作者 钟玉聪 zyc_net@sina.com