

不允许卖空证券组合选择的有效子集

史树中(1), 杨杰(2)

(1)北京大学光华管理学院金融系,北京100871;(2)南开大学数学研究所,天津300071

收稿日期 修回日期 网络版发布日期 接受日期

摘要 证券组合选择的有效子集是指它可取代原有的基本证券集来生成Markowitz有效组合前沿,本文给出一个证券集的子集在不允许卖空的条件下是全集的有效子集的充要条件。

关键词 [Markowitz组合选择理论,卖空,均值-方差分](#)

分类号

EFFICIENT SUBSET FOR PORTFOLIO SELECTION WITHOUT SHORT SELLING

Shu Zhong SHI(1), Jie YANG(2)

(1)Department of Finance, Guanghua School of Management, Peking University, Beijing 100871,P.R.China;(2)Nankai Institute of Mathematics,Tianjin 300071

Abstract An efficient subset for portfolio selection means that it may replace the original security set to generate the Markowitz portfolio efficient frontier. This paper gives a necessary and sufficient condition for a subset to be efficient without short subset.

Key words [Markowitz portfolio selection theory](#) [mean-variance analysis](#) [efficient portfolio frontier](#) [efficient subset](#)

DOI:

通讯作者

扩展功能

本文信息

- ▶ [Supporting info](#)
- ▶ [PDF\(617KB\)](#)
- ▶ [\[HTML全文\]\(0KB\)](#)
- ▶ [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](#)
[“Markowitz组合选择理论,卖空,均值-方差分” 的相关文章](#)
- ▶ [本文作者相关文章](#)

- [史树中](#)
- [杨杰](#)