

证券组合选择的有效子集

史树中(1), 杨杰(2)

(1)北京大学金融数学与金融工程研究中心,北京100871,南开数学研究所300071;(2)南开数学研究所,300071

收稿日期 修回日期 网络版发布日期 接受日期

摘要 本文引进证券组合选择的有效子集概念.

有效子集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是全集的有效子集的充要条件. 在理论上, 这是一条新的k-基金分离定理; 在实际应用上, 这有可能用来减少计算有效组合前沿的计算量.

关键词 [Markowitz组合选择理论](#), [均值-方差分析](#), [有效组合前沿](#), [有效子集](#)

分类号

EFFICIENT SUBSET FOR PORTFOLIO SELECTION

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

(1)Research Center for Financial Mathematics and Engineering, Peking University, Beijing 1000871, P.R.China, & Nankai Institute of Mathematics, Tianjin 300071, P.R.China; (2)Nankai Institute of Mathematics, Tianjin 300071, P.R.China

Abstract This paper introduces a concept of efficient subset for portfolio selection. An efficient subset may replace the original security set to generate the Markowitz portfolio efficient frontier. A necessary and sufficient condition for a subset to be efficient is obtained. Theoretically, this is a new k-fund separation theorem; practically, the theorem could decrease the computational time for calculating the portfolio efficient frontier.

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

DOI:

通讯作者

扩展功能

本文信息

- ▶ [Supporting info](#)
- ▶ [PDF\(535KB\)](#)
- ▶ [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, 均值-方差分析, 有效组合前沿, 有效子集” 的相关文章](#)
- ▶ [本文作者相关文章](#)

- [史树中](#)
- [杨杰](#)