

股票-债券投资模型实证研究

余湄,杨洋,汪寿阳

收稿日期 修回日期 网络版发布日期 接受日期

摘要 利用均值方差MV模型与绝对偏差MAD模型,分别选择股票,国债与企业债,在无摩擦市场与有摩擦市场下构建投资组合的最优策略,并利用国内股票市场与债券市场的数据进行实证分析,比较两种风险模型的投资效果.结果发现:加入债券后,与单纯的选择股票组合相比,投资组合的风险极大的降低,且收益更加稳定.

关键词 [股票](#) [债券](#) [投资组合](#)
[交易费](#)

分类号

DOI:

扩展功能

本文信息

▶ [Supporting info](#)

▶ [PDF\(942KB\)](#)

▶ [\[HTML全文\]\(0KB\)](#)

▶ [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](#)

相关信息

▶ [本刊中包含“股票”的相关文章](#)

▶ 本文作者相关文章

· [余湄](#)

· [杨洋](#)

· [汪寿阳](#)