

## 基于差异系数 $\sigma/\mu$ 的最优投资组合方法

郑锦亚<sup>1</sup>, 迟国泰<sup>2</sup>

1. 大连理工大学应用数学系, 辽宁 大连 116024;
2. 大连理工大学管理学院, 辽宁 大连 116024

## Optimal Portfolio Selection on the Basis of Difference Coefficient $\sigma/\mu$

ZHENG Jin-ya<sup>1</sup>, CHI Guo-tai<sup>2</sup>

1. Department of Applied Mathematics, Dalian University of Technology, Dalian 116024, China;
2. School of Management, Dalian University of Technology, Dalian 116024, China

- [摘要](#)
- [参考文献](#)
- [相关文章](#)

**Download:** PDF (2514KB) [HTML](#) (KB) **Export:** BibTeX or EndNote (RIS) [Supporting Info](#)

**摘要** 本文以Markowitz均值-方差模型为基础,提出了差异系数 $\sigma/\mu$ 极小化以及在此条件下的组合收益率极大化的均衡理论,利用Lagrange参数法,得到了一种使单位收益风险最小的投资组合决策方法,并给出了实例分析。

**关键词:** [差异系数 \$\sigma/\mu\$](#)  [均衡理论](#) [Lagrange参数法](#) [投资组合](#)

**Abstract:** On the basis of Markowitz mean-variance model, we put forward the balanced theory of portfolio profit rate maximization on the condition that difference coefficient  $\sigma/\mu$  is minimized. Using Lagrange parameter method, we gain the feasible portfolio decision. At last we give an example analysis.

**收稿日期:** 2000-07-26;

**基金资助:**国家自然科学基金资助项目(79770011)

### 引用本文:

郑锦亚, 迟国泰. 基于差异系数 $\sigma/\mu$ 的最优投资组合方法[J] 中国管理科学, 2001,V(1): 1-5

### Service

[把本文推荐给朋友](#)

[加入我的书架](#)

[加入引用管理器](#)

[Email Alert](#)

[RSS](#)

### 作者相关文章

[郑锦亚](#)

[迟国泰](#)

[没有本文参考文献](#)

[没有找到本文相关文献](#)

