

在有效前沿上集中投资回报的分配

李静远

华中科技大学管理学院, 武汉, 430074

A Note on Improving the Efficient Frontier

LI Jing-yuan

Management School, Huazhong University of Science and Technology, Wuhan 430074, China

- [摘要](#)
- [参考文献](#)
- [相关文章](#)

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

摘要 基于均值-方差模型对在有效前沿上集中投资回报提出一个既能增加单个投资者的期望回报,又能减少风险的分配方式,而且此种分配使得投资经理可获得正的期望回报。

关键词: [均值-方差模型](#) [基金管理](#) [集中投资](#)

Abstract: This note has extended the idea in Kwan's paper. That is, by pooling the capital of individual investors for investing in a specific efficient portfolio, each investor can achieve a higher expected return and a lower exposure of risk. Moreover, the portfolio manager can make positive expected profit by pooling.

收稿日期: 2004-11-01;

引用本文:

李静远. 在有效前沿上集中投资回报的分配[J] 中国管理科学, 2005, V(4): 106-110

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

[李静远](#)

没有本文参考文献

没有找到本文相关文章