

图书基本信息

书名：<<摩擦市场下的投资组合与无套利分析>>

13位ISBN编号：9787030139825

10位ISBN编号：7030139828

出版时间：2005-1

出版时间：科学出版

作者：余湄

版权说明：本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介，请支持正版图书。

更多资源请访问：<http://www.tushu007.com>

内容概要

《摩擦市场下的投资组合与无套利分析》应用凸分析、线性与非线性规划、动态规划、非光滑分析等数学工具，对无套利分析和投资组合理论两个方面展开了系统深入的研究。

《摩擦市场下的投资组合与无套利分析》的主要特色有：一是在更一般的摩擦条件下对投资组合理论进行了研究，并且把无套利分析与投资组合理论有机地结合起来，所得结论更适用于实际金融市场的情形；二是提出了一些新的投资模型，并给出了一个无套利理论分析框架及相应的求解方法，丰富了现有的投资组合理论。

《摩擦市场下的投资组合与无套利分析》可供从事金融数学、金融工程和金融管理的研究人员以及实际从事投资决策分析的专业人员阅读，也可作为相关专业的高年级大学生或研究生的教学参考书。

版权说明

本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介, 请支持正版图书。

更多资源请访问:<http://www.tushu007.com>