

《资产组合选择和资本市场的均值-》

图书基本信息

书名：《资产组合选择和资本市场的均值-方差分析》

13位ISBN编号：978711153557X

出版时间：2016-6

作者：[美]哈里 M. 马科维茨(Harry M. Markowitz),[美] G. 彼得o托德 (G.Peter Todd)

页数：368页

译者：黄涛

版权说明：本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介以及在线试读，请支持正版图书。

更多资源请访问：www.tushu000.com

《资产组合选择和资本市场的均值-》

内容概要

诺贝尔经济学奖得主 现代投资组合理论之父作品

马科维茨可能比其他任何一位活着的人对现代金融和投资理论的影响都更加深远。

-- 《纽约时报》

《资产组合选择和资本市场的均值-方差分析》包含了对一般资产组合选择模型、各种重要的特例、可行解和有效解的特征，以及其他相关内容的完整处理。特别论述了为什么资产组合选择应遵循均值-方差准则，在此基础上介绍了求解一般资产组合选择模型的临界线算法，并给出了用VBA语言编写的资产组合选择计算机程序，从而使本书既具有重大的理论意义，又具有重要的实践价值。

资产组合选择理论是现代金融理论的基础，马科维茨教授亦因提出和发展了这一理论而获得1990年的诺贝尔经济学奖。作为资产组合选择理论的集大成之作，本书不仅是希望进一步深入钻研现代金融理论的研究人员和金融相关专业学生不可或缺的经典读物，而且对于从事投资实践的金融从业者也具有重要的参考价值。

《资产组合选择和资本市场的均值-》

作者简介

哈里 M. 马科维茨 (Harry M. Markowitz, 1927-)

1990诺贝尔经济学奖获得者，现代投资组合理论之父

马科维茨博士将计算机和数学技术应用于各种实际决策领域。在金融领域，他在1952年提出了"现代资产组合理论"，这一理论现在已经是大学课程中的标准主题，并被机构投资者广泛应用于战术性资产配置、风险控制和归因分析。他的研究在今天被认为是金融经济学理论先驱工作，被誉为"华尔街的第一次革命"。其他领域：马科维茨博士发展了"稀疏矩阵"技术，以求解非常大型的数理最优化问题。这一技术现在是优化程序软件中的标准技术。他还设计并指导了SIMSCRIPT程序语言的开发，这一语言现在被广泛应用于编制工厂、交通和通信网络等系统的计算机模拟程序。

1990年，马科维茨博士因在金融经济学方面做出了开创性工作--资产组合理论而与人分享了诺贝尔经济学奖。

G. 彼得o托德 (G.Peter Todd)

托德博士是里弗维尤国际集团 (有限) 公司的主管，负责公司的软件开发业务。1990~1998年期间，托德博士任大和证券信托公司全球资产组合研究部副总裁，在这里他和研究部的研究主管哈利o马科维茨共事。

《资产组合选择和资本市场的均值-》

书籍目录

《资产组合选择和资本市场的均值-》

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:www.tushu000.com