

CONTENTS

目 录

第 1 章	绪 论	001
	1.1 选题背景与研究意义	001
	1.2 国内外研究现状分析	004
	1.3 研究内容与技术路线	011
	1.4 本书的创新点	013
第 2 章	理论基础	015
	2.1 风险度量理论	015
	2.2 投资组合优化理论	017
	2.3 DEA 基本理论	018
第 3 章	数据驱动下的参数确定 DEA 投资组合 评价方法	024
	3.1 投资组合可能集	025
	3.2 均值 - 方差准则下的投资组合评价方法	026
	3.3 实证分析	035

第 4 章	数据驱动下的参数确定 DEA 投资组合标杆	
	构造方法	046
4.1	传统 DEA 投资组合标杆构造方法	047
4.2	DEA 投资组合标杆的样本外评价	063
4.3	DEA 投资组合标杆在中国基金市场中的应用	070
第 5 章	数据驱动下的参数不确定 DEA 投资组合标杆	
	构造方法	079
5.1	参数不确定 DEA 投资组合标杆构造	080
5.2	参数不确定 DEA 投资组合标杆的样本外评价	096
5.3	参数不确定 DEA 标杆构造方法在投资组合 优化中的应用	111
第 6 章	数据驱动下的 DEA 投资组合优化方法	115
6.1	DEA 股票选择方法	116
6.2	DEA 投资组合策略优化方法	121
6.3	实证分析	125
	参考文献	136