

عنوان مقاله:

A Stochastic Efficient Frontier Method for Resource Allocation with Deferent Time Cycles

محل انتشار:

اولین کنفرانس بین المللی تحقیق در عملیات ایران (سال: 1386)

تعداد صفحات اصل مقاله: 2

نویسنده:

a Eskandarpour

خلاصه مقاله:

This paper presents a new extended efficient frontier problem. The new method assumes that all risky assets have different time cycle for their returns. The primary assumption is that the return for each asset is stochastic in its nature. We solve the problem and discuss the results with some numerical examples.

کلمات کلیدی:

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/139684>

