

16 Matematisk egenskap ved porteføljefronten.

La:

$$\sigma \{R[x^*(r)]\}$$

betegne standardavviket for det effisiente settet svarende til valgt forventet avkastningsnivå r . Utled et analytisk uttrykk for tangenten som går gjennom punktet

$$(r_0, \sigma \{R[x^*(r_0)]\})$$

i porteføljefronten. Vis at porteføljefronten har en asymptote som går gjennom punktet

$$(E \{R(x^{MIN})\}, 0)$$

og med stigningsforhold

$$\frac{\sigma \{R[z^*]\}}{E \{R[z^*]\}}$$

Kommentér.