

Tartalomjegyzék

Előszó	1
1. Hasznosságelmélet	5
1.1. Preferenciák	5
1.2. A hasznosság maximalizálása	15
1.3. Lottók, várható hasznosság, paradoxonok	30
1.4. Kockázatkerülés	71
2. Portfólióelmélet	95
2.1. Optimális portfóliók	95
2.2. Sztochasztikus dominancia	136
2.3. Hatékony portfóliók	164
2.4. Value at Risk – A kockázatosított érték	184
2.5. Expected shortfall – A nagy veszteségek átlaga	228
Függelék	239
A. Feltételes szélsőértékszámítás	241
A.1. Konvex és konkáv függvények	241
A.2. Lagrange-féle multiplikátor módszer	254
A.3. Karush–Kuhn–Tucker-tétel	272
A.4. Az implicit függvénytételek és a helyettesítési határráta	308
B. Jelölések	313
Irodalomjegyzék	315
Tárgymutató	319