

应用数学, 统计学

H值相关定理及证明

梁亦孔¹, 柴俊²

1. 上海工程技术大学基础学院, 上海201600; 2. 华东师范大学数学系, 上海200241

收稿日期 2007-11-27 修回日期 2008-1-4 网络版发布日期 2008-10-9 接受日期 2008-3-4

摘要 进一步研究如何利用H值来筛选证券组, 推导了关于H值组成部分相关量的具体表达式, 并得到了证券组中去掉最“差”的一种证券后H值改变量满足的一个不等式.

关键词 [H值](#) [Treynor比率](#) [市场指数模型](#) [证券数目](#)

分类号 [F224.0A](#)

Some theorems about the H-value rule(Chinese)

LIANG Yi-kong¹, CHAI Jun²

1. College of Fundamental Studies, Shanghai University of Engineer Science, Shanghai 201600, China;

2. Department of Mathematics, East China Normal University, Shanghai 200241, China

Abstract

Further study was given in this paper to the H value as a standard for evaluation of the quality of a security set. The H value in terms of its related parameters was characterized. An inequality which the changed H value satisfies after removing the "worst" security from the set was proved.

Key words [H-value](#) [Treynor ratio](#) [market index model](#) [number of the securities](#)

DOI:

通讯作者 柴俊 jchai@math.ecnu.edu.cn

扩展功能

本文信息

▶ [Supporting info](#)

▶ [PDF\(1239KB\)](#)

▶ [\[HTML全文\]\(0KB\)](#)

▶ [参考文献](#)

服务与反馈

▶ [把本文推荐给朋友](#)

▶ [加入我的书架](#)

▶ [加入引用管理器](#)

▶ [复制索引](#)

▶ [Email Alert](#)

相关信息

▶ [本刊中 包含“H值”的 相关文章](#)

▶ 本文作者相关文章

· [梁亦孔](#)

· [柴俊](#)