



云南大学学报(自然科学版) » 2002, Vol. » Issue (6): 405-408 DOI:

数学

最新目录 | 下期目录 | 过刊浏览 | 高级检索

◀◀ Previous Articles | Next Articles ▶▶

限制卖空条件下的证券投资组合

李晋枝, 乔克林, 何树红

云南大学数学系, 云南, 昆明, 650091

Portfolio model under limited short sales

LI Jin-zhi, QIAO Ke-lin, HE Shu-hong

Department of Mathematics, Yunnan University, Kunming 650091, China

- 摘要
- 参考文献
- 相关文章

全文: PDF (708 KB) HTML (KB) 输出: BibTeX | EndNote (RIS) 背景资料

摘要 阐述了卖空在证券组合投资策略中的作用,并对实际证券市场中的卖空进行分析.提出了限制性卖空条件下的证券组合投资决策方法,得出较为一般的公式,对几种特殊情形作出分析,并列举实例证明其可行性.

关键词: 卖空 证券组合 维持保证金

Abstract: The action of short sales in investment portfolio policy is mainly discussed, and short sales of market in reality is analysed. Portfolio investment policy is offered on the condition of limited short sales. General formula is also given and some special conditions are analysed.

Key words: short sales portfolio maintenance margin

收稿日期: 2002-04-26;

基金资助: 云南省省院省校合作项目“金融数学学科建设”资助

引用本文:

李晋枝, 乔克林, 何树红. 限制卖空条件下的证券投资组合[J]. 云南大学学报(自然科学版), 2002, (6): 405-408.

LI Jin-zhi, QIAO Ke-lin, HE Shu-hong. Portfolio model under limited short sales[J]. , 2002, (6): 405-408.

没有本文参考文献

没有找到本文相关文献

服务

- ▶ 把本文推荐给朋友
- ▶ 加入我的书架
- ▶ 加入引用管理器
- ▶ E-mail Alert
- ▶ RSS

作者相关文章

- ▶ 李晋枝
- ▶ 乔克林
- ▶ 何树红

版权所有 © 《云南大学学报(自然科学版)》编辑部

编辑出版：云南大学学报编辑部（昆明市翠湖北路2号，650091）

电话：0871-5033829(传真) 5031498 5031662 E-mail: yndxxb@ynu.edu.cn yndxxb@163.com