

## 限制性卖空的均值-半绝对偏差投资组合模型及其旋转算法研究

张鹏<sup>1</sup>, 张忠桢<sup>2</sup>, 岳超源<sup>1</sup>

1. 华中科技大学系统工程研究所, 湖北, 武汉, 430074;
2. 武汉理工大学管理学院, 湖北, 武汉, 430070

## Optimization of the Mean Semi-absolute Deviation Portfolio Selection Model with the Restricted Short Selling Based on the Pivoting Algorithm

ZHANG Peng<sup>1</sup>, ZHANG Zhong-zhen<sup>2</sup>, YUE Chao-yuan<sup>1</sup>

1. Institute of System Engineering, Huazhong University of Science and Technology, Wuhan 430074, China;
2. School of Management, Wuhan University of Technology, Wuhan 430070, China

- [摘要](#)
- [参考文献](#)
- [相关文章](#)

Download: [PDF \(KB\)](#) | [HTML \(KB\)](#) | Export: [BibTeX](#) or [EndNote \(RIS\)](#) | [Supporting Info](#)

**摘要** 本文提出了限制性卖空的均值-半绝对偏差投资组合模型,通过变量替换将该模型转变为一般线性规划问题,从而运用线性规划的旋转算法进行求解。最后,文章以一个具体的算例验证了该算法的有效性,并证明将限制性卖空引入到投资组合中,有助于增强市场效率,降低市场风险。

**关键词:** [投资组合](#) [均值-半绝对偏差](#) [限制性卖空](#) [旋转算法](#)

**Abstract:** We propose a mean semi-absolute deviation portfolio selection model with the restricted short selling. The model is a linear programming problem and is solved by the pivoting algorithm. At last, we prove the algorithm is highly effective and the restricted short selling can increase the efficiency of the security market by an example.

收稿日期: 2005-09-10;

基金资助:国家自然科学基金资助项目(70471077)

**引用本文:**

张鹏, 张忠桢, 岳超源. 限制性卖空的均值-半绝对偏差投资组合模型及其旋转算法研究[J] 中国管理科学, 2006, V(2): 7-11

### Service

- [把本文推荐给朋友](#)
- [加入我的书架](#)
- [加入引用管理器](#)
- [Email Alert](#)
- [RSS](#)

### 作者相关文章

- [张鹏](#)
- [张忠桢](#)
- [岳超源](#)

没有本文参考文献

没有找到本文相关文章

