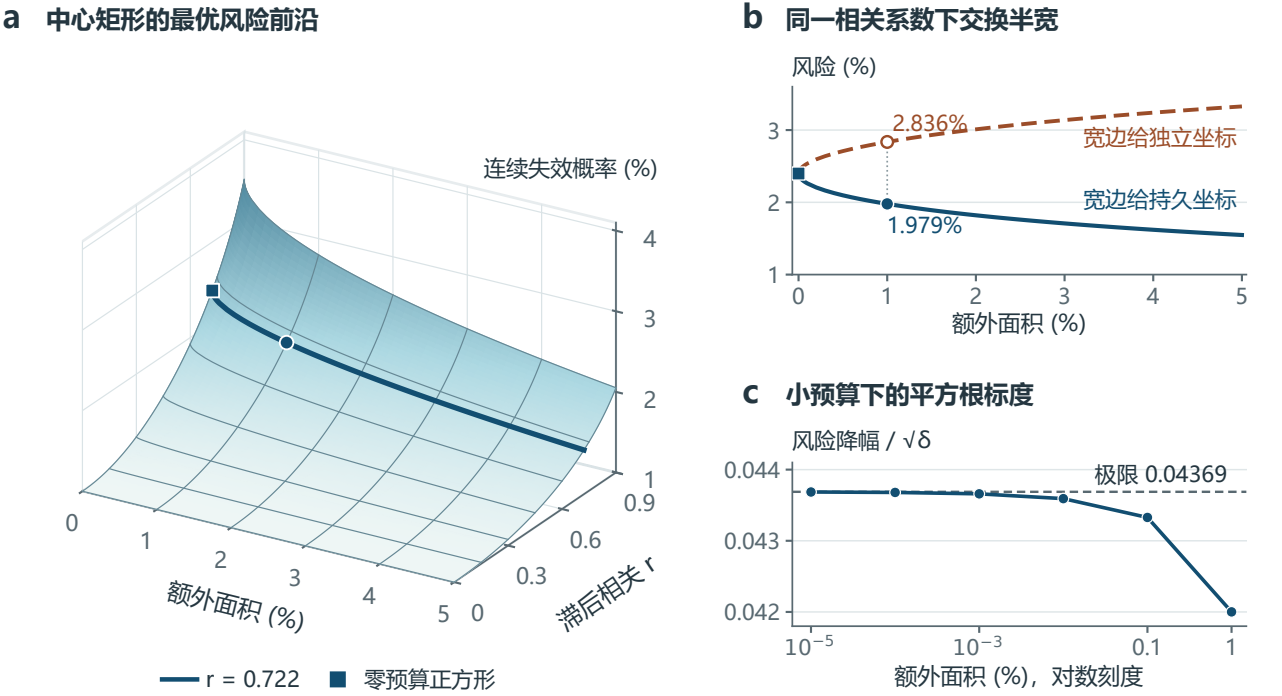

a 中心矩形的最优风险前沿
连续失效概率 (%)
4
3
2
1
0
1
2
3
4
5
额外面积 (%)
0
0.3
0.6
0.9
滞后相关 r
r = 0.722
零预算正方形
b 同一相关系数下交换半宽
风险 (%)
3
2
1
2.836%
宽边给独立坐标
宽边给持久坐标
1.979%
0
1
2
3
4
5
额外面积 (%)
c 小预算下的平方根标度
风险降幅 / √δ
0.044
0.043
0.042
极限 0.04369
10−5
10−3
0.1
1
额外面积 (%)，对数刻度