

[首页](#)[概况](#)[研究机构](#)[学者介绍](#)[成果文库](#)[文献数据](#)[培训教育](#)[对外交流](#)

Search the Web

Find It

□ 您的位置： [首页](#) → [数技经济研究杂志](#) → [现实经济问题研究](#)

## 各种指数基金模型的实证比较分析

**【摘要】**在指数基金管理方面，存在着多种优化的指数投资组合的构建方法和绩效评估方法，本文以实证研究的形式，比较分析了由5种“选股”方法和5种“资金配置”方法所构成的25种投资组合在各种绩效评估方法下的表现。最终得出结论认为，在遗传算法下利用DMinMax模型配置资产权重将具有较好的投资绩效。

关键词 指数基金 遗传算法 夏普指数 詹森指数 信息比率

地址：北京市建国门内大街5号 邮政编码：100732 电话及传真：010-65125895、010-65137561

版权所有 (c) 中国社会科学院数量经济与技术经济研究所

联系我们 E-mail to: [iqte@cass.org.cn](mailto:iqte@cass.org.cn)