

研究简报

1 0 0 0

清华大学国家金融研究院

民生财富研究中心

2014	2751			433
872	ETF	323	QDII	79
31			57	
		120		72

764

2001 2014

A

A 300

Sharpe Ratio

Sortino Ratio

764

3

448

1

Sharpe Ratio

,

16%

1.24

-0.38

0.38

25%

0.58

2

Sortino Ratio

84%

16%

3.01

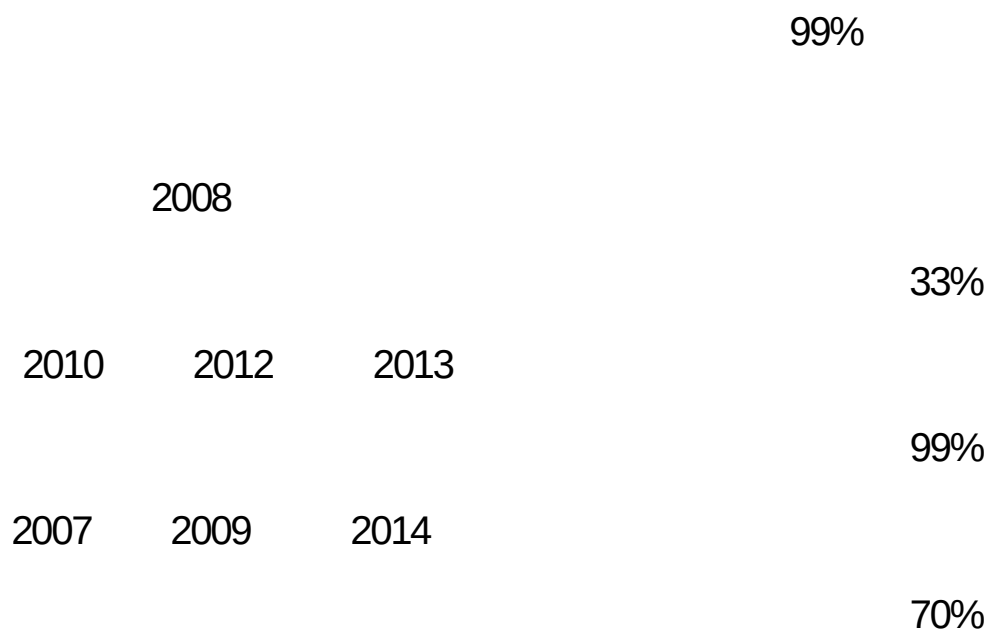
-0.59

0.72

25%

1.07

3



84%

16%

2015 8 20
