

目 錄

摘 要.....	III
ABSTRACT.....	IV
表 目 錄.....	VI
圖 目 錄.....	VII
第一章 緒論.....	1
1.1 前言.....	1
1.2 研究目的與架構.....	3
第二章 文獻回顧.....	4
第三章 數學模型探討.....	11
3.1 投資組合的數學模型.....	11
3.2 指數基金的數學模型.....	19
第四章 調整指數基金的數學模型與演算法.....	23
4.1 調整投資組合的數學模型.....	23
4.2 調整指數基金的數學模型.....	26
4.3 演算法.....	31
第五章 實證研究.....	33
第六章 結論與建議.....	38
參考文獻.....	39

表 目 錄

表一 啟發式演算法的效率.....	35
表二 調整時機與交易成本、追蹤誤差的關係.....	36
表三 T1 時間建構的指數基金組合與四十天後調整的組合.....	37

圖 目 錄

圖一 台灣 50 指數與指數基金的市值變化圖.....	34
圖二 調整時機與交易成本的關係.....	36