

Homework 13

请在北太天元（或 MTLAB 或 octave）上完成以下作业：

1. 请先看卢老师文章“《数值方法：原理、算法及应用》第 16.4 课：二次规划与带约束的一般优化问题”中用函数 `quadprog` 求解投资组合优化问题的代码示例（[点击这里访问](#)），合理恰当地修改其中预期收益率向量 r 、协方差矩阵 Q 和目标收益率 R_t ，并解释你的计算结果.