
如何挑選好的 ETF

第 24 組

B03703026 王憲儀

報告內容

- project 架構
- demo

ETF 篩選

- 33 個類別
- 2013年1月以來的數據
- 從 Yahoo Finance 抓取淨值

績效評估

- sharpe ratio
- omega
- riskness r

ETF 類別

- 以 riskness r 排序
- 排名前 25% 的 ETF 等權重組合
- 每個類別形成一支投資標的

計算權重

- 以 mean - variance 為框架
- 各類別的 ETF 至少佔有一定的權重

功能

- ETF 績效查詢
- 權重計算