

---

# 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  $r$

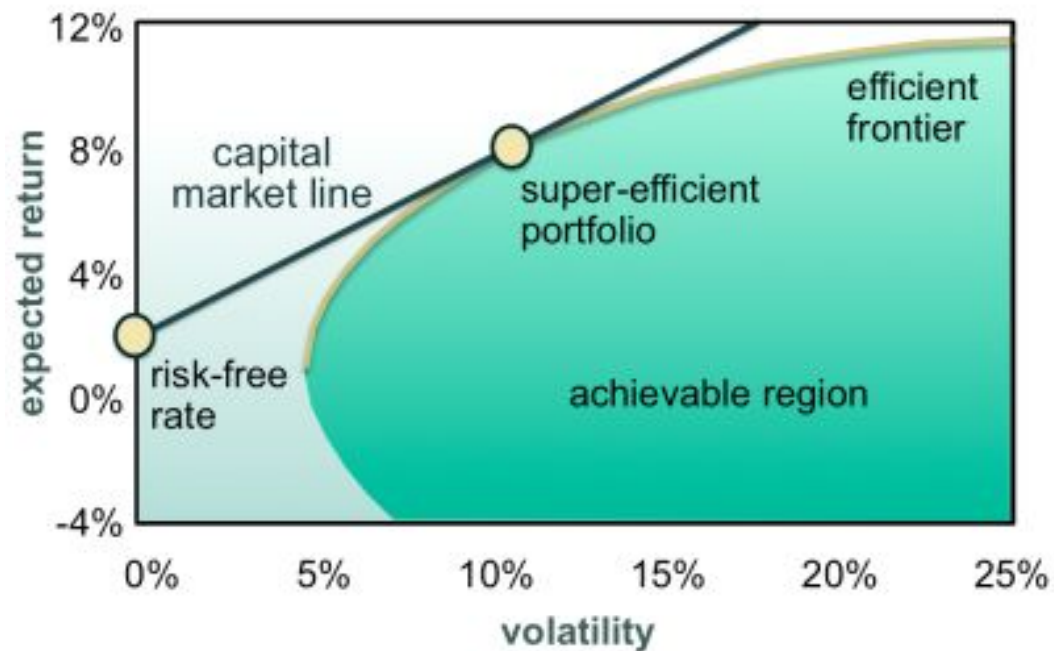
## ETF 類別

- 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
- 找出形成 capital market line 的權重

# 計算權重



# 功能

- ETF 績效查詢
- 權重計算