



复旦大学量化投资策略作业 3

孙健

复旦大学经济学院

2018 年 10 月 30 日

请各组独立完成下列作业。作业的递交形式为 **Word** 或者 **PPT** 形式。用累计收益图形、表格和文字的形式来解释你的发现和观点。

- (1) 用上证指数过去十年数据，计算日间的所有累积收益和收盘到第二天开盘的所有累积收益，进行比较。用同样的方法来计算风格指数、行业指数和一些有代表性的个股。
- (2) 用 **Kalman** 滤波的方法来重新做一些趋势性和反转性策略，同时比较和以往策略的相同和不同。
- (3) 下载一些全球有代表性的指数，例如黄金，原油，债券，美股，欧股和中国股票等等。使用课上讲过的风险平价模型和方差最小模型，建立大类资产配置。