

C 题 组合投资与数字经济

（为避免侵权，这里说明一下，数据来源于 2022 华中杯 B 题和华东杯 B 题，提供方分别为杭州同花顺公司和 Wind 公司）

随着越来越多的网民涌入炒股大军，股票也成为了大家经常提到的一个话题。相信大家玩过股票的很多都当过“韭菜”，毕竟没人是高进那样的赌神。为了避免被割韭菜太严重，投资的同学还是应该有一些基本的数据分析能力的。

我们提供了 2021 年 7 月 14 日到 2022 年 1 月 28 日的股票数据。附件一是 50 支股票在这一期间的数据和中证指数在这一期间的变化，股票的价格统一用收盘价表示。附件二是一些计量经济学方面的数据，包括一些技术指标、国外市场情况和外币汇率等。附件三则是一些中国的宏观经济数据。

需要解决以下问题：

（1）．查阅资料试着分析附件二、附件三当中指标对中证指数的影响，并筛选出对中证指数影响最大的 10 个指标。

（2）．根据附件 1 提供的股票数据，对这 50 支股票进行评价，并选择最值得购买的 10 支股票。

（3）．如果从附件 1 中提供的 50 支股票中选择 10 支进行组合投资，并且需要满足以下两个条件：

- 每支股票的仓位不能超过 25%
- 总体的月收益率必须在中证指数波动率上下 5 个百分点之内（含 5 个点），如果超过这一范围则不允许你进行投资。

那么请基于这半年的历史数据确定你的投资策略，如果在 1 月 28 日这一天投资到 2.28 你的月收益率会达到多少。

（4）．中证指数与这 50 支股票之间是否存在一定程度的影响？试分析二者之间的关联与影响大小，并基于前面问题的结论对中证指数进行预测。
