

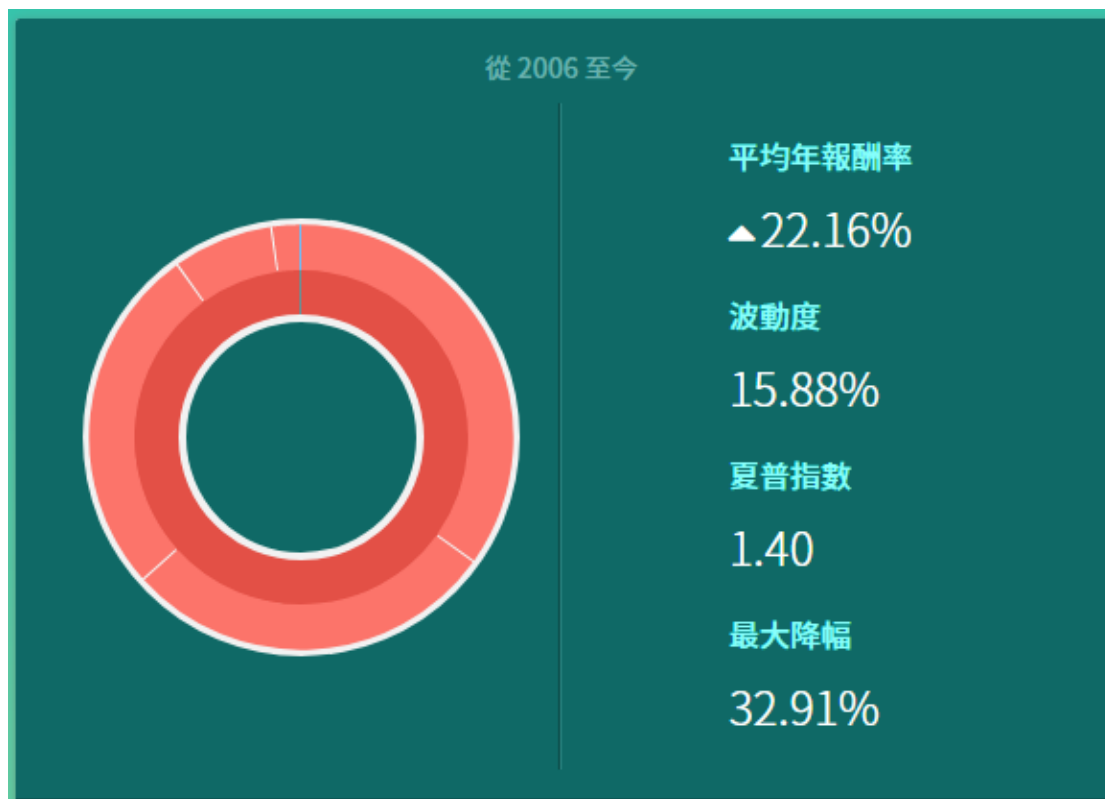
FinTech Homework 3

1. Sharpe Ratio

Sharpe Ratio: 1.40

風險等級：高風險

2. Screen shot the output of your Sharpe ratio from your monitor



3. List assets of your portfolio

投資組合列表		
US Equity		100.00%
GOOG	Alphabet Inc.	35.00%
FB	Facebook Inc.	28.44%

MSFT	Microsoft Corporation	26.70%
SQ	Square Inc.	7.66%
QCOM	QUALCOMM Inc.	2.19%
QQQ	PowerShares QQQ Trust, Series 1 (ETF)	0.00%
NVDA	NVIDIA Corporation	0.00%
AMZN	Amazon.com Inc.	0.00%
VOO	Vanguard 標普 500 指數 ETF	0.00%
VB	Vanguard 小型股 ETF	0.00%
SHE	SPDR Series Trust SPDR SSGA Geber Diversity Index ETF	0.00%
JNJ	Johnson & Johnson	0.00%
AVGO	BroadCom Ltd	0.00%
PFE	Pfizer Inc.	0.00%
VNQ	Vanguard 不動產投資信託 ETF	0.00%
VZ	Verizon Communications Inc.	0.00%
T	AT&T Inc.	0.00%
Fixed Income		0.00%
LQD	iShares iBoxx 投資等級公司債券 ETF	0.00%
MUB	iShares 國市政債券 ETF	0.00%
BIV	Vanguard 美國中期債券 ETF	0.00%
TLT	iShares 20 年期以上美國公債 ETF	0.00%
Commodities		0.00%
IAU	iShares 黃金信託 ETF	0.00%

投資組合列表

US Equity **100.00%**

GOOG	Alphabet Inc	35.00%
FB	Facebook Inc	28.44%
MSFT	Microsoft Corporation	26.70%
SQ	Square Inc	7.66%
QCOM	QUALCOMM, Inc.	2.19%
QQQ	PowerShares QQQ Trust, Series 1 (ETF)	0.00%
NVDA	NVIDIA Corporation	0.00%
AMZN	Amazon.com, Inc.	0.00%
VOO	Vanguard標普500指數ETF	0.00%
VB	Vanguard小型股ETF	0.00%
SHE	SPDR Series Trust SPDR SSGA Gender Diversity Index ETF	0.00%
JNJ	Johnson & Johnson	0.00%
AVGO	Broadcom Ltd	0.00%
PFE	Pfizer Inc.	0.00%
VNQ	Vanguard不動產投資信託ETF	0.00%
VZ	Verizon Communications Inc.	0.00%
T	AT&T Inc.	0.00%

Fixed Income **0.00%**

LQD	iShares iBoxx投資等級公司債券ETF	0.00%
MUB	iShares美國市政債券ETF	0.00%
BIV	Vanguard美國中期債券ETF	0.00%
TLT	iShares 20年期以上美國公債ETF	0.00%

Commodities **0.00%**

IAU	iShares黃金信託ETF	0.00%
-----	----------------	-------

歷史績效

未來績效

歷史累積報酬率

從 Jul 05, 2006 至今

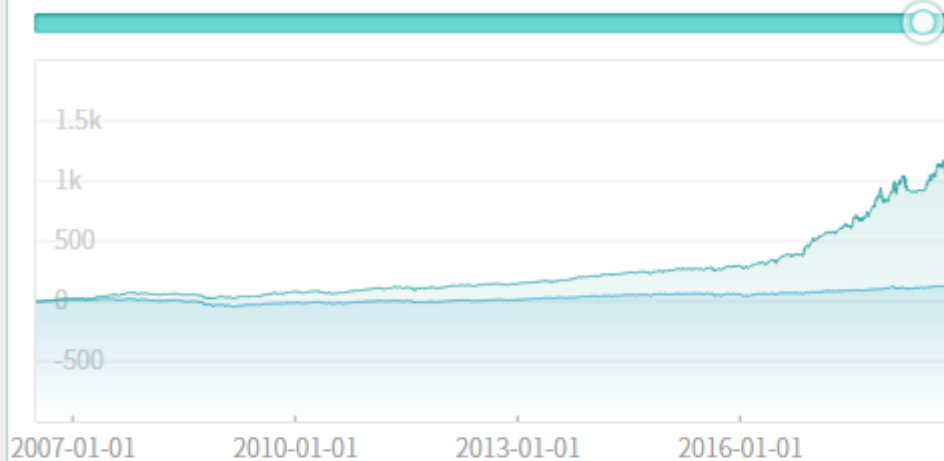
1個月

3個月

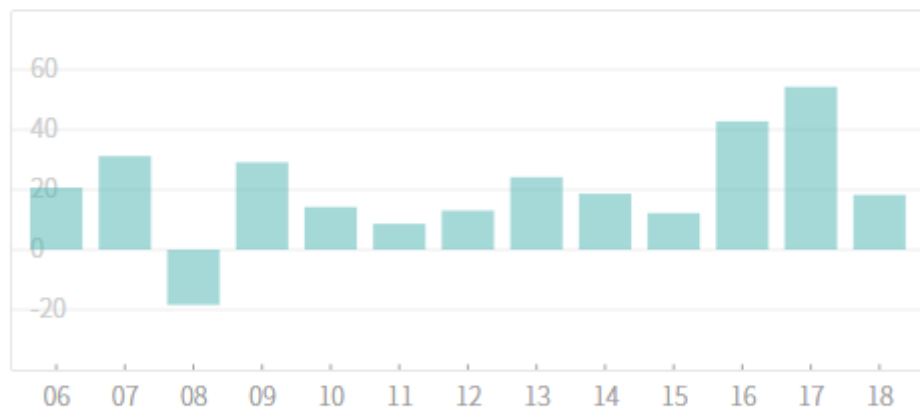
6個月

1年

整體



歷史年化報酬率



這組投資組合過去10年來的平均年報酬率為 **22.16%**，同期間 S&P500 指數平均年報酬率為 **7.26%**。

另外，此投資組合的波動率（通常用來衡量策略的風險程度）為 **15.88%**，相較之下 S&P500 的波動率為 **20.37%**。

以上數據說明了此投資組合將能夠產生比投資 S&P500 指數更為穩定的報酬。

*S&P500指數為挑選美國股市中500大企業的股價加權產生，一定程度上可反映整體市場情況。

歷史績效

未來績效

期初投資金額

\$ 10,000

每月固定投資金額

\$ 5,000



目標金額

\$ 100,000

需要多少年才能達到目標

1.26

從 2018 至 2047

5年

10年

15年

20年

30年

-- 投入本金 — 預期總投資價值 60%機率 90%機率

