Homework 2

Efficient Frontier

107B (5587) Investments　王傳鈞　0416047

注意事項

* 附件所夾帶之source code「HW2.jl」是在Julia-1.1.0環境之下編寫完成。
* 建議可直接查閱[GitHub](https://github.com/a2468834/Investment_Grad/tree/master/HW2)網址，獲得最詳細的資訊。
* 考慮到排版的因素，以下圖檔皆先由HW2.jl產生原始數據檔「Result.csv」，再匯入excel完成繪圖，並非直接產生自HW2.jl。
* 計算變異數和標準差之公式，分母皆為樣本數減一 (即)。

第一題

* 2013年6月到2018年6月共有61個月，再加上我們選了30檔股票標的，因此原始股價矩陣PriceMatrix是一個61x30的矩陣。
* 因為每兩筆股價資料才能產生出一筆報酬率數字，所以報酬率矩陣ReturnMatrix是一個60x30的矩陣。
* 因為ReturnMatrix使用word表格呈現會太大張，所以請參閱此網址。

Table 1 Expected Rate of Returns of 30 Stocks

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |

第二題

第三題

* 變異數

第四題