1. Requirement Analysis
2. 核心需求：给定不同资产的历史表现，给出最佳的资产配置比例。
3. 开发设计
4. 系统输入：资产个数，各个资产过去5年收益表现。

系统输出：资产配置比例。

1. 系统设计：
2. 模块一: 计算各资产预期收益率和所有资产预期协方差矩阵

输入：各资产历史收益数据

输出：各资产预期收益率和预期协方差矩阵

1. 模块二：根据马科维兹理论计算最佳资产配置比例。

输入：各资产预期收益率和预期协方差矩阵，以及当前的无风险收益率。

输出：各资产最佳配置比例

1. 模块三：数据回测，即回测五年，选择月度再平衡，测试资产配置的收益率。

输入：回测起始时间，再平衡频率，各个资产长期收益率。

输出：资产组合的收益率曲线。

1. 额外添加：

模块二-二：根据风险平价理论计算最佳资产配置比例。借鉴桥水的全天候策略，改进资产配置模型，继续回测。