

HW4

HW4 繳交時間:2019/5/17 中午 11:59 分。

ETF 評比績效理論實作：

- 請用檔案中的三篇論文作為評估 ETF 之指標的實作，評比指標如 A, B, C 三項：
 - 2009_JBF_Portfolio performance evaluation with generalized Sharpe ratios_ASKSR: 請用第 38 式
 - 2011_JBF_Omega performance measure and portfolio insurance: 請用第 8 式， L =無風險利率
 - 013_EL_A global index of riskiness: 請用 p.494 中之 $Q(g)$
- 請各組根據自己在 HW1 所分配到的 ETF，以及爬蟲程式，將所需的資料從網站(不限來源)扒下來後，用上述 A, B, C 三個評比指標來排列 ETF，用「週資料」及「月資料分析」，程式從 Now() 開始回溯至少三年資料，因此最後結果會有兩組 dataframe，分別如下(下圖排列僅為示意圖，非正確結果)：

週資料分析組

A 評比指標

Ranking	ETF_Symbol
1	IEF
2	GOVT
...	...

B 評比指標

Ranking	ETF_Symbol
1	GOVT
2	IEF
...	...

C 評比指標

Ranking	ETF_Symbol
1	IEF
2	SCHO
...	...

月資料分析組

A 評比指標

Ranking	ETF_Symbol
1	IEF
2	SCHO
...	...

B 評比指標

Ranking	ETF_Symbol
1	SCHO
2	IEF
...	...

C 評比指標

Ranking	ETF_Symbol
1	GOVT
2	SCHO
...	...

- 另外在在 GitHub README.md 上需要提供分析結果的解說，須包含下面兩項問題的回答
 - 週資料或月資料結果評比相似嗎？
 - 不同指標評比結果相似嗎？