作业题

本节作业设计45分钟完成, 共1题.

第1题 实验探究题

1. 假如用股票**价格**作协方差矩阵, 会出现什么结果?
2. 下载 “贵州茅台” 2019年8月和9月的股票收盘价, 如果不够42天, 从7月末补, 如果超过42天, 从9月末扣.
3. 将贵州茅台的股票收盘价拼在这50个股票的价格矩阵中, 用教学案例 (案例中是用日收益率求协方差矩阵) 绘制风险边界.
4. 如果第3题用**价格的**协方差矩阵, 会出现什么不一样的结果?
5. 用**价格**还是**日收益率**的协方差作为风险的测度, 求出来的投资组合权重, 分别是以什么为单位的? 如何理解金融计算中的量纲问题? 请完成300字以上的表述.

第1, 4题的结果图:

图片替换本行文字, 一行并排2幅图且排版紧凑.

第5题文字表述: