

Asset	Monthly Return Rates											
	1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12
1	0.004	-0.025	0.009	0.012	0.047	-0.019	0.006	-0.037	0.025	0.021	0.017	0.019
2	0.014	0	-0.039	0.016	-0.006	0.07	-0.021	-0.022	0.019	0.025	0.054	0.04
3	0.001	0.006	0.005	0.019	0.016	0.057	-0.052	0.027	0.039	0	0.011	0.002
4	-0.012	-0.021	0.062	0.036	-0.002	-0.038	0.015	-0.003	0.024	0.012	0.048	-0.007
5	-0.043	0.005	0.023	0	0.023	0.04	0.034	0.029	-0.013	-0.04	0.011	0.003
6	0.015	-0.027	-0.01	-0.027	0.002	0.038	0.056	-0.004	0.08	0.001	0.013	0.026
7	-0.001	0.011	0.056	-0.024	0.019	-0.048	-0.015	0.019	0.062	0.023	0.002	-0.017
8	0.039	0.03	0.003	-0.004	0.016	-0.021	0.003	0.018	-0.026	-0.022	0.026	0.073
9	0.017	0.02	-0.024	-0.004	0.019	0.039	-0.03	0.025	0.021	0.054	-0.011	0.056
10	0.108	-0.003	0.061	0.008	0.024	-0.037	-0.013	0.053	-0.009	-0.021	0.026	-0.009

Covariance Matrix

0.0005	6E-05	-1E-04	0.0003	-2E-04	0.0002	0.0002	-2E-05	-3E-05	-5.739E-05
6E-05	0.001	0.0004	-3E-04	-1E-04	0.0002	-5E-04	-6E-06	0.0004	-0.0005307
-1E-04	0.0004	0.0006	-2E-04	5E-05	3E-07	2E-05	-2E-04	0.0003	-0.0001005
0.0003	-3E-04	-2E-04	0.0008	-2E-05	-8E-05	0.0004	-1E-04	-5E-04	0.0002415
-2E-04	-1E-04	5E-05	-2E-05	0.0007	4E-05	-2E-04	-3E-05	-2E-04	-0.0002501
0.0002	0.0002	3E-07	-8E-05	4E-05	0.001	4E-05	-2E-04	3E-05	-0.0003845
0.0002	-5E-04	2E-05	0.0004	-2E-04	4E-05	0.0009	-2E-04	-1E-04	0.00035983
-2E-05	-6E-06	-2E-04	-1E-04	-3E-05	-2E-04	-2E-04	0.0008	9E-05	0.00041242
-3E-05	0.0004	0.0003	-5E-04	-2E-04	3E-05	-1E-04	9E-05	0.0007	-0.0003297
-6E-05	-5E-04	-1E-04	0.0002	-3E-04	-4E-04	0.0004	0.0004	-3E-04	0.00155956

Asset	Portfolio 1	Portfolio 2	Portfolio 3	Cx -1	Cx -2	Cx -3	Portfolio 1	Portfolio 2	Portfolio 3	
1	0	0.1	0	-3E-05	8E-05	1E-05	mean	\$ 1,516.67	\$ 1,084.17	\$ 1,268.33
2	0	0.1	0.2	0.0004	6E-05	0.0004	variance	7118055.56	581724.31	2409430.56
3	0	0.1	0.2	0.0003	8E-05	0.0002	sigma	\$ 2,667.97	\$ 762.71	\$ 1,552.23
4	0	0.1	0	-5E-04	5E-05	-2E-04	Value at Risk			
5	0	0.1	0	-2E-04	-3E-05	-6E-05				
6	0	0.1	0.2	3E-05	8E-05	0.0002				
							α	Portfolio 1	Portfolio 2	Portfolio 3

7	0	0.1	0
8	0	0.1	0.2
9	1	0.1	0.2
10	0	0.1	0

-1E-04	9E-05	-1E-04
9E-05	5E-05	9E-05
0.0007	3E-05	0.0003
-3E-04	9E-05	-2E-04

0.1	\$ 1,902.47	\$ (106.72)	\$ 720.93
0.2	\$ 728.75	\$ (442.25)	\$ 38.06
0.3	\$ (117.58)	\$ (684.20)	\$ (454.34)

return value	t-gk	max	t	0
- 65.83	-	-	AVAaR	#####
- 65.83	#####	-		
- 65.83	#####	-		
- 65.83	-	-		
- 65.83	-	-		
- 65.83	#####	-		
- 65.83	-	-		
- 65.83	#####	-		
##### 65.83	#####	#####		
- 65.83	-	-		

Average Value at Risk			
α	Portfolio 1	Portfolio 2	Portfolio 3
0.1	\$ -	\$ (65.83)	\$ -
0.2	\$ -	\$ (65.83)	\$ -
0.3	\$ -	\$ (65.83)	\$ -

Average returns

0.0066
0.0125
0.0109
0.0095
0.006
0.0136
0.0073
0.0113
0.0152
0.0157

Asset Portfolio 1

1	0
2	0
3	0
4	0
5	0
6	0
7	0
8	0
9	1
10	0

total 1

Amount Invested
100000

α	standard quantile
0.1	1.2816
0.2	0.8416
0.3	0.5244