

# 量化投资组合作业 1

孙健

复旦大学经济学院

2019 年 9 月 12 日

请各组独立完成下列作业。作业的递交形式为 Word 或者 PPT 形式。用累计收益图形、表格和文字的形式来解释你的发现和观点。

(1) 安装 Anaconda 3 版本到自己电脑。在 Spyder 环境下使用 Python。

(2) 各组下载下列日收盘数据（或者之一）

- (a) A 股指数收盘价
- (b) A 股指申万或者中信行业指数收盘价
- (c) 股指期货收盘价
- (d) 美股指数收盘价
- (e) 港股指数收盘价
- (f) 欧洲股市指数收盘价
- (g) 期货收盘价

使用这些数据计算日收益率。用这些日收益率计算出来收益率分布，同时比较和正态分布的区别。从日数据到周数据到月数据做同样的比较。

(3) 使用下载的 A 股数据试图做出基于周期性的择时策略。

(4) 下载宏观经济数据，比如 GDP、CPI、央行逆回购利率、SHIBOR 等，利用这些宏观数据和下载的 A 股数据试图做出基于宏观经济指标的择时或者是择行业策略。