第三章作业 资本投资决策模型

（在此处写上自己的姓名（学号））

投资专家向李先生推荐了平安银行(000001)、万科地产(000002)、深圳能源(000027)、航天科技(000901)和大族激光(002008)五只股票，其2013年1月至2014年3月的月收益率已在附件给出。请帮李先生做一个投资组合分析。

1. 求出风险最小的投资组合；
2. 在控制投资风险不超过某个水平（请自行确定）的前提下，找出使收益率最大的投资组合；
3. 在确保收益率不低于某个水平（请自行确定）的前提下，找出使风险最小的投资组合；
4. 求出不同水平的收益率下，使风险最小的有效组合，然后做出收益对风险的关系图；
5. 根据你的分析，请给李先生提几条建议。

**要求**：

1. 用Word撰写，回答部分另起新页，在Blackboard系统以附件形式提交电子版，文件名：姓名+学号，如：张三(2012000001).docx；
2. 正文字体一律用宋体五号；
3. 表格要符合统计表的规范（上下粗线，左右开口，标题在上面，黑体居中等）；
4. 图形要美观，要素完整齐全；
5. 数学公式、符号等要用公式编辑器，符合数学文本标准；
6. 逻辑完整：题号和解答要一一对应，要有解题的关键过程，答案要明确；
7. 作业要写上姓名、学号；
8. 独立完成，会系统查重，如果系统认定为抄袭，作业将按作弊处理。