

## 統計解析論特殊講義課題

- 1) 任意の日本株式5銘柄を選び直近6ヶ月の週次データを用いてCAPMモデルの推定を行え。リスクフリーレートは、10年物国債利率を週次変換して用いよ。また、市場ポートフォリオとしてTOPIXを用いよ。
- 2) 1月のロイターの報道によると、本年末の日経平均のコンセンサス予想の中央値は9975円である。2011年末終値は9975円であるので、コンセンサス予想による市場ポートフォリオの年次期待収益率は17.9%とすることができる。これをもとに、1)の5銘柄の期待収益率をCAPMモデルを用いて推定せよ。年次、週次収益率を求めよ。
- 3) それぞれの銘柄の収益率の標準偏差(週次)を、実際の株式データを求めよ。
- 4) 週次の期待収益率と収益率の標準偏差をもとに、平均-分散モデルで最適ポートフォリオを求めよ。

なお、提出はExcelファイルと、計算結果をレポートにまとめたワードファイルの両方をメールに添付して提出せよ。

メールアドレスはシラバス参照のこと。

期限：2012年2月14日23:59