

## 8.6 使用EXCEL条件求解工具构建投资组合（视频演示）

「保姆级视频教学」：  
本期视频主要演示「利用Excel工具」，  
根据投资品的历史净值数据计算投资品的回报率和波动性，即均值与方差。

如何计算由这些投资单品构成的「投资组合的」回报率和波动性。

使用「规划求解工具」构建投资组合并寻找有效前沿。

[本期科学投资相应视频：](#)

视频加载中...

[xss\_clean][xss\_clean]

☐ 晨光笔记2021

正值“间隔年”的500强职业经理人 +  
国家一级登山运动员，与您分享：【财务积累】干货 + 【户外旅行】攻略

☐

我们的工作主要分为「三步」：

- 「投资单品」的回报率和方差
- 「投资组合」的回报率和方差
- 求解「前沿曲线」

其中我们要用到「规划求解工具」

接下来让我们来看一下「实际的操作」吧。

[to be continued]

## 免责声明

本教程仅限于介绍

「[现代投资组合理论——均值方差](#)

[分析](#)」和演示「[Excel工具](#)」进行相应计算，不做任何投资建议。

- 涉及的任何数据都需谨慎验证
- 投资有风险，入市需谨慎
- 请在法定交易场所投资，远离非法交易活动

本文提及的任何内容均不构成

对投资产品的投资邀约，也不构成

对于任何证券的买卖或进行任何交易的投资建议。

在使用本文所载资料行事或受其影响之前，阁下应咨询独立专业意见。本文引用的原始数据亦可能存在错误，使用之前阁下应从权威数据库下载并咨询独立意见。

由于本文针对特定的读者，可能存在使用金融术语、数学概念不当，数学推导过程可能不完备的情况。