

如何用excel计算股票的var值-如何用excel算NPV-股识吧

一、求教如何用excel 分析股票投资组合

【IT168 专稿】投资组合优化问题是研究在满足某些要求的前提下，如何选择对象使得投资收益最大化或风险最小。

本文通过实例运用EXCEL的规划求解功能进行投资组合优化问题的分析。

例：宗民公司董事会决定将1000万资金进行债券投资。

经咨询，选择了四种较好的投资对象，分别为：宗民电器、晓民重工、终成药业、圣建银行。

它们的投资回报率如表1所示。

经过对各行业的调查与咨询，为减少风险，董事会决定，对电器业的投资不得超过300万；

对重工业的投资不得低于40%；

对药业的投资不得高于30%；

对银行业的投资不得低于200万。

宗民公司应该如何进行投资才能在满足董事会的要求下使得总收益最大？

解：运用EXCEL的规划求解进行投资组合优化分析的步骤如下：

一、根据题意，设置本问题的决策变量和目标函数 设：宗民公司对四种债券的投资额分别为： X_1 ， X_2 ， X_3 ， X_4 ，由表1及投资额变量可以得出总回报额 $Y = X_1 \times 3.70\% + X_2 \times 6.30\% + X_3 \times 4.20\% + X_4 \times 2.50\%$ 。

则本问题的目标函数为求 $\max Y$ 。

二、根据题意及决策变量与目标函数得出本问题的线性规划模型 目标函数： $\max Y = X_1 \times 3.70\% + X_2 \times 6.30\% + X_3 \times 4.20\% + X_4 \times 2.50\%$ 约束条件： $X_1 + X_2 + X_3 + X_4 \leq 1000$

（总投资额约束） $X_1 \leq 300$ （电器业投资约束） $X_2 \geq 400$ （重工业投资约束） $X_3 \leq 300$ （药业投资约束） $X_4 \geq 200$ （银行来投资约束） $X_1, X_2, X_3, X_4 \geq 0$

（决策变量非负约束）三、根据上述约束条件构建EXCEL模型，如下图

其中单元格C14：C17分别为决策变量 X_1 ， X_2 ， X_3 ， X_4 所在单元格；

C18单元格为实际投资资金总额所在单元格，其公式“=sum(C14:C17)”；

C19为目标函数总回报额所在单元格，其公式为“=sumproduct(C5:C8,C14:C17)”；

E14：E18为约束条件所在单元格，其公式略。

四、根据上述规划模型进行规划求解参数设置，如下图 五、规划求解结果 通过上表可以看出，在满足宗民公司董事会各项要求的前提下，投晓民重工800万、圣建银行200万为最优投资组合，总回报额最大为55.4万。

备注：如果债券市场环境和企业内部环境发生了变化，本题只需要把已知数据作一些修改就可以满足投资组合的动态优化决策分析需要。

二、excel 怎样计算净现值？

可用NPV函数来解决你的问题。

由于使用NPV函数评估投资计划的可行性的根据是当前的纯收益也就是现值是1种肯定投资利润的方法，1般情况下，当前纯利润收益大于零的任何投资都是有益可图的，NPV函数的功能是通过使用贴现率和1系列未来支出(负值)和收入(正值)，返回1项投资的净现值，NPV语法结构以下：NPV(rate, value1, value2, ...)

其中各项参数的含义以下。

rate为某1期间的贴现率，是1固定值。

value1, value2, . . . 为1—29个参数，代表支出及收入。

举例：假定有1投资计划，投资金额为250000元，第1年会亏损55000元，第2年回收95000元，第3年回收140000元，第4年回收185000元，贴现率为12%，评估的具体操作步骤以下。

步骤1：在工作表中建立数据：

在A1单元格输入文字：投资金额，在B1单元格输入数据：250000

在A2单元格输入文字：第1年收益，在B2单元格输入数据：55000

在A3单元格输入文字：第2年收益，在B3单元格输入数据：95000

在A4单元格输入文字：第3年收益，在B4单元格输入数据：140000

在A5单元格输入文字：第4年收益，在B5单元格输入数据：185000

在A6单元格输入文字：贴现率，在B6单元格输入数据：12%

在A7单元格输入文字：NPV现值，

步骤2：单击单元格B7，再在菜单栏上选择“插入→函数”命令。

步骤3：弹出“插入函数”对话框，在“或选择种别”下拉列表当选择“财务”选项，然后在“选择函数”列表框当选“NPV”选项。

步骤4：单击“肯定”按钮，在“函数参数”对话框中进行下面的设置：

Rate设置为：B6（贴现率）Valuel设置为：-B2（因是亏损支出所以是负数）value2

设置为：B25（因B2到B5这3年都是收益，所以不用每1年填写，用连续区域便可）

步骤5：单击“肯定”按钮，计算结果从B7单元格中显示出现值。

（256304.14）结论：由于NPV现值大于投资金额，因此这项目有投资的必要性。

三、表格excel怎样使用公式计算盈利／亏损值，其值=（股价一成本价）*股数。

很简单，你选择你任意“单元格”，按照“列”或者“行”为方向，作为数值和逻辑运算用的单元格。

举个例子就拿行，股票买卖盈利或亏算，是拿卖的比较买的所产生的资金来决定，其中包括:成本价（成本价有的地方也叫持仓价）、买入股数，卖出价、卖出股数。那么使用EXCEL任意4个单元格分别表示：a1格为成本价，b1格为买入股数，c1卖出价，d1卖出股数。

然后再使用一个单元格写函数公式，那就拿E1格吧公式这样写" $= (c1 \times d1) - (a1 \times b1)$ "这样就能完成你要知道的结果。

四、用excel怎么算净现值

先要弄清除初期投资在不在第一年内，如果在就直接用公式 $=NPV(8\%, -200000, 20000, 40000, 80000, 120000)$ 如果初期投资不在第一年内则 $=NPV(8\%, 20000, 40000, 8000, 120000) - 200000$

五、如何用Excel计算股票收益率

- 1、首先，用EXCEL在电脑上做一个模拟工作表，如下图所示。
 - 2、然后将A3单元格名称定义为“股息前股价”，如下图所示。
 - 3、同理，B3、A6、B6单元格分别定义为“股利前金额”、“现金股利”、“股票股利”。
 - 4、A9单元格的输入公式为“ $= (\text{股利前股票价格} - \text{现金股利} / 10) / (1 + \text{股票股利} / 10)$ ”。
 - 5、之前输入公式的细胞B9” $= \text{数量红利} + \text{数量前} / 10 \times \text{股票股息红利}$ ”。
 - 6、如下图所示，如果某只股票股利分配前的收盘价为28.88元/股，现金股利10的股利政策为1.50元，那么股利分配后和股利分配前的等价股价为28.73元/股。
- 如果除息日之后的开盘价低于这个价格，股票的价格就会下跌。

六、excel里函数中的VAR,VARA,VARP分别是计算什么的

VAR:计算基于给定样本的方差。

函数 VAR 假设其参数是样本总体中的一个样本。

VARA:计算基于给定样本的方差。

不仅数字，文本值和逻辑值（如 TRUE 和 FALSE）也将计算在内。函数 VARA 假设参数为总体的一个样本。

如果数据代表的是样本总体，则必须使用函数 VARPA 来计算方差。

VARP:计算基于整个样本总体的方差。

函数 VARP 假设其参数为样本总体。

如果数据只是代表样本总体中的一个样本，使用函数 VAR 计算方差。

七、如何用excel算NPV

有专门的函数：NPV请参阅通过使用贴现率以及一系列未来支出（负值）和收入（正值），返回一项投资的净现值。

语法NPV(rate,value1,value2,...)Rate 为某一期间的贴现率，是一固定值。

Value1, value2, ... 为 1 到 29 个参数，代表支出及收入。

Value1, value2, ...在时间上必须具有相等间隔，并且都发生在期末。

NPV 使用 Value1, Value2, ... 的顺序来解释现金流的顺序。

所以务必保证支出和收入的数额按正确的顺序输入。

如果参数为数值、空白单元格、逻辑值或数字的文本表达式，则都会计算在内；

如果参数是错误值或不能转化为数值的文本，则被忽略。

如果参数是一个数组或引用，则只计算其中的数字。

数组或引用中的空白单元格、逻辑值、文字及错误值将被忽略。

说明函数 NPV 假定投资开始于 value1

现金流所在日期的前一期，并结束于最后一笔现金流的当期。

函数 NPV 依据未来的现金流来进行计算。

如果第一笔现金流发生在第一个周期的期初，则第一笔现金必须添加到函数 NPV 的结果中，而不应包含在 values 参数中。

有关详细信息，请参阅下面的示例。

如果 n 是数值参数表中的现金流的次数，则 NPV 的公式如下：函数 NPV 与函数 PV（现值）相似。

PV 与 NPV 之间的主要差别在于：函数 PV 允许现金流在期初或期末开始。

与可变的 NPV 的现金流数值不同，PV

的每一笔现金流在整个投资中必须是固定的。

有关年金与财务函数的详细信息，请参阅函数 PV。

函数 NPV 与函数 IRR（内部收益率）也有关，函数 IRR 是使 NPV

等于零的比率： $NPV(IRR(...), ...) = 0$ 。

参考文档

[下载：如何用excel计算股票的var值.pdf](#)

[《当股票出现仙人指路后多久会拉升》](#)

[《股票st到摘帽需要多久》](#)

[《股票抛股要多久》](#)

[《股票除权除息日多久》](#)

[《股票转账多久到账》](#)

[下载：如何用excel计算股票的var值.doc](#)

[更多关于《如何用excel计算股票的var值》的文档...](#)

声明：

本文来自网络，不代表

【股识吧】立场，转载请注明出处：

<https://www.gupiaozhishiba.com/chapter/4280037.html>