

# 股票组合如何回测；如何用EXCEL做数据回测-股识吧

## 一、股票中的回抽怎么看？

回抽通常是指在股价向上（或向下）突破某个重要的阻力位后，再向下（或向上）小幅回调至原来的阻力位来确认上涨（或下跌）的基础是否有效

## 二、如何用EXCEL做数据回测

如果策略讲究实时性的，excel肯定是不行的。

如果仅仅对历史数据的回测，

大多数情况下excel够用了，而且excel附带的功能还是很强大的。

现在，好像很多人喜欢搞量化，

我个人觉得是量化过度了，量化要有严谨的逻辑依据，不要随便设定一些参数就开始拿历史数据回测，然后找个最理想的结果对应的参数集就认为模型是可行。

其实，量化最重要的是逻辑推理，要能从理论上论证模型的可行性。

股市投资不像自然界那么规律，投资是人性是多变的，

对历史数据回测出来的东西要时刻保持清醒，

尤其没有严谨推理的东西往往就是坏策略。

## 三、百度 某投资者将一只股票加入到某组合中，如该股票与拟加入组合有相同标准差，且两者相关系数小

你指的是某股票与某组合之间的协方差吧？协方差=AB两组变量的相关性系数 × A变量的标准差 × B变量的标准差

## 四、股票回测工具APP大家知道不？想使用软件。

手机上就能做回测的软件不多的，钱钱这方便还挺全面的

## 五、股票组合风险怎么算？急！

风险价值法(VAR)：VAR实际上是要回答在概率给定情况下，银行投资组合价值在下一阶段最多可能损失多少。

在风险管理的各种方法中，VAR方法最为引人注目。  
细节你看看网站内容。

## 参考文档

[下载：股票组合如何回测.pdf](#)

[《股票变成st后多久会被退市》](#)

[《股票开户后多久能拿到证》](#)

[《股票开户后多久能拿到证》](#)

[《买股票买多久可以赎回》](#)

[《小盘股票中签后多久上市》](#)

[下载：股票组合如何回测.doc](#)

[更多关于《股票组合如何回测》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/read/40970979.html>