

# 资产组合~最小方差组合 (excel)



gsd东

不再抱有任何的期望

+ 关注

10 人赞同了该文章

第一步：计算资产组合的协方差矩阵；

$$S = \frac{A^T * A}{M-1}$$

$$S = A^T * A / (M-1)$$

第二步：计算最小方差组合；

$$W = \frac{S^{-1} * 1_{\text{column}}}{1_{\text{column}}^T * S^{-1} * 1_{\text{column}}}$$

$$S^{-1} 1_{\text{column}} / (1_{\text{column}}^T * S^{-1} * 1_{\text{column}})$$