

使用EXCEL計算並繪製EMA指標

不寫代碼
用EXCEL做量化投資.

9 人贊同了該文章

在本文的底部，各位讀者可以獲取對應的EXCEL模板。

EMA指標計算非常簡單，但因為比較常用，所以單獨拿出來寫一下。

一、EMA（指數移動平均值Exponential Moving Average）的含義與原理

EMA是以指數式遞減加權的MA移動平均。

簡單的說，當要比較數值與均價的關係時，用MA指標就可以了，而要比較均價的趨勢快慢時，用EMA更穩定。

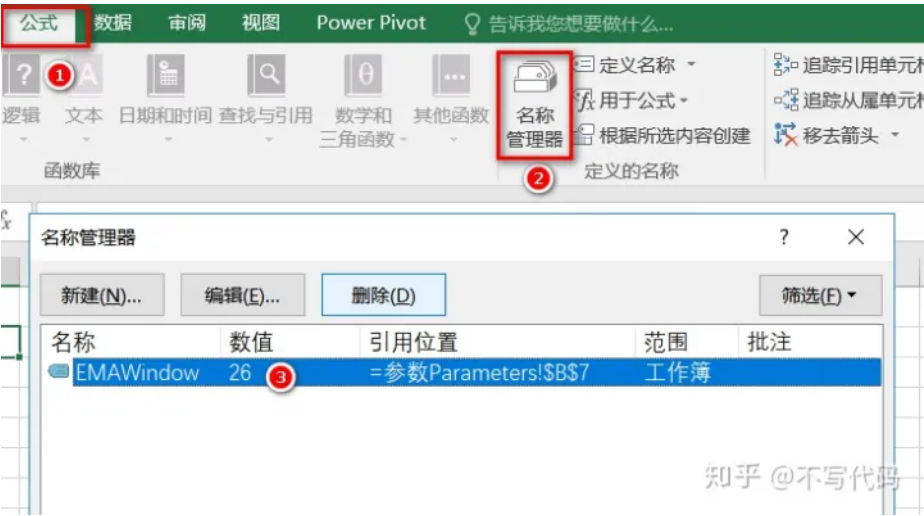
二、EXCEL中實現

EXCEL中，可以直接用金融函數庫插件快速的計算出EMA等指標。但為了便於理解，手工計算其實也很方便。

- 設置參數變量EMA Windows=26天

在EXCEL做量化的時候，我會經常用到設置變量參數，方便後面進行規劃求解和參數調優。

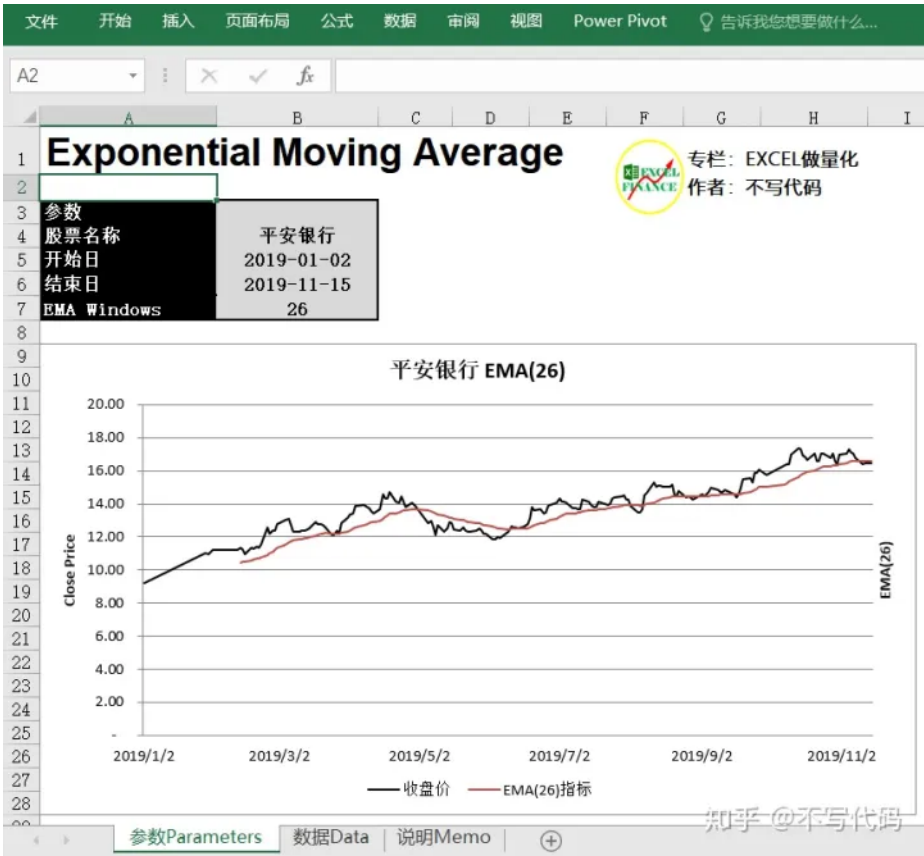
設置方式如下：



- 計算EMA(26)的公式如下：

	A	B	C	D	E	F	G	H
1	时间	收盘价	EMA1					
2	2019/1/2	9.19						
3	2019/1/3	9.28						
21	2019/1/29	11.00						
22	2019/1/30	10.95						
23	2019/1/31	11.10						
24	2019/2/1	11.20						
25	2019/2/11	11.21						
26	2019/2/12	11.19						
27	2019/2/13	11.38	10.416538					
28	2019/2/14	11.25	=B28*(2/(EMAWindow + 1)) + C27 * (1-(2/(EMAWindow+1)))					
29	2019/2/15	10.95	10.513219					
30	2019/2/18	11.36	10.575943					
31	2019/2/19	11.27	10.627355					
32	2019/2/20	11.41	10.685329					

• 步驟三：繪製EXCEL圖表。如下：



XLS文件模板可以在百度網盤中獲取。

鏈接: pan.baidu.com/s/1eYo87L...

提取碼: 9myw

歡迎關注我的知識星球：Excel量化投資

發佈於2019-11-29 10:37

Excel 使用

量化交易

量化

寫下你的評論...

2 條評論

默認 最新



胡蘿蔔頭子

網盤文件貼錯了吧，不是EMA的。我找了好久一直想用excel計算，盼修改後告訴我一聲，謝謝!!!

2020-08-05

👍 贊



慢調霽韻

沙發，是金子總會發光

2020-06-27

👍 贊

文章被以下專欄收錄



Excel做量化投資

推薦閱讀

一個簡單例子了解EM算法及其與極大似然估計的關係

01 欲知EM算法必知極大似然估計。EM算法在某種程度上是對極大似然估計的擴展，也就是知乎上有人說的“EM算法可以看成是特殊情況下計算極大似然的一種算法”。極大似然估計是在已知樣本服從...

周永

發表於爬蟲與數據...



Baidu Apollo代碼解析之EM Planner中的DP Speed...

席爾瓦...

發表於慢慢悠悠小...



Baidu Apollo代碼解析之EM Planner中的DP Path...

席爾瓦...

發表於慢慢悠悠...