

股票组合年复合收益率怎么计算 “复合年化收益率”是什么？-股识吧

一、什么是复合收益率？怎么计算？

1、基本的计算公式 B-S模型对欧式认购权证价格的计算公式为：其中：

C—认购权证初始的价格；

X—权证的行权价格；

S—标的证券的现价；

T—权证的有效期；

r—连续复利计算的无风险利率；

—市场波动率，即年度化的标准差；

$N(\cdot)$ —正态分布变量的累积概率分布函数。

2、B-S公式使用时的注意事项 通常，很多专业性的网站都提供权证定价计算的B-S模型计算器，投资者需要掌握的是如何正确输入其中的参数，做到正确的使用即可。

由于B—S模型中的X、S都比较容易取得，因此，正确使用B-S公式必须注意其它几个参数的选择：

第一，该模型中无风险利率必须是连续复利形式。

一个简单的或不连续的无风险利率(设为 r_0)一般是一年复利一次，而r要求利率连续复利。

r_0 必须转化为r方能代入上式计算。

两者换算关系为： $r = \ln(1+r_0)$ 或 $r_0 = e^r - 1$ 。

第二，期权有效期T应折合成成年数来表示，即期权有效天数与一年365天的比值。

如果期权有效期为183天，则 $T = 183/365 = 0.501$ 。

第三，对波动率的计算。

通常通过标的证券历史价格的波动情况进行估算。

基本计算方法为：先取该标的证券过往按时间顺序排好的 $n+1$ 个历史价格（价格之间的时间间隔应保持一致，如一天、一周、一月等）；

利用这一组数据计算 n 个连续复合收益率，计算公式为： $r = \ln[P(st)/P(st-1)]$

上述公式表示对时间间隔内的收益取自然对数，得到连续复合的收益率；

二、如何用excel公式计算股票投资组合收益率

年复合收益率就是指年复利计算的收益率。

复合收益率一般是按照一个周期来计算，年复合收益率的周期为一年。

年复合收益率的一般公式为：年复合收益率=(期末资金-期初资金)/期初资金。

B-S模型对欧式认购权证价格的计算公式为：其中：C-认购权证初始的价格；

X-权证的行权价格；

S-标的证券的现价；

T-权证的有效期；

r-连续复利计算的无风险利率；

-市场波动率，即年度化的标准差；

N(·)-正态分布变量的累积概率分布函数。

三、有关复合收益率计算的问题

$25.76 / (10 + 5 + 7) = 1.1709$ 复合收益率 17.09%

四、“复合年化收益率”是什么？

年复合收益率就是指年复利计算的收益率。

复合收益率一般是按照一个周期来计算，年复合收益率的周期为一年。

年复合收益率的一般公式为：年复合收益率=(期末资金-期初资金)/期初资金。

B-S模型对欧式认购权证价格的计算公式为：其中：C-认购权证初始的价格；

X-权证的行权价格；

S-标的证券的现价；

T-权证的有效期；

r-连续复利计算的无风险利率；

-市场波动率，即年度化的标准差；

N(·)-正态分布变量的累积概率分布函数。

五、如何计算年复合收益公式是什么呢？

展开全部本金100元 2022年 收益15% 2022年 收益 10% 2022年收益 16% 2022年收益

8% 2022年 收益 20%

六、投资组合收益率

成熟股投资收益率=0.1*2%+0.3*4%+0.4*10%+0.2*20%=9.4%
成长股投资收益率=0.1*-3%+0.3*3%+0.4*7%+0.2*10%=5.4%
两种股票组合投资收益率=50%*0.094+50%*0.054=0.074
成熟股方差=0.1*(9.4%-2%)^2+0.3*(9.4%-4%)^2+0.4*(9.4%-10%)^2+0.2*(9.4%-20%)^2=0.003684
成长股方差=0.1*[5.4%-(-3%)]^2+0.3*(5.4%-3%)^2+0.4*(5.4%-7%)^2+0.2*(5.4%-10%)^2=0.001404
两种股票的投资组合标准差=[50%*50%*0.003684+50%*50%*0.001404+2*50%*50%*(0.003684*0.001404)^(1/2)*0.89]^(1/2)=0.0478
注：两个投资组合方差=投资组合A比例的平方*投资组合A的方差+投资组合B比例的平方*投资组合B的方差+2*投资组合A比例*投资组合B比例*投资组合A的标准差*投资组合B的标准差*两种股票之间的相关系数

七、如何用excel公式计算股票投资组合收益率

用excel计算股票收益率的标准差方法如下：在a2：b5之间 则有两种方式
=stdevp(a2：a5，b2：b5)值是15.06% stdev：返回给定表达式中所有值的统计标准差
=stdev(a2：a5，b2：b5)值是16.10% stdevp：
返回给定表达式中所有值的填充统计标准差

八、如何计算股票的复合率？

你问的可能是复合增长率
复合增长率是一项投资在特定时期内的年度增长率
计算方法为总增长率百分比的n方根，n相等于有关时期内的年数
公式为：(现有价值/基础价值)^(1/年数) - 1
比如你05年1月1日投资10000，到06年1月1日资金是13000，07年1月1日是14000，08年1月1日19500则复合增长率是24.93%

参考文档

[下载：股票组合年复合收益率怎么计算.pdf](#)
[《持续阴跌的股票能忍耐多久不卖出》](#)

[《股票从20涨到40多久》](#)

[《一般股票持有多久才能赚钱》](#)

[下载：股票组合年复合收益率怎么计算.doc](#)

[更多关于《股票组合年复合收益率怎么计算》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/article/36518528.html>