

股票a和股票b的预期收益率是多少...该股票预期收益率为：-股识吧

一、股票a和股票b的期望收益率和标准差分别为多少

设市场收益率为 R_M ，无风险收益率为 R_F ，则 $13 = R_F + 0.8 * (R_M - R_F)$ $18 = R_F + 1.2 * (R_M - R_F)$ 解二元一次方程组，得 $R_M = 15.5%$ $R_F = 3%$ 同期，无风险利率为3%，市场组合收益率为15.5%

二、该股票预期收益率为：

$0.1 * 15% + 0.6 * 13% + 0.3 * 7% = 11.4%$ 选B

三、已知A股票的贝塔值和期望收益率，和B股票的贝塔值和期望收益率，怎样算无风险利率

$R_1 = R_f + \beta_1 * MP$ $R_2 = R_f + \beta_2 * MP$ 其中MP为market premium，即 $R_m - R_f$ ，作为整体考虑，无分解必要。

通过 $(R_1 - R_2) / (\beta_1 - \beta_2)$ 计算出MP将MP带入任何一式，均可解出 R_f

四、股票a和股票b的期望收益率和标准差分别为多少

这个是根据马科维茨的期望-方差资产组合模型来做选择的。

马科维茨模型有个基本假设，投资者都是风险厌恶的。

1、a的收益率和b的收益率相等，都是12%。

但是a的标准差小于c的标准差，说明a的风险小于c，所以a和c之间应该选择a。

2、b的收益率高于a，但是b的标准差大于a，说明b在享受高收益的同时，承受更大的风险。

所以，a与b之间的选择，就取决于投资者的风险偏好程度。

如果投资者能够承受较大风险去获取较多收益，就选择b。

如果投资者十分厌恶风险，更看重安全性，就回选择a。

五、58. 有A，B两只股票，A股票的预期收益率是15%，B股票的预期收益率为20%，A股票的标准差是0.04， ρ

预期收益率= $1/3*(-7\%)+1/3*12\%+1/3*28\%=11\%$

方差= $1/3[(-7\%-11\%)^2+(12\%-11\%)^2+(28\%-11\%)^2]=2.05\%$

标准差=14.3%(标准差为方差的开根，标准差的平方是方差)

六、假设市场只有两种股票A、B，其收益率标准差为0.25和0.6，与市场的相关系数分别为0.4和0.7，市场指数的平均

都是带公式的题嘛 (1) $A = A^* A / M = 0.4 * 0.25 / 0.1 = 1$ $B = B^* B / M = 0.7 * 0.6 / 0.1 = 4.2$ AB组合的 $= 0.5 * A + 0.5 * B = 2.6$ (2) $cov(A, B) = A^* B^* M^* M = 1 * 4.2 * 0.1 * 0.1 = 0.042$ (3) A股票预期收益率= $RF + A^* (RM - RF) = 5\% + 1 * (15\% - 5\%) = 15\%$ B股票预期收益率= $RF + B^* (RM - RF) = 5\% + 4.2 * (15\% - 5\%) = 47\%$ AB组合预期收益率= $0.5 * 15\% + 0.5 * 47\% = 31\%$

七、投资者预期当市场组合的收益率为6%时，A、B两支股票的收益率将是3%和8%，当市场组合的收益率为18%时，A、B

设两股票的 分别为 A和 B，无风险利率为5，则 $3 = 5 + A^*(6-5) + A$ $1) 8 = 5 + B^*(6-5) + B$ $2) 27 = 5 + A^*(18-5) + A$ $3) 15.2 = 5 + B^*(18-5) + B$ 4)由1)和3)解得， $A=2$ ， $A = -4\%$ 由2)和4)解得， $B=0.6$ ， $B = 2.4\%$ 第一第二问的 和 ，就求出来了。

若想构筑无风险套利，让AB股票构成的组合的 值为零，设A股票的权重为x，B的权重为1-x，则 $2x + 0.6(1-x) = 0$ 解得 $x = -3/7$ A股票的权重为-3/7，B股票权重为10/7A的权重为负值，是卖空。供参考。

八、有A，B两只股票，A股票的预期收益率是15%，B股票的预期收益率为20%，A股票的标准差是0.04，β值是1.2；B股

该股票的必要收益率应该是22.5%！答案补充 投资报酬率=无风险报酬率+风险报酬系数*风险程度本题就是必要收益率=8%+15%*1.5所以应该是22.5%

九、什么是股票预期收益率

预期收益率也称为期望收益率，是指在不确定的条件下，预测的某资产未来可实现的收益率。

参考文档

[下载：股票a和股票b的预期收益率是多少.pdf](#)

[《st股票摘帽最短多久》](#)

[《创业板股票转账要多久》](#)

[《股票跌了多久会回来》](#)

[《股票发债时间多久》](#)

[下载：股票a和股票b的预期收益率是多少.doc](#)

[更多关于《股票a和股票b的预期收益率是多少》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/38933404.html>