

## 怎么求股票的期望收益率和风险、你计划将1000000万美元投资于股票X、股票Y和无风险资产。你计划构造一个期望收益率为13.5%-股识吧

### 一、有分求助！关于证券投资组合期望收益率和无风险利率的计算

资本资产定价模型公式为 证券收益率=无风险收益率+贝塔值\*(市场收益率—无风险收益率) 根据此公式，联立方程组  $25\% = \text{无风险收益率} + 1.5 * (\text{市场收益率} - \text{无风险收益率})$   $15\% = \text{无风险收益率} + 0.9 * (\text{市场收益率} - \text{无风险收益率})$  解得：市场收益率=1/6 无风险收益率=0

### 二、怎样进行股票收益和规避风险的选择

止赢10%-30%与止损1%-5%

### 三、你计划将1000000万美元投资于股票X、股票Y和无风险资产。你计划构造一个期望收益率为13.5%

$31\%x + 20\%y + 7\%z = 13.5\%$   $x + y + z = 11.8x + 1.3y + z = 0.7(1.8x + 1.3y)$  求出x，乘以1000000w

### 四、股票，期望收益率，方差，均方差的计算公式

1、期望收益率计算公式：HPR=(期末价格-期初价格+现金股息)/期初价格例：A股票过去三年的收益率为3%、5%、4%，B股票在下一年有30%的概率收益率为10%，40%的概率收益率为5%，另30%的概率收益率为8%。

计算A、B两只股票下一年的预期收益率。

解：A股票的预期收益率 = (3% + 5% + 4%) / 3 = 4% B股票的预期收益率

= 10% × 30% + 5% × 40% + 8% × 30% = 7.4%2、在统计描述中，方差用来计算每一个变量（观察值）与总体均数之间的差异。

为避免出现离均差总和为零，离均差平方和受样本含量的影响，统计学采用平均离均差平方和来描述变量的变异程度。

扩展资料：1、协方差计算公式例： $X_i$  1.1 1.9 3， $Y_i$  5.0 10.4 14.6解： $E(X) = (1.1+1.9+3)/3=2$  $E(Y) = (5.0+10.4+14.6)/3=10$  $E(XY)=(1.1 \times 5.0+1.9 \times 10.4+3 \times 14.6)/3=23.02$  $Cov(X, Y)=E(XY)-E(X)E(Y)=23.02-2 \times 10=3.02$ 2、相关系数计算公式解：由上面的解题可求X、Y的相关系数为 $r(X, Y)=Cov(X, Y)/(\sigma_x \sigma_y)=3.02/(0.77 \times 3.93) = 0.9979$ 参考资料来源：股票百科-期望收益率参考资料来源：股票百科-协方差参考资料来源：股票百科-方差

## 五、如何计算股票的收益和风险

我理解你是想问购买股票的收益和风险。

股票收益的计算收益=(卖出价-买入价)/买入价\*100 (%) 其中卖出与买入价都应考虑交易费用。

收益可能为正即盈利，也可能为负即亏损。

股票风险的计算所谓风险通常是指不确定性，对购买股票来讲，可理解为买入股票后盈利的可能性(概率)的大小。

而个股的涨跌与很多因素有关，例如与管理层政策、市场供需、个股基本面、个股技术面等有关。

这样风险测算的难度就很大了。

不过也可以简化：例如很多技术流派，只跟踪趋势和成交量，这样风险度量就有股价涨跌概率=F(趋势、成交量)这样的关系了。

个人拙见，呵呵。

## 六、从同花顺软件里怎么计算史丹利股票期望收益率和风险

史丹利从月线周线来看 上方空间都很大 但是没有拉升的动能 下方有多根均线支撑，后期会逐渐震荡上行 明年开春会有一波反弹

七、投资学习题：股票提供的期望收益率为18%，标准差为22%。黄金提供的期望收益率为10%，标准差为30%。

- 1) 选择单一资产投资时，黄金由于收益率低，风险高，所以不会有人选择投资黄金。
- 2) 由于黄金与股票的相关系数为1（即完全正相关），黄金与股票的投资组合并不能抵消风险，所以投资组合中不会持有黄金。  
上述假设并不能代表证券市场的均衡，因为股票收益率更高，风险更小。

## 八、已知某股票的 $\beta$ 值为1.2，无风险收益率为6%，市场组合的期望收益率为16%，计算该股票的期望收益率。

期望收益率=无风险收益率 + 风险收益率  $R_i = R_f + \beta (R_m - R_f) = 6\% + 1.2 * (16\% - 6\%) = 18\%$   
其中  $R_m - R_f$  可以理解为市场组合平均风险收益率， $\beta$  为相对市场平均风险而言的风险系数。

## 参考文档

[下载：怎么求股票的期望收益率和风险.pdf](#)

[《股票要多久才能学会》](#)

[《股票违规停牌一般多久》](#)

[《股票转让后多久有消息》](#)

[下载：怎么求股票的期望收益率和风险.doc](#)

[更多关于《怎么求股票的期望收益率和风险》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/author/27137262.html>