

股票投资组合的收益率如何计算|两种股票，系数为2和1.2。风险报酬率为5%，投资组合的风险收益率为6%。计算投资组合的预期收益率。-股识吧

一、股票收益率怎么求

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、收益率怎么算

年名义收益率和年实际收益率的不同是由于年内分期按复利计算造成的，本提问中的年名义收益率就是一年的收益除以投资额， $(20 * 2) / 1000 = 4\%$ ，而年实际收益率是按复利计算的，从提问中知道半年的收益率为2%，则年实际收益率等于 $(1 + 2\%)^2 - 1 = 4.4\%$ ，则年实际收益率高出年名义收益率0.4%

三、有分求助！关于证券投资基金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

四、请教各位：如何运用三因素模型的组合收益率，来计算

您好运用三因素模型的组合收益率根本没有办法计算的，建议您现在做股票要快进快出，不要做中长线为好，因为现在的股票市场很不稳定，今天是超跌反弹，明天

就是一次大跌，我国的股市已经进入下跌行情，加上诸多经济问题，股票市场今年几乎不会有好的机会了，作为理财师我的经验告诉我，估计下星期还会下跌，所以您要注意资金安全，有什么问题可以继续问我，真诚回答，恳请您采纳！

五、股票估值中市场组合的预期收益率是怎么取值的？

你是说资本资产定价模型吗？CAPM。

你说的这个问题我从前也思考过。

我的一些结论：（1）CAPM模型的目的是评估风险，市场的预期收益实际是为了带入公式后计算单个资产的风险的。

（为了贴现估值时作为贴现率用）（2）从公式可以知道，其他条件不变，市场预期收益率越低，计算出的单个资产风险越小。

（3）仔细思考可得，实际上市场收益率的确定取决于投资者自己的风险偏好和该投资项目的一般预期回报和风险。

（4）我觉得如下几种取值比较合理：

A，取市场的长期收益率的几何平均值，中国股市大约是16%-17%。

B，用无风险收益率+风险溢价（无风险收益率取当下的5年期国债收益率，风险溢价可以用市场平均偏差和其他主观因素调整）

顺便说一下这其中在实践中的难点。

因为中国股市在过去20年中是高波动的，所以你算出来的贴现率可能非常大，这个在实践中是有问题的。

巴菲特在估值的时候他是直接用无风险收益率，因为他认为他选的股风险小。

六、两种股票，系数为2和1.2。风险报酬率为5%，投资组合的风险收益率为6%。计算投资组合的预期收益率。

展开全部这个题从现有条件看没法计算。

首先不知道无风险收益率。

另外如果组合的风险收益率为6%，市场风险报酬率为5%，则组合的系数=1.2，两种股票最低的系数都为1.2，所以推导组合中只有乙股票，没有甲股票。

但由于不知道无风险收益率，所以还是没法计算。

-----个人意见

七、股票收益率怎么求

你想知道谁的收益率？如果是数据中每天的收益率，就是最后一项的涨跌幅。如果是买卖收益率，就是：卖出获得的钱 ÷ 买入花的钱 - 1 = 股票买卖的收益率以此类推谢谢你的提问

八、投资收益率怎么算的？

投资收益率 = 投资收益 / 投资成本 × 100%

九、两种股票，系数为2和1.2。无风险报酬率为5%，投资组合的风险收益率为6%。计算投资组合的预期收益率

$E(R) = R_f + \beta * [E(R) - R_f]$ // 预期收益等于无风险收益加上风险溢价 = 5% + $\beta * 6%$ 其中， $\beta(\text{portfolio}) = w_a * \beta_a + w_b * \beta_b$ // 投资组合的 β 等于每种资产的 β 按照其市值权重累加之和lz的题目里没有给出两种股票的价值权重 w_a ， w_b 。

如果我们假定投资组合中两种股票的市值相等， $w_a = w_b = 0.5$ ，则 $E(R) = 5\% + (0.5 * 2 + 0.5 * 1.2) * 6\% = 14.6\%$

参考文档

[下载：股票投资组合的收益率如何计算.pdf](#)

[《唯赛勃的股票多久可以买》](#)

[《只要钱多久能让股票不下跌吗》](#)

[《股票要多久才能学会》](#)

[《股票停牌多久下市》](#)

[下载：股票投资组合的收益率如何计算.doc](#)

[更多关于《股票投资组合的收益率如何计算》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/author/41170757.html>