

## 股票组合的风险报酬率怎么计算-《风险报酬率》的计算公式是什么？-股识吧

### 一、第三题 风险报酬怎么算？

投资报酬率=风险报酬率+无风险报酬率  
风险报酬率=风险报酬系数X标准离差率  
标准离差率=标准差/期望报酬率  
1、 风险报酬率=0.5X1.2%/15%=0.04=4%  
2、 风险报酬额=投资额X风险报酬率=200X4%=8万元  
3、 投资报酬率=风险报酬率+无风险报酬率=4%+8%=12%  
投资报酬总额为150万元，无风险报酬额=150X8%/12%=100万元  
风险报酬额=150X4%/12%=50万元  
个人观点，仅供参考。

### 二、市场风险报酬概率如何计算

所谓风险报酬率是指投资者因冒风险进行投资而获得的超过时间价值率的那部分额外报酬率，即风险报酬额与原报酬额的比率。

在财务管理中，风险报酬通常用相对数——风险报酬率来表示，讲到风险报酬，一般是指风险报酬率。

### 三、怎么计算股票的投资风险率和投资回报率

风险率是个坑， $风险率 = \frac{可投资总金额}{投资金额}$ 。  
回报率，是指以前的收益率=（股票的卖价-买价）/买价如果是学金融的。

回报率=（股票的卖价-买价）/（（银行的税率+1）\*买价）  
具体要看怎么定义本金的内容。

- 。
- 。
- 。

## 四、风险报酬率的计算公式

最低0.27元开通文库会员，查看完整内容>

原发布者：度米文库  
风险计算公式【篇一：风险计算公式】常用的风险分析方法有两种：矩阵法和相乘法。

1.矩阵法  
矩阵法的概念： $z=f(x, y)$ 。

函数f采用矩阵形式表示。

以要素x和要素y的取值构建一个二维矩阵，矩阵内mn个值即为要素z的取值。矩阵法的适用范围：矩阵法主要适用于由两个要素值确定一个要素值的情形。

在风险值计算中，通常需要对两个要素确定的另一个要素值进行计算，例如由威胁和脆弱性确定安全事件发生可能性值、由资产和脆弱性确定安全事件的损失值等，同时需要整体掌握风险值的确定，因此矩阵法在风险分析中得到广泛采用。

矩阵法的构造方式：首先需要确定二维计算矩阵，矩阵内各个要素的值根据具体情况和函数递增情况采用数学方法确定，然后将两个元素的值在矩阵中进行比对，行列交叉处即为所确定的计算结果。

矩阵的计算需要根据实际情况确定，矩阵内值的计算不一定遵循统一的计算公式，但必须具有统一的增减趋势，即如果是递增函数，z值应随着x与y的值递增，反之亦然。

矩阵法的特点：矩阵法的特点在于通过构造两两要素计算矩阵，可以清晰罗列要素的变化趋势，具备良好的灵活性。

矩阵法风险计算过程：I计算安全事件发生可能性（1）构建安全事件发生可能性矩阵；

（2）根据威胁发生频率值和脆弱性严重程度值在矩阵中进行对照，确定安全事件发生可能性值；

（3）对计算得到的安全风险事件发生可能性进行等级划分。

II计算安全事件的损失（1）构建安全事件损失矩阵；

（2）根据资产价值和脆弱性严重程度值在

## 五、《风险报酬率》的计算公式是什么？

1、风险报酬率的计算公式： $K_R = \eta \times V$ ；

其中：KR表示风险报酬率；

$\eta$ 表示风险报酬系数；

V表示标准离差率。

2、beta，普遍认为是“测试”的意思。

Beta是希腊字母中的第二个字母，在软件开发中指软件测试的第二阶段，由将来

用户中的一部分人试用。

Beta测试也指产品推出前的测试，软件商把beta测试版软件在网上发放给更多的用户进行实用测试为以后版本的出台做准备。

《TIMES》由印刷商约翰·沃尔特(John Walter)于1785年1月1日在伦敦创刊，是一张历史悠久、经历曲折的报纸。原名《每日天下纪闻》(The Daily Universal Register)，1788年1月1日起改用现名。

## 六、股票风险溢价怎么计算？

风险率是个坑， $\text{风险率} = \text{可投资总金额} / \text{投资金额} \cdot \text{回报率}$ ，是指以前的收益率 = (股票的卖价 - 买价) / 买价如果是学金融的。

$\text{回报率} = (\text{股票的卖价} - \text{买价}) / ((\text{银行的税率} + 1) * \text{买价})$ 具体要看怎么定义本金的内容。

- 。
- 。
- 。

## 七、2. (10分) 假定无风险报酬率为6%，市场投资组合的风险报酬率为10%，而股票A的贝它系数为1.5。

(1) 若下年度的预期股利为2.0元，且股利成长率固定为每年4%，则股票的价值是多少？ $6\% + 1.5 \times$

$(10\% - 6\%) = 12\%$  股票A的价格 =  $2 / (12\% - 4\%) = 25$  (元) (2) 若A公司改变经营策略，使该公司的固定股利增长率由4%上升到6%，而贝他系数也由1.5下降到1，此时股票的市场价格是35元，是否应该购买？你是如何决策的？ $6\% + 1 \times (10\% - 6\%) = 10\%$  股票A的价格 =  $2 / (10\% - 6\%) = 50$  (元)

## 八、股票风险溢价怎么计算？

风险溢价计算公式：有风险的投资工具的报酬率与无风险报酬率的差额，风险溢价指的是投资人要求较高的收益以抵消更大的风险，而风险溢价是金融经济学的一个

核心概念，对资产选择的决策，资本成本以及经济增值(EVA)的估计具有非常重要的

## 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 $\beta$ 等于每种资产的 $\beta$ 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：股票组合的风险报酬率怎么计算.pdf](#)

[《华东科技为什么股票天天阴跌破净》](#)

[《炒股首先会什么意思》](#)

[《融深股通11是什么意思》](#)

[下载：股票组合的风险报酬率怎么计算.doc](#)

[更多关于《股票组合的风险报酬率怎么计算》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/book/68041750.html>