

# 股票收益概率怎么组合收益概率和亏损概率公式分别是什么-股识吧

一、假设市场投资组合的收益率和方差分别为12%和0.25，无风险收益率为8%，A股票收益率的方差为0.16

$COV(K_a, K_m) = r \cdot \sigma_a \cdot \sigma_m = 0.4 \cdot (0.16^{0.5}) \cdot (0.25^{0.5}) = 0.4 \cdot 0.4 \cdot 0.5 = 0.08$ ， $COV(K_a, K_m)$  是A股票收益与市场投资组合收益之间的协方差， $r$ 是两者的相关系数， $\sigma_a$ 是A股票收益的标准差， $\sigma_m$ 是市场投资组合收益的标准差  $\sigma_a = COV(K_a, K_m) / (\sigma_a)^2 = 0.08 / 0.16 = 0.5$ ，A股票的贝塔系数是0.5  
 A股票要求收益率=无风险收益率+（市场投资组合收益率-无风险收益率）\*贝塔系数=8%+（12%-8%）\*0.5=10%

## 二、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

三、股票A,B,C,D,收益率为5%,8%,2%,10%,投资比例为10%,35%,5%,50%,求证券组合的期望收益率?

$5\% \cdot 10\% + 8\% \cdot 35\% + 2\% \cdot 5\% + 10\% \cdot 50\% = 8.4\%$

四、假设市场投资组合的收益率和方差分别为12%和0.25，无风

## 险收益率为8%，A股票收益率的方差为0.16

技术面的概率基本都是50%左右技术面中的量价配合成功率80%成功率最高的是基本面的研究这要有一定的专业基础才行请关注：财经世界网

## 五、证券投资组合的概率怎么算

技术面的概率基本都是50%左右技术面中的量价配合成功率80%成功率最高的是基本面的研究这要有一定的专业基础才行请关注：财经世界网

## 六、收益概率和亏损概率公式分别是什么

条件概率题，因为公司亏损的概率是 $0.55 \times 0.1 + 0.45 \times 0.75 = 0.3925$ 而其中，升值后亏损的概率是 $0.55 \times 0.1 = 0.055$ 应用条件概率公式股价年底升值的概率 $= 0.055 / 0.3925 = 0.14$

## 七、股票收益的期望和标准差计算。

听了我这段做股票的心得，你一定有很大的收获。

我觉得做股票吧，首先，心态要好，创造财富也得有好心情。

中国的股市，波段操作的赢利范围和可行性最大，另外，选取的个股，也必须跟随主力的动向，这样就不会让自己的资金冒险。

为了把握最理想的买卖点，必须有主力的带动和证券技术部门的老师指引去操作，这样才能达到在股市中长期的稳定赢利。

下面我给大家推荐一位在股市中比较资深的操盘老师，主要的实战操作，才能让我们信服，这位老师的操作平台资料就在我的空间里，相信自己的眼光，关注一段时间后，你会发现，做股票，这才叫实力！

## 八、如何通过构建投资组合提高自己的投资收益率

一、不同背景平台组合如果全投背景平台，收益可能会偏低，全投民营平台风险又

偏高，这种情况下，可以取个折中的办法，一半背景平台，一半民营平台是个平衡点；

如果个人风险承受能力偏低，可以再调节成七分背景，三分民营平台，甚至可以调到82开。

具体看个人情况上下浮动。

国资系、上市系、风投系、民营系，均衡配置一部分，整体效果往往都比只配制某一种单一背景的平台强。

二、不同类型产品的组合目前新政出台了限制借款的上线后，网贷产品总体是要往小额分散的类型上面靠。

目前小额分散的产品，主要就是抵押物充足的车贷、部分地方的房贷、小额信贷、三农贷款、消费金融贷款、这几个里面往往都是以小微借贷为主。

企业贷、供应链、房产公司借款等模式容易出现大单，后面这几种暂时就尽量不要去分散，应该是多往前面几者去分散。

每一块都应该有很广阔的市场。

未来车贷这一块，破万亿的待收，三农信贷过5000万待收应该问题都不大，还有目前年轻人所向往的提前消费、提前享受的消费金融贷款这一领域，未来的前景估计会更大。

时代在改变，不同年代的人观念也在改变，P2P这一块是完全有能力满足部分人提前消费需求。

但目前整个P2P行业的待收，也就刚过7000亿，所有还有很大的市场等着大家去开发。

三、不同利率的平台组合在信息完全对称后，高一分利率，注定就会高一分的风险。

虽然说低利率不一定低风险，但是高利率注定就是高风险，在这两年投资人、借款人、平台的信息越来越对称的条件下，要想寻找不对称，风险还高的高息平台，是越来越困难的，前些年由于行业处于萌芽期，很多信息很不对称，能找到收益高，风险不太高的平台，但如果投资人不改变观念，还追寻追高息，其实是在走钢丝绳的路上越走越远。

对绝大多数普通投资人来说，都应该放弃追高息的理念。

就目前来说，给投资人综合利率在8-15%之间，是有可持续盈利能力的。

投资人也可以在8-15%利率平台之间，适当分散一些平台，风险承受能力低的，就往收益低平台靠拢，反之往偏高的平台靠，适当分散配置。

## 参考文档

[下载：股票收益概率怎么组合.pdf](#)

[《上市股票中签后多久可以卖》](#)

[《一个股票在手里最多能呆多久》](#)

[《股票涨30%需要多久》](#)

[《小盘股票中签后多久上市》](#)

[《股票流通股多久可以卖》](#)

[下载：股票收益概率怎么组合.doc](#)

[更多关于《股票收益概率怎么组合》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/chapter/12640556.html>