

# 计算两种股票的期望报酬率怎么算、股票，期望收益率，方差，均方差的计算公式-股识吧

## 一、必要报酬率和期望报酬率的公式分别是什么?\_?

必要报酬率计算公式：必要报酬率=上年累计未分配利润+本年全年实现净利润-本年已分配利润  
本年已分配利润=被没收财产损失和违反税法的滞纳金及罚款+弥补以前年度亏损+提取盈余公积和法定公益金+分配给投资者的利润。

期望报酬率计算公式：期望报酬率=经营收入-经营费用-生产性固定资产折旧-生产税+出租房屋净收入、出租其他资产净收入和自有住房折算净租金等。

财产净收入不包括转让资产所有权的溢价所得。

人均可支配收入实际增长率=

(报告期人均可支配收入/基期人均可支配收入)/居民消费价格指数-100%。

扩展资料：必要报酬率的作用：(一)制定安全生产发展规划，建立和完善安全生产指标及控制体系；

- (二)加强行业管理，修订行业安全标准和规程；
- (三)增加安全投入，扶持重点煤矿治理瓦斯等重大隐患；
- (四)推动安全科技进步，落实项目、资金；
- (五)研究出台经济政策，建立、完善经济调控手段；
- (六)加强教育培训，规范煤矿招工和劳动管理；
- (七)加快立法工作；
- (八)建立安全生产激励约束机制。

期望报酬率的作用：(一)建立、健全安全生产责任制，制定完备的安全生产规章制度和操作规程；

- (二)安全投入符合安全生产要求；
- (三)设置安全生产管理机构，配备专职安全生产管理人员；
- (四)主要负责人和安全生产管理人员经考核合格；
- (五)特种作业人员经有关业务主管部门考核合格，取得特种作业操作资格证书；
- (六)从业人员经安全生产教育和培训合格；
- (七)依法参加工伤保险，为从业人员缴纳保险费；
- (八)厂房、作业场所和安全设施、设备、工艺符合有关安全生产法律、法规、标准和规程的要求。

参考资料来源：百科-必要报酬率 百科-期望报酬率

## 二、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： $HPR = (\text{期末价格} - \text{期初价格} + \text{现金股息}) / \text{期初价格}$ 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

=  $10\% \times 30\% + 5\% \times 40\% + 8\% \times 30\% = 7.4\%$ 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 $r(X, Y)=Cov(X, Y)/(\sigma_x \sigma_y)=3.02/(0.77 \times 3.93) = 0.9$

979参考资料来源：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

### 三、股票预期报酬率怎么计算？

$(23+1)-20/20=20\%$ 股利为每股1元都是给现金

相当你24元卖出股票股利增长率为6%就是你获利的3元钱这里没有算交易税！

### 四、投资组合的期望收益率如何计算？

期望收益率，又称为持有期收益率（hpr）指投资者持有一种理财产品或投资组合期望在下一个时期所能获得的收益率。

这仅仅是一种期望值，实际收益很可能偏离期望收益。

计算公式： $hpr = (\text{期末价格} - \text{期初价格} + \text{现金股息}) / \text{期初价格}$

### 五、股票期望收益率如何计算？

股票的预期收益率 $E(R_i) = R_f + [E(R_m) - R_f]$  其中： $R_f$ ：

无风险收益率-----一般用国债收益率来衡量

$E(R_m)$ ：市场投资组合的预期收益率  $i$ ：投资的 值-----市场投资组合的

值永远等于1，风险大于平均资产的投资 值大于1，反之小于1，无风险投资价值等于0

## 六、如何确定某种股票的期望报酬率

假定投资者将无风险的资产和一个风险证券组合再构成一个新的证券组合，投资者可以在资本市场上将以不变的无风险的资产报酬率借入或贷出资金。

在这种情况下，如何计算新的证券组合的期望报酬率和标准差？假设投资于风险证券组合的比例（投资风险证券组合的资金/自有资金）为Q，那么1-Q为投资于无风险资产的比例。

无风险资产报酬率和标准差分别用 $r_{无}$ 、 $\sigma_{无}$ 表示，风险证券组合报酬率和标准差分别用 $r_{风}$ 、 $\sigma_{风}$ 表示，因为无风险资产报酬率是不变的，所以其标准差应等于0，而无风险的报酬率和风险证券组合的报酬率不存在相关性，即相关系数等于0。

那么新的证券组合的期望报酬率和标准差公式分别为： $r_P = Qr_{风} + (1-Q)r_{无}$

## 七、已知2支股票的期望报酬率 与市场的相关系数 贝塔值 标准离差，怎么求市场组合的期望报酬率

列两个CAPM的等式，求解 $R_f$ 和 $R_m$ 就可以了：股票的期望报酬率=无风险利率+Beta\*(市场期望报酬率-无风险利率)

## 八、股票的预期收益率和方差怎么算

具体我也不太清楚，所以帮你搜了一下，转发给你看，希望能帮到你！例子：上面两个资产的预期收益率和风险根据前面所述均值和方差的公式可以计算如下：1。

股票基金 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)2。

债券基金 预期收益率= $1/3*(17\%)+1/3*7\%+1/3*(-3\%)=7\%$

方差= $1/3[(17\%-7\%)^2+(7\%-7\%)^2+(-3\%-7\%)^2]=0.67\%$

标准差=8.2%注意到，股票基金的预期收益率和风险均高于债券基金。

然后我们来看股票基金和债券基金各占百分之五十的投资组合如何平衡风险和收益

。投资组合的预期收益率和方差也可根据以上方法算出，先算出投资组合在三种经济状态下的预期收益率，如下：萧条： $50\% \times (-7\%) + 50\% \times 17\% = 5\%$

正常： $50\% \times (12\%) + 50\% \times 7\% = 9.5\%$  繁荣： $50\% \times (28\%) + 50\% \times (-3\%) = 12.5\%$  则该投资组合的预期收益率为： $1/3 \times 5\% + 1/3 \times 9.5\% + 1/3 \times 12.5\% = 9\%$  该投资组合的方差为： $1/3[(5\% - 9\%)^2 + (9.5\% - 9\%)^2 + (12.5\% - 9\%)^2] = 0.001\%$  该投资组合的标准差为： $3.08\%$  注意到，其中由于分散投资带来的风险的降低。

一个权重平均的组合（股票和债券各占百分之五十）的风险比单独的股票或债券的风险都要低。

投资组合的风险主要是由资产之间的相互关系的协方差决定的，这是投资组合能够降低风险的主要原因。

相关系数决定了两种资产的关系。

相关性越低，越有可能降低风险。

## 参考文档

[下载：计算两种股票的期望报酬率怎么算.pdf](#)

[《大冶特钢股票停牌一般多久》](#)

[《股票账户重置密码多久生效》](#)

[《股票涨30%需要多久》](#)

[《股票实盘一般持多久》](#)

[下载：计算两种股票的期望报酬率怎么算.doc](#)

[更多关于《计算两种股票的期望报酬率怎么算》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/chapter/28149747.html>