怎么计算股票组合的系数值—请问在知道一个股票组合中三只股票的β系数和他们所占的比例的情况向，如何算出这个股票组合的β系数。-股识吧

一、请问在知道一个股票组合中三只股票的β系数和他们所占的比例的情况向，如何算出这个股票组合的β系数。

用各自的β系数乘以各自的资金所占百分比，再求和即可。
证券之星问股

二、两种股票，β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

投资组合的贝塔是各个股票的贝塔的加权平均，具体地投资组合贝塔=1×20%+20×10%+91×30%+52×40%=50.3你再核对一下四个股票的贝塔，怎么会到20、91、52这么大？一般来说，贝塔大于2就算是波动很大的股票了。
计算方法同上，供参考。

三、两种股票，β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) = Rf + beta * [E(R)-Rf] // 预期收益等于无风险收益加上风险溢价= 5% + beta * 6% 其中，beta(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%

四、投资组合的贝塔值计算

投资组合的贝塔是各个股票的贝塔的加权平均，具体地投资组合贝塔=1×20%+20×10%+91×30%+52×40%=50.3你再核对一下四个股票的贝塔，怎么会到20、91、52这么大？一般来说，贝塔大于2就算是波动很大的股票了。
计算方法同上，供参考。

五、请问股票指数基金投资组合分配比例是怎么计算出的？基金新人

是按你投资债券基金（或股票基金）占总投资的比例来算的。
比如你拿出10万购买基金，其中3万买债券基金，7万买股票基金，那么投资比例就是“ 30%的债券指数基金和70%的股票指数基金 ”。
基金按投资风险大小共分为四种，货币性、债券型、混合型、股票型，这四种基金的风险是依次增大的，收益与风险一般是成正比。
也就是货币基金风险最小，收益也最小。
股票基金风险最大，收益也最大。
按你说的“ 30%的债券指数基金和70%的股票指数基金 ”投资比例来看，股票基金比例偏高，风险很高，适合稳健型或成长型基民。

参考文档

下载：怎么计算股票组合的系数值.pdf
《一般股票持有多久才能赚钱》
《吉林银行股票多久上市》
《股票交易后多久能上市》
《股票变st多久能退市》
《股票st到摘帽需要多久》
下载：怎么计算股票组合的系数值.doc
更多关于《怎么计算股票组合的系数值》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/36376081.html