

三种股票投资组合月度收益率是多少某人投资三只股票，组成一证券组合，经多方分析他认为三只股票的收益率分别是25%、10%、30%，-股识吧

一、某公司的投资组合中有三种股票，所占比例分别为50%，30%，20%，系数分别为0.8，1.0，1.2；

第一种股票必要收益率=6%+0.8\*(11%-6%)=10%第二种股票必要收益率=11%第三种股票必要收益率=6%+1.2(11%-6%)=12%该投资组合的必要收益率=50%\*10%+30%\*11%+20%\*12%=10.7%

## 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、某人投资三只股票，组成一证券组合，经多方分析他认为三只股票的收益率分别是25%、10%、30%，

$(0.4*0.25+0.3*0.1+0.3*0.1)/1=16%$ 供参考

四、某人投资三种股票，这三只股票年预期收益率分别为A15%，B10%，C5%！投资比例为A0.5，B0.3，C0.2！

设本金为D，投入的资金分别为A：0.5D B：0.3D C：0.2D总收益为： $0.5D*15\%+0.3D*10\%+0.2D*5\%=D*11.5\%$ 组合投资收益率为： $D*11.5\%/D=11.5\%$

**五、就是选三只股票，给定权重1/3，2/3，求任意组合的收益率和标准差，哪位大神告诉我计算公式是啥。**

你说明不是很清楚，大概意思是不是将资金持股分成1/3和2/3，各买一种股票。

例如：资金有3万，买A股票市值1万；

B股票市值2万，那么它们的权重1/3和2/3；

收益率=（A股现价\*持股数量+B股现价\*持股数量）/起始资金；

标准差不明白什么意思，也可以按照总市值方法计算

**六、某公司的投资组合中有三种股票，所占比例分别为50%，30%，20%，系数分别为0.8，1.0，1.2；**

**七、已知三支股票的收益率均值，求着三支股票的资产组合平均收益?（投资比例自由选定）**

abc分别为三支股票的收益率。

$a+b+c=d$ ， $d/3$ 即为平均收益率。

**八、某公司持有A、B、C三种股票构成的投资组合，计算甲公司所持投资组合的贝塔系数和必要投资报酬率。**

$$=1*40\%+0.5*30\%+2*30\%=1.15 \text{ 必要投资报酬率}=6\%+1.15*(16\%-6\%)=17.5\%$$

## 参考文档

[下载：三种股票投资组合月度收益率是多少.pdf](#)

[《股票停止交易多久》](#)

[《30万买股票能买多久》](#)

[《股票钱多久能到银行卡》](#)

[《蜻蜓点睛股票卖出后多久能取出》](#)

[《股票抽签多久确定中签》](#)

[下载：三种股票投资组合月度收益率是多少.doc](#)

[更多关于《三种股票投资组合月度收益率是多少》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/45843845.html>