

股票的无风险收益率怎么计算-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-股识吧

一、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z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 $E(R) = 5\% + (0.5 * 2 + 0.5 * 1.2) * 6\% = 14.6\%$

二、A公司股票的贝他系数为2.5，无风险报酬率为6%，平均风险股票的报酬率为10%。计算A公司股票的预期收益率

展开全部A公司股票的预期收益率 = $6\% + 2.5 * (10\% - 6\%) = 16\%$

三、若某一股票的期望收益率为12%，市场组合期望收益率为15%，无风险利率为8%，计算该股票的值。

该股票相对于市场的风险溢价为： $12\% - 8\% = 4\%$ 市场组合的风险溢价为： $15\% - 8\% = 7\%$ 该股票的值： $4\% / 7\% = 4/7$

四、你计划将1000000万美元投资于股票X、股票Y和无风险资产。你计划构造一个期望收益率为13.5%

$31\%x + 20\%y + 7\%z = 13.5\%$
 $x + y + z = 1$
 $11.8x + 1.3y + z = 0.7(1.8x + 1.3y)$ 求出x，乘以1000000w

五、求风险收益率，必要收益率，无风险收益率的公式？

风险收益率的大小主要取决于两个因素：风险大小和风险价格。
在风险市场上，风险价格的高低取决于投资者对风险的偏好程度。

(风险收益率=风险大小+风险价格)

无风险收益率=资金时间价值 (纯利率) + 通货膨胀补偿率
必要投资收益率 = 无风险收益率+风险收益率 = (资金时间价值 + 通货膨胀补偿率) + 风险收益率

参考文档

[下载：股票的无风险收益率怎么计算.pdf](#)

[《股票腰斩后多久回本》](#)

[《农民买的股票多久可以转出》](#)

[《股票卖完后钱多久能转》](#)

[下载：股票的无风险收益率怎么计算.doc](#)

[更多关于《股票的无风险收益率怎么计算》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/read/12217495.html>