

股票的预期风险怎么算-一只股票的贝塔系数是1.3，市场的期望收益率是14%，无风险利率是5%。这只股票的预期风险必须是多少？-股识吧

一、一只股票的贝塔系数是1.3，市场的期望收益率是14%，无风险利率是5%。这只股票的预期风险必须是多少？

$E(R) = R_f + \beta * [E(R) - R_f]$ // 期望收益等于无风险收益加上风险溢价
期望收益 = 无风险收益 + (市场预期收益 - 无风险收益) ;
预期风险 = 期望收益 - 市场预期收益
证券市场线方程为 $E(r) = 5\% + \beta * (14\% - 5\%)$ 即 $E(r) = 0.05 + 1.3 * 0.09 = 0.167 = 16.7\%$ 即风险收益率是16.7%。

二、如何计算一支股票的风险系数并给其定价?

股票市场投机的多，真正价值投资的人很少。

计算价格只是理论，总与市场有偏差。

我这里给你看看吧：1.短期持有，未来准备出售的股票估价 P_0 —股票价格；

P_n —预计股票 n 年后的售价， D_t —第 t 期股利；

r —股东要求的报酬率。

三、如何计算一支股票的风险系数并给其定价?

股票市场投机的多，真正价值投资的人很少。

计算价格只是理论，总与市场有偏差。

我这里给你看看吧：1.短期持有，未来准备出售的股票估价 P_0 ;

—股票价格；

 ;

 ;

 ;

 ;

 ;
 ;
 ;
 ;
 ;
Pn ;
 ;
—预计股票n年末的售价，Dt ;
 ;
— ;
第t期股利；
 ;
r ;
— ;
股东要求的报酬率。

四、股市里的风控怎么计算

展开全部股市里的风控怎么计算简单说就是设定一些条件控制和降低风险，但是降低风险的同时也会降低收益，总的来说利大于弊，

五、一只股票的贝塔系数是1.3，市场的期望收益率是14%，无风险利率是5%。这只股票的预期风险必须是多少？

$E(R) = R_f + \beta * [E(R) - R_f]$ // 期望收益等于无风险收益加上风险溢价
期望收益 = 无风险收益 + (市场预期收益 - 无风险收益) ;
预期风险 = 期望收益 - 市场预期收益
证券市场线方程为 $E(r) = 5\% + \beta * (14\% - 5\%)$ 即 $E(r) = 0.05 + 1.3 * 0.09 = 0.167 = 16.7\%$ 即风险收益率是16.7%。

参考文档

[下载：股票的预期风险怎么算.pdf](#)

[《s点在股票里什么意思是什么》](#)

[《中房股份股票为什么涨》](#)

[《st重组股票复牌能涨几倍》](#)

[下载：股票的预期风险怎么算.doc](#)

[更多关于《股票的预期风险怎么算》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/read/23181510.html>