

股票投资风险系数怎么计算、怎么计算股票的投资风险率和投资回报率-股识吧

一、怎样计算股票的系统风险和非系统风险

1. 系统风险不过是股票价格和本质脱离构成背离关系。
2. 非系统不过就是股民常常看的那些所谓公司分红。公告，炒作，这些对股票都是暂时性的，跟去大趋势，时期背景，相干法律来掌控估计系统风险。
3. 系统性风险是指由于公司外部、不为公司所预计和控制的因素造成的风险。通常表现为国家、地区性战争或骚乱，全球性或区域性的石油恐慌，国民经济严重衰退或不景气，国家出台不利于公司的宏观经济调控的法律法规，中央银行调整利率等。
4. 非系统性风险是由股份公司自身某种原因而引起证券价格的下跌的可能性，它只存在于相对独立的范围，或者是个别行业中，它来自企业内部的微观因素。

二、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 β 等于每种资产的 β 按照其市值权重累加之和
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 $E(R) = 5\% + (0.5 * 2 + 0.5 * 1.2) * 6\% = 14.6\%$

三、如何计算股票的收益和风险

我理解你是想问购买股票的收益和风险。

股票收益的计算收益 = (卖出价 - 买入价) / 买入价 * 100

(%) 其中卖出与买入价都应考虑交易费用。

收益可能为正即盈利，也可能为负即亏损。

股票风险的计算所谓风险通常是指不确定性，对购买股票来讲，可理解为买入股票后盈利的可能性（概率）的大小。

而个股的涨跌与很多因素有关，例如与管理层政策、市场供需、个股基本面、个股技术面等有关。

这样风险测算的难度就很大了。

不过也可以简化：例如很多技术流派，只跟踪趋势和成交量，这样风险度量就有股价涨跌概率=F（趋势、成交量）这样的关系了。

个人拙见，呵呵。

四、

五、投资的风险性质和计算方法是怎样？

任何一种投资都有风险，没有人能够准确地预测风险。

不知道你所指的投资风险是哪个具体的行业或门类，不同的行业其具体表现形式不同。

一般情况下，常见的投资风险有以下几种：1.财务风险：金融投资，如股票或债券，会因为发行公司经营不善，使股票价格下跌或无法分配股利，或使债券持有人无法收回本金和利息。

2.市场风险：市场变化的不确切，往往使经验不足的投资者造成亏损。

以股市来说，市场的景气与否往往会使持有股票的价格随着起伏，使投资者造成损失。

3.利率风险：对债券投资者的影响最大，利率上升会使债券价格下跌，造成损失。

4.购买力风险：通货膨胀会使金钱贬值，丧失原有的购买力，投资利润若赶不上通货膨胀率，就是在赔钱。

除此之外，还包括政治、社会风险，经营风险；

如果涉及边贸还有汇率风险等。

=====风险
还真就不好计算，但是确实可以算，只是前提条件你对你要做的事情比较熟悉，其中的细节可以大致估算，然后在具体细节里边相对应的进行计算！普遍认为，你计划和预计的越具体，能够计算的风险也就越精确。

但是计算的精确势必花费大量精力和时间，不是非常现实，因此通常采用估算的方法！估算主要方面就可以，具体估算要根据熟悉程度，算吗就是数学计算，没什么

可说的。

六、怎么计算股票的投资风险率和投资回报率

风险率是个坑， $\text{风险率} = \text{可投资总金额} / \text{投资金额}$ 。回报率，是指以前的收益率 = (股票的卖价 - 买价) / 买价如果是学金融的。

$\text{回报率} = (\text{股票的卖价} - \text{买价}) / ((\text{银行的税率} + 1) * \text{买价})$ 具体要看怎么定义本金的内容。

-
-
-

参考文档

[下载：股票投资风险系数怎么计算.pdf](#)

[《股票停止交易多久》](#)

[《股票理财资金追回需要多久》](#)

[《股票被炒过要多久才能再炒》](#)

[《委托股票多久时间会不成功》](#)

[《股票订单多久能成交》](#)

[下载：股票投资风险系数怎么计算.doc](#)

[更多关于《股票投资风险系数怎么计算》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/26550617.html>