

怎样确定股票组合的无风险利率：市场组合的预期收益率是10%，无风险利率为3%。 -股识吧

一、证券无风险利率的计算

根据资产定价模型 CAPM，依题意的话那么 $E(R) = RF + 0.5(0.19 - RF)$
 $E(R) = RF + 0.6(0.22 - RF)$ 无风险利率为 37%

二、有分求助！关于证券投资组合期望收益率和无风险利率的计算

资本资产定价模型公式为 证券收益率=无风险收益率+贝塔值*(市场收益率—无风险收益率) 根据此公式，联立方程组 $25\% = \text{无风险收益率} + 1.5 * (\text{市场收益率} - \text{无风险收益率})$
 $15\% = \text{无风险收益率} + 0.9 * (\text{市场收益率} - \text{无风险收益率})$ 解得：市场收益率=1/6 无风险收益率=0

三、市场组合的预期收益率是10%，无风险利率为3%。

如果你说的市场组合的期望收益率是market rate而不是market premium的话，就如下所示期望收益率=6%+1.5*(12%-6%)=15%> 12%不应该进行这项投资

四、什么是无风险利率？

通常指政府债券 因为政府有印钞权力 它制订的利率肯定没风险

五、已知A股票的贝塔值和期望收益率，和B股票的贝塔值和期望收益率，怎样算无风险利率

$R1 = R_f + \beta_1 * MPR$
 $R2 = R_f + \beta_2 * MP$ 其中MP为market premium，即 $R_m - R_f$ ，作为整体考虑，无分解必要。

通过 $(R1-R2)/(\beta_1-\beta_2)$ 计算出MP将MP带入任何一式，均可解出 R_f

六、无风险利率为7%，如何实现15%的预期回收的无风险资产组合和最佳风险投资组合

我谈谈自己的看法啊，不知你用无风险利率干嘛，但是大致应该跟投资资产或者资金借贷的区间相匹配。

在西方投资学中，投资组合理论中的无风险利率，通常都是短期资金的借贷成本，是用美国3个月国债的收益率来近似的。

你提到的中国的无风险利率，如果用银行间10年国债预期收益率，显然是期限太长，显得不合适。

一年期存款利率，就接近一些，其实在投资学中，强调的更是资金借贷成本，我国没有实行利率市场化，存款利率和贷款利率有个强制的利差，所以建议你综合考虑，一年期的利率比十年期更好，但是不妨采用更短期的国债收益率。

供参考。

参考文档

[下载：怎样确定股票组合的无风险利率.pdf](#)

[《中信证券卖了股票多久能提现》](#)

[《出财报后股票分红需要持股多久》](#)

[《股票日线周线月线时间多久》](#)

[《股票abc调整一般调整多久》](#)

[《一只股票停牌多久》](#)

[下载：怎样确定股票组合的无风险利率.doc](#)

[更多关于《怎样确定股票组合的无风险利率》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/31429825.html>

