

股票组合风险如何计算--简述证券投资基金收益及风险的计量方法-股识吧

一、公司理财股票组合承担的风险怎么算?

银行公布的利息都是年利息。

也就是说按你所说的为例，定期三月利率为2% 一年利率为3%加入两年利息是4% 计算那么三个月定期后得到 $1000 \times 2\%$ 这个是年利息 一般银行3个月定期按一年的四分之一算，也就是说 $1000 \times 2\% \times 0.25 = 15$ 元才是3个月的利息。

其中0.25是时间3个月一年的利息 $1000 \times 3\% \times 1 = 30$ 元 其中1为时间1年两年的利息 $1000 \times 4\% \times 2 = 80$ 元 其中2为时间2年

二、资产组合风险公式怎么去理解?

风险*权重就是了。

这个和股票指数的编制差不多，比如说你有3支股票ABC。

A股票有10股，B股票有40股，C股票有50股，价格分别是10元，15元，和20元。

那么，按照算数平均法计算就是平均股价为15元，按照权重，也就是加权平均法计算就是： $10 \times 10\% + 15 \times 40\% + 20 \times 50\% = 17$ 。

资产组合的风险计算也是这个道理，收益等于各支股票的预期收益*风险系数*权重。

三、简述证券投资基金收益及风险的计量方法

计算预期收益。

计算预期标准离差。

计算预期标准离差率。

计算应得风险收益率。

计算预测投资收益率

四、公司理财股票组合承担的风险怎么算？

银行公布的利息都是年利息。

也就是说按你所说的为例，定期三月利率为2% 一年利率为3%加入两年利息是4% 计算那么三个月定期后得到 $1000 \times 2\%$ 这个是年利息 一般银行3个月定期按一年的四分之一算，也就是说 $1000 \times 2\% \times 0.25 = 15$ 元才是3个月的利息。

其中0.25是时间3个月一年的利息 $1000 \times 3\% \times 1 = 30$ 元 其中1为时间1年两年的利息 $1000 \times 4\% \times 2 = 80$ 元 其中2为时间2年

五、三种股票投资组合风险计算

整个投资组合的方差

$= 0.3 \times 0.3 \times 100 + 0.3 \times 0.3 \times 144 + 0.4 \times 0.4 \times 169 + 2 \times 0.3 \times 0.3 \times 120 + 2 \times 0.3 \times 0.4 \times 130 + 2 \times 0.3 \times 0.4 \times 156 = 139.24$

三个股票的投资组合方差 = $w_1 \times w_1 \times \text{股票1的方差} + w_2 \times w_2 \times \text{股票2的方差} + w_3 \times w_3 \times \text{股票3的方差} + 2 \times w_1 \times w_2 \times \text{股票1和2的协方差} + 2 \times w_1 \times w_3 \times \text{股票1和3的协方差} + 2 \times w_2 \times w_3 \times \text{股票2和3的协方差}$

六、计算投资组合的风险收益率！！！！

系数 = $50\% \times 2.1 + 40\% \times 1.0 + 10\% \times 0.5 = 1.5$ 风险收益率 = $1.5 \times (14\% - 10\%) = 6\%$

参考文档

[下载：股票组合风险如何计算.pdf](#)

[《股票增持新进多久出公告》](#)

[《联科科技股票中签后多久不能卖》](#)

[下载：股票组合风险如何计算.doc](#)

[更多关于《股票组合风险如何计算》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/3530522.html>