

股票组合期望年收益率怎么算、关于期望收益率投资组合-股识吧

一、投资组合的期望收益率如何计算??

期望收益率，又称为持有期收益率（hpr）指投资者持有一种理财产品或投资组合期望在下一个时期所能获得的收益率。

这仅仅是一种期望值，实际收益很可能偏离期望收益。

计算公式： $hpr = (\text{期末价格} - \text{期初价格} + \text{现金股息}) / \text{期初价格}$

二、如何通过股票走势图求出股票的期望收益率？

假定投资者将无风险的资产和一个风险证券组合再构成一个新的证券组合，投资者可以在资本市场上将以不变的无风险的资产报酬率借入或贷出资金。

在这种情况下，如何计算新的证券组合的期望报酬率和标准差？假设投资于风险证券组合的比例（投资风险证券组合的资金/自有资金）为Q，那么1-Q为投资于无风险资产的比例。

无风险资产报酬率和标准差分别用 $r_{\text{无}}$ 、 $\sigma_{\text{无}}$

表示，风险证券组合报酬率和标准差分别用 $r_{\text{风}}$ 、 $\sigma_{\text{风}}$ 表示，因为无风险资产报酬率是不变的，所以其标准差应等于0，而无风险的报酬率和风险证券组合的报酬率不存在相关性，即相关系数等于0。

那么新的证券组合的期望报酬率和标准差公式分别为： $r_P = Qr_{\text{风}} + (1-Q)r_{\text{无}}$

三、某企业股票的β系数为1.2，无风险利率R为10%，市场组合的期望收益率为12%，则该企业普通股留存收

选C，有这样一个计算公式： $K = R + (\beta)(R_m - R)$ R_m 就是市场组合的期望收益率。

四、投资组合收益率

成熟股投资收益率=0.1*2%+0.3*4%+0.4*10%+0.2*20%=9.4%
 成长股投资收益率=0.1*-3%+0.3*3%+0.4*7%+0.2*10%=5.4%
 两种股票组合投资收益率=50%*0.094+50%*0.054=0.074
 成熟股方差=0.1*(9.4%-2%)^2+0.3*(9.4%-4%)^2+0.4*(9.4%-10%)^2+0.2*(9.4%-20%)^2=0.003684
 成长股方差=0.1*[5.4%-(-3%)]^2+0.3*(5.4%-3%)^2+0.4*(5.4%-7%)^2+0.2*(5.4%-10%)^2=0.001404
 两种股票的投资组合标准差=[50%*50%*0.003684+50%*50%*0.001404+2*50%*50%*(0.003684*0.001404)^(1/2)*0.89]^(1/2)=0.0478
 注：两个投资组合方差=投资组合A比例的平方*投资组合A的方差+投资组合B比例的平方*投资组合B的方差+2*投资组合A比例*投资组合B比例*投资组合A的标准差*投资组合B的标准差*两种股票之间的相关系数

五、某企业股票的 系数为1.2，无风险利率R为10%，市场组合的期望收益率为12%，则该企业普通股留存收

选C，有这样一个计算公式： $K=R+(R_m-R)^*$ R_m 就是市场组合的期望收益率。

六、关于期望收益率投资组合

10万

也就是说投资C产品资金的5%，必须大于A产品所投资金的4%
 $120000*4%=4800$ 元
 $4800/5%=96000$ 元

因为要达到不低于20%的收益又以万元为单位所以要投10万的C产品。

七、已知某股票的 值为1.2，无风险收益率为6%，市场组合的期望收益率为16%，计算该股票的期望收益率。

期望收益率=无风险收益率 + 风险收益率
 $R_i=R_f+(R_m-R_f)*\beta=6\%+1.2*(16\%-6\%)=18\%$
 其中 R_m-R_f 可以理解为市场组合平均风险收益率， β 为相对市场平均风险而言的风险系数。

参考文档

[?????????????????.pdf](#)
[???????????????](#)
[???????????????????](#)
[???????????????????](#)
[???????????????????](#)
[?????????????????????.doc](#)
[??????????????????????????????????...](#)

??
<https://www.gupiaozhishiba.com/read/36280144.html>