

股票风险率怎么计算——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-股识吧

一、风险率怎么算

风险率：是为了控制风险的防止系统强平的 净值=已用预付款+可用预付款
风险率=净值/已用预付款=(已用预付款+可用预付款)/已经预付款 如果操作的时候做错了，同时没有设置止损点出现抗单的现象时，亏损首先亏损的是可用预付款，等可用预付款亏完了，风险率就为100%，系统会通知投资者追加资金，否则将会从已用预付款里扣除，当继续亏损的时候，已用预付款再亏损超过30%的时候，就是风险率低于70%系统强制平仓

二、股票组合风险怎么算？急！

风险价值法(VAR)：VAR实际上是要回答在概率给定情况下，银行投资组合价值在下一阶段最多可能损失多少。

在风险管理的各种方法中，VAR方法最为引人注目。

细节你看看网站内容。

三、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
lz的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 $E(R) = 5\% + (0.5 * 2 + 0.5 * 1.2) * 6\% = 14.6\%$

四、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 年未的售价， D_t —第 t 期股利；

r —股东要求的报酬率。

五、现货中的风险率怎么计算的？

风险率=账户净值/持仓占用保证金*100% 2、净值=已用保证金+可用保证金

实例分析 李先生帐户总资金是1万元，在4000元/吨的点位建立2手10吨原油多单，假设保证金为比例3%。

那么他的风险率是多少？解析：占用保证金 = 建仓价 x 合约单位 x 手数 x 3%

=4000x10x2x3%=2400元 风险率 = 10000 / 2400 x 100% = 417 % 因为占用保证金固定，

风险率低于70%会强制平仓，那么强制平仓时帐户剩余资金是：占用保证金x70%=2400x70%=1680，当帐户资金低于1680元的时候会强制平仓。

风险率即负债总额与资产总值比值，描述投资者资金账户的使用情况即风险的大小。

仓位越大，风险率越高，仓位越小，风险率越低。

六、平均风险股票必要报酬率怎么估计出来的？

不是一个概念 风险报酬率的计算公式： $R = R_f + \beta \times (R_m - R_f)$ 式中： KR 表示风险报酬率；
 β 表示风险报酬系数；

V 表示标准离差率。

则在不考虑通货膨胀因素的影响时，投资的总报酬率为： $K = R_f + \beta \times (R_m - R_f)$

其中： K 表示投资报酬率；

R_f 表示无风险报酬率。

平均收益率=无风险报酬率+风险报酬率 我们大学财务管理学过可以完全确定放心！

参考文档

[下载：股票风险率怎么计算.pdf](#)

[《比亚迪股票多久到700》](#)

[《股票涨跌周期一般多久》](#)

[《拿一只股票拿多久》](#)

[《股票钱拿出来需要多久》](#)

[《行业暂停上市股票一般多久》](#)

[下载：股票风险率怎么计算.doc](#)

[更多关于《股票风险率怎么计算》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/subject/21910570.html>