

## 计算两种股票投资组合的报酬率怎么算；投资报酬率怎样算阿？-股识吧

一、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 $\beta$ 等于每种资产的 $\beta$ 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 $E(R) = 5\% + (0.5 * 2 + 0.5 * 1.2) * 6\% = 14.6\%$

## 二、投资组合的期望收益率如何计算？

分散投资降低了风险（风险至少不会增加）。

组合预期收益率 =  $0.5 * 0.1 + 0.5 * 0.3 = 0.2$  两只股票收益的协方差 =  $-0.8 * 0.3 * 0.2 = -0.048$

组合收益的方差 =  $(0.5 * 0.2)^2 + (0.5 * 0.3)^2 + 2 * (-0.8) * 0.5 * 0.5 * 0.3 * 0.2 = 0.0085$

组合收益的标准差 = 0.092 组合前后发生的变化：组合收益介于二者之间；风险明显下降。

## 三、股票的组合收益率，组合方差怎么求？

分散投资降低了风险（风险至少不会增加）。

组合预期收益率 =  $0.5 * 0.1 + 0.5 * 0.3 = 0.2$  两只股票收益的协方差 =  $-0.8 * 0.3 * 0.2 = -0.048$

组合收益的方差 =  $(0.5 * 0.2)^2 + (0.5 * 0.3)^2 + 2 * (-0.8) * 0.5 * 0.5 * 0.3 * 0.2 = 0.0085$

组合收益的标准差 = 0.092 组合前后发生的变化：组合收益介于二者之间；风险明显下降。

#### 四、两种股票，系数为2和1.2。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。

这个题从现有条件看没法计算。

首先不知道无风险收益率。

另外如果组合的风险收益率为6%，市场风险报酬率为5%，则组合的系数=1.2，两种股票最低的系数都为1.2，所以推导组合中只有乙股票，没有甲股票。

但由于不知道无风险收益率，所以还是没法计算。

-----个人意见

#### 五、投资报酬率怎样算阿？

投资所得利润/投资成本\*100%=投资报酬率

#### 六、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： $hpr = (\text{期末价格} - \text{期初价格} + \text{现金股息}) / \text{期初价格}$

#### 参考文档

[下载：计算两种股票投资组合的报酬率怎么算.pdf](#)

[《石家庄建设股票有哪些》](#)

[《港股股票期权账户是什么意思》](#)

[《股票新增reits概念是什么意思》](#)

[下载：计算两种股票投资组合的报酬率怎么算.doc](#)

[更多关于《计算两种股票投资组合的报酬率怎么算》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/24886568.html>