

如果组合中股票数量足够多、某公司的投资组合中有三种股票，所占比例分别为50%，30%，20%，系数分别为0.8，1.0，1.2；-股识吧

一、根据分散化投资的原理，一个投资组合中，所包含的股票越多，风险越小。对吗？

本身股票就是有很大风险的投资品种，投资组合可以有股票、基金、黄金、债券、储蓄等许多品种，当然越分散，相对说风险小一些，同样道理，如都买股票，买一只股票相对风险较大，如公司经营不好，亏损或倒闭，你就要承受很大风险，但你如买了多只股票，即使某家公司亏损、倒闭；但其它公司都能赢利，可以把这家亏损或倒闭的公司的损失弥补过来，你就不会有什么风险了，这样回答你满意吗？

二、某公司的投资组合中有三种股票，所占比例分别为50%，30%，20%，系数分别为0.8，1.0，1.2；

第一种股票必要收益率=6%+0.8*(11%-6%)=10%第二种股票必要收益率=11%第三种股票必要收益率=6%+1.2(11%-6%)=12%该投资组合的必要收益率=50%*10%+30%*11%+20%*12%=10.7%

三、根据投资组合理论，如果越来越多的股票被纳入等权重投资组合，则此投资组合的风险将产生什么%B

当股票越来越多，投资组合的variance会趋向于这些股票的平均covariance.

四、如果投资组合中包括全部股票，则投资者（ ）A只承受市场风险B只承受特有风险C只承受非系统风险D不承受系统

本身股票就是有很大风险的投资品种，投资组合可以有股票、基金、黄金、债券、

储蓄等许多品种，当然越分散，相对说风险小一些，同样道理，如都买股票，买一只股票相对风险较大，如公司经营不好，亏损或倒闭，你就要承受很大风险，但你如买了多只股票，即使某家公司亏损、倒闭；但其它公司都能赢利，可以把这家亏损或倒闭的公司的损失弥补过来，你就不会有什么风险了，这样回答你满意吗？

五、请问：投资组合的收益率与股票的数量有什么关系？可分散风险可否得到相应的风险溢价？

投资组合的收益率：指一个投资组合的加权平均收益率。

如购买10支股票，组合的收益率=总的收益/总的投资你购买的不同股票数量不同，价格大数量多的股票权重就大。

比如购买2只股票，A股票10000股，价格8元，B股票数量5000股，价格4元。

那么A股票的权重就是 $8 \times 10000 / (8 \times 10000 + 4 \times 5000) = 80\%$ ，A股票的涨跌对总收益率的影响就是80%了。

分散风险不能得到相应的风险溢价。

风险和收益总是相伴而生的。

高风险高收益，低风险低收益。

分散风险只是说尽量避免高风险高收益，寻求风险和收益的均衡希望可以帮助你更好的理解

参考文档

[下载：如果组合中股票数量足够多.pdf](#)

[《股票大盘回调幅度什么意思》](#)

[《奶牛蓝筹股是什么意思的相关文章》](#)

[《什么叫飞见龙在田的股票形态》](#)

[《市盈率市净率市销率怎么能区分》](#)

[下载：如果组合中股票数量足够多.doc](#)

[更多关于《如果组合中股票数量足够多》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/29697450.html>