

# 股票的预期收益率风险怎么计算，股票的预期收益率和方差怎么算-股识吧

## 一、计算股票预期收益率和股票的内在价值

下期支付股利=1.5\*(1+0.06%)=1.59  
预期收益率=3%+2\*(10%-3%)=17%  
股票价值=1.59/(17%-6%)=14.4545

## 二、怎么计算股票的投资风险率和投资回报率

风险率是个坑，风险率=可投资总金额/投资金额。回报率，是指以前的收益率=(股票的卖价-买价)/买价如果是学金融的。

回报率=(股票的卖价-买价)/((银行的税率+1)\*买价)具体要看怎么定义本金的内容。

- 。
- 。
- 。

## 三、股票的预期收益率和方差怎么算

具体我也不太清楚，所以帮你搜了一下，转发给你看，希望能帮到你！例子：上面两个资产的预期收益率和风险根据前面所述均值和方差的公式可以计算如下：1。

股票基金 预期收益率=1/3\*(-7%)+1/3\*12%+1/3\*28%=11%

方差=1/3[(-7%-11%)^2+(12%-11%)^2+(28%-11%)^2]=2.05%

标准差=14.3%(标准差为方差的开根，标准差的平方是方差)2。

债券基金 预期收益率=1/3\*(17%)+1/3\*7%+1/3\*(-3%)=7%

方差=1/3[(17%-7%)^2+(7%-7%)^2+(-3%-7%)^2]=0.67%

标准差=8.2%注意到，股票基金的预期收益率和风险均高于债券基金。

然后我们来看股票基金和债券基金各占百分之五十的投资组合如何平衡风险和收益

- 。

投资组合的预期收益率和方差也可根据以上方法算出，先算出投资组合在三种经济状态下的预期收益率，如下：萧条：50%\*(-7%)+50%\*17%=5%

正常： $50\% \times (12\%) + 50\% \times 7\% = 9.5\%$  繁荣： $50\% \times (28\%) + 50\% \times (-3\%) = 12.5\%$  则该投资组合的预期收益率为： $1/3 \times 5\% + 1/3 \times 9.5\% + 1/3 \times 12.5\% = 9\%$  该投资组合的方差为： $1/3[(5\% - 9\%)^2 + (9.5\% - 9\%)^2 + (12.5\% - 9\%)^2] = 0.001\%$  该投资组合的标准差为： $3.08\%$  注意到，其中由于分散投资带来的风险的降低。

一个权重平均的组合（股票和债券各占百分之五十）的风险比单独的股票或债券的风险都要低。

投资组合的风险主要是由资产之间的相互关系的协方差决定的，这是投资组合能够降低风险的主要原因。

相关系数决定了两种资产的关系。

相关性越低，越有可能降低风险。

#### 四、假设证券市场中有股票A和B，其收益和标准差如下表，如果两只股票的相关系数为-1。

这道题是希望通过运用两只股票构建无风险的投资组合，由一价原理，该无风险投资组合的收益就是无风险收益率。

何为无风险投资组合？即该投资组合收益的标准差为0，由此，设无风险投资组合中股票A的权重为w，则股票B的权重为(1-w)，则有： $\{(5\%w)^2 + [10\%(1-w)]^2 + 2 \times 5\% \times 10\% \times (-1) \times (1-w)w\}^{(1/2)} = 0$  等式两边同时平方，并扩大10000倍（消除百分号），则有： $25(w^2) + 100(1-w)^2 - 100w(1-w) = 0$  化简为： $225w^2 - 300w + 100 = 0$   $(15w - 10)^2 = 0$  则w=2/3 则，该投资组合的收益率为： $2\% \times (2/3) + 5\% \times (1/3) = 9\%/3 = 3\%$

#### 五、预期收益率怎样算

预期收益率是市场预期的最大收益，不准确的，算法可以在网上搜！

#### 六、一只股票的贝塔系数是1.3，市场的期望收益率是14%，无风险利率是5%。这只股票的预期风险必须是多少？

$E(R) = R_f + \beta \times [E(R) - R_f]$  // 期望收益等于无风险收益加上风险溢价 期望收益=无风险收益+（市场预期收益-无风险收益）；

预期风险=期望收益-市场预期收益 证券市场线方程为  $E(r) = 5\% + \beta \times (14\% - 5\%)$  即  $E(r) =$

$0.05 + 1.3 * 0.09 = 0.167 = 16.7\%$ 即风险收益率是16.7%。

**七、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。**

展开全部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

## 参考文档

[下载：股票的预期收益率风险怎么计算.pdf](#)

[《股票停牌复查要多久》](#)

[《股票卖出多久可以转账出来》](#)

[《股票要多久提现》](#)

[《股票亏钱多久能结束》](#)

[《股票流通股多久可以卖》](#)

[下载：股票的预期收益率风险怎么计算.doc](#)

[更多关于《股票的预期收益率风险怎么计算》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/36882001.html>