

三种股票投资组合月度收益率怎么算——股票投资组合收益率按等权和加权（流通市值为权重）分别算其风险（标准差），哪个标准差大-股识吧

一、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

二、股票投资组合收益率按等权和加权（流通市值为权重）分别算其风险（标准差），哪个标准差大

不用算也知道是加权大啊

三、某公司持有A、B、C三种股票构成的投资组合，计算甲公司所持投资组合的贝塔系数和必要投资报酬率。

$$=1*40\%+0.5*30\%+2*30\%=1.15 \text{ 必要投资报酬率}=6\%+1.15*(16\%-6\%)=17.5\%$$

四、股票的月收益率计算

没法算。

这个东西不能时间类推的，要以加好友聊

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

六、股票的月收益率怎么计算呢

您自己算不就行了吗，例如某股票买入10元，三个月后涨到12元，则收益率= $(12x \text{股数} - (10x \text{股数} + \text{手续费})) / 10x \text{股数}$

七、请教各位：如何运用三因素模型的组合收益率，来计算

参考文档

[下载：三种股票投资组合月度收益率怎么算.pdf](#)

[《认缴股票股金存多久》](#)

[《大冶特钢股票停牌一般多久》](#)

[《股票放多久才能过期》](#)

[《股票涨30%需要多久》](#)

[《公司上市多久后可以股票质押融资》](#)

[下载：三种股票投资组合月度收益率怎么算.doc](#)

[更多关于《三种股票投资组合月度收益率怎么算》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/37546207.html>