

股票投资的期望收益率怎么算-投资学习题：股票提供的期望收益率为18%，标准差为22%。黄金提供的期望收益率为10%，标准差为30%。-股识吧

一、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： $\{(5\%w)^2 + [10\%(1-w)]^2 + 2 * 5\% * 10\% * (-1) * (1-w)w\}^{(1/2)} = 0$ 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： $2\% * (2/3) + 5\% * (1/3) = 9\%/3 = 3\%$

二、股票收益的期望和标准差计算。

听了我这段做股票的心得，你一定有很大的收获。

我觉得做股票吧，首先，心态要好，创造财富也得有好心情。

中国的股市，波段操作的赢利范围和可行性最大，另外，选取的个股，也必须跟随主力的动向，这样就不会让自己的资金冒险。

为了把握最理想的买卖点，必须有主力的带动和证券技术部门的老师指引去操作，这样才能达到在股市中长期的稳定赢利。

下面我给大家推荐一位在股市中比较资深的操盘老师，主要的实战操作，才能让我们信服，这位老师的操作平台资料就在我的空间里，相信自己的眼光，关注一段时间后，你会发现，做股票，这才叫实力！

三、若某一股票的期望收益率为12%，市场组合期望收益率为15%，无风险利率为8%，计算该股票的β值。

该股票相对于市场的风险溢价为： $12\% - 8\% = 4\%$ 市场组合的风险溢价为： $15\% - 8\% = 7\%$ 该股票的β值为： $4\% / 7\% = 4/7$

四、如何从股票走势图中计算出期望收益率

求一段时间的平均涨跌幅吧。
长期股权投资则算历年平均股息率。

五、债券回购，此时股票期望收益有多少

2，减去佣金50元后净收益为242元，比连续做1日回购高34元，减去佣金50元后净收益为228元。

7日回购利率平均为1，而深市最高才4.5%，则收益为100万*1。

如果做回购.打新股收益率高时，就不要做逆回购。

新股申购收益率在大多数情况下高于逆回购收益，所以若投资者的资金闲置三天且恰逢有新股发行就不要做逆回购而选择打新股。

周五如果资金能转出做其他投资，就不要做逆回购，因为资金利率很低、财务公司等。

我们觉得当那天恰好打开账户时就值得花10秒钟操作一下的。

比如2022年8月1日沪市回购利率最高达到7.7%，而往往把账户上暂时不用的现金就闲置在那里只拿活期利息。

以100万为例，我们看看差别 $(4.5\% - 4\%) / 360 = 278$ 元。

4.5%，周四为4%，则投资100万总收益为100万*(1.用暂时闲置资金参与。

交易所逆回购的参与者主要是除银行以外的机构投资者比如货币市场基金，转出和回购那个更有利。

因为尽管长假前第二天的利率很高，但却失去了长假期间的利息.选择收益高的市场参与。

沪深交易所都有回购品种，因为他们都没有什么风险，所以对于投资者来说肯定要
选择收益率高的，而实时上很多投资者并不了解这一点，剩余87.22元，比活期高73
，尤其是现在新股申购上限的限制，迫使很多机构不得已而参与逆回购交易。

个人投资者参与逆回购主要是在暂时闲置的资金没有更好的投资渠道时运用。

因利率较低而不适合作为一种长期的投资工具！更重要的是做一次7日逆回购比较
方便.7日逆回购比连续1日逆回购更有利。

如果限制资金超过1周？简单计算如下。

1日逆回购4次的利率平均为1.有机会尽量参与。

3，则回购利息为100万*3.5%/360=97.22元，减去最高的佣金10元.34元.88元，一般利率为1.5%(周四可到4%)，期间又无新股申购等更好的投资渠道，那么连续做1日和

做一个7日逆回购那个更有利呢。

很多人不在乎这点回购的“小钱” $.5\% \times 7 / 360 = 292$ 元，而且周末两天也没有利息。周五和节假日前谨慎参与。

如果不做回购，则一天的活期利息为 $100万 \times 0.36\% / 360 = 13$ 。

特别是长假前一定要计算一下！5。

6

六、股票估值中市场组合的预期收益率是怎么取值的？

你是说资本资产定价模型吗？CAPM。

你说的这个问题我从前也思考过。

我的一些结论：（1）CAPM模型的目的是评估风险，市场的预期收益实际是为了带入公式后计算单个资产的风险的。

（为了贴现估值时作为贴现率用）（2）从公式可以知道，其他条件不变，市场预期收益率越低，计算出的单个资产风险越小。

（3）仔细思考可得，实际上市场收益率的确定取决于投资者自己的风险偏好和该投资项目的一般预期回报和风险。

（4）我觉得如下几种取值比较合理：

A，取市场的长期收益率的几何平均值，中国股市大约是16%-17%。

B，用无风险收益率+风险溢价（无风险收益率取当下的5年期国债收益率，风险溢价可以用市场平均偏差和其他主观因素调整）

顺便说一下这其中在实践中的难点。

因为中国股市在过去20年中是高波动的，所以你算出来的贴现率可能非常大，这个在实践中是有问题的。

巴菲特在估值的时候他是直接用无风险收益率，因为他认为他选的股风险小。

七、如何通过股票走势图求出股票的期望收益率？

假定投资者将无风险的资产和一个风险证券组合再构成一个新的证券组合，投资者可以在资本市场上将以不变的无风险的资产报酬率借入或贷出资金。

在这种情况下，如何计算新的证券组合的期望报酬率和标准差？假设投资于风险证券组合的比例（投资风险证券组合的资金/自有资金）为Q，那么1-Q为投资于无风险资产的比例。

无风险资产报酬率和标准差分别用 $r_{无}$ 、 $\sigma_{无}$

表示，风险证券组合报酬率和标准差分别用 $r_{\text{风}}$ 、 $\sigma_{\text{风}}$ 表示，因为无风险资产报酬率是不变的，所以其标准差应等于0，而无风险的报酬率和风险证券组合的报酬率不存在相关性，即相关系数等于0。

那么新的证券组合的期望报酬率和标准差公式分别为： $r_P = Qr_{\text{风}} + (1-Q)r_f$

八、投资学习题：股票提供的期望收益率为18%，标准差为22%。黄金提供的期望收益率为10%，标准差为30%。

- 1) 选择单一资产投资时，黄金由于收益率低，风险高，所以不会有人选择投资黄金。
- 2) 由于黄金与股票的相关系数为1（即完全正相关），黄金与股票的投资组合并不能抵消风险，所以投资组合中不会持有黄金。
上述假设并不能代表证券市场的均衡，因为股票收益率更高，风险更小。

参考文档

[下载：股票投资的期望收益率怎么算.pdf](#)

[《股票的与60日线的怎么看》](#)

[《有什么准确率高的炒股指标软件》](#)

[《股票新易融是什么意思是什么》](#)

[《黄金股票怎么买卖的》](#)

[下载：股票投资的期望收益率怎么算.doc](#)

[更多关于《股票投资的期望收益率怎么算》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/article/21823756.html>