

如何计算股票组合的权重—关于投资组合权重计算的问题-股识吧

一、权重的确定方法

1、主观经验法考核者凭自己以往的经验直接给指标设定权重，一般适用于考核者对考核客体非常熟悉和了解的情况下。

2、主次指标排队分类法这是比较常用的一种方法，也称A、B、C分类法。

顾名思义，其具体操作分为排队和设置权重两步：排队是将考核指标体系中所有指标按照一定标准，如按照其重要性程度进行排列；

设置权重是在排队的基础上，按照A、B、C三类指标设置权重。

3、专家调查法这种方法是聘请有关专家，对考核指标体系进行深入研究，由每位专家先独立地对考核指标设置权重，然后对每个考核指标的权重取平均值，作为最终权重。

同样的指标，对不同的部门和人员来说，各个指标的权重应不一样；

不同来源的数据权重也是不一样的。

考核实践中应综合运用各种方法科学设置指标权重。

通常的做法是主要根据指标的重要性进行设置，并可根据需要适时进行调整。

扩展资料：在资本市场规模较小的时候，一般而言在指数反弹或大幅度上涨到一高位区后，权重股拉抬股指后往往是顶部出现，而众多个股在权重股拉抬过程中实现战略减仓或出货；

反观股市行情，由于A股市场的大比例提升，其权重股推升股指的影响作用更加明显。

指标权重股在高位区的拉抬有何影响，从中国A股市场发展的角度来看，说明市场投资理念发生的较大的变化，前些年表现疲弱的大盘股正在为市场机构投资者、中小投资者所接受，这些品种的拉抬更大层面反映的是机构投资者队伍的扩大、市场阶段内资金充足的体现，也应清醒的看到，由于权重股在市场中对指数绝对影响，其价格的连续上涨同样会带来较大的价值偏离，比如表现强劲的工行，从公司发展层面来看，其未来发展更多的体现为稳步发展型，跨越式发展的概率非常之低，而A股价格高于同期H股价格30%左右，这也说明A股市场中的工行起码在阶段内有高估之嫌，也有为其它机构年终拉抬或股指期货建仓品种的可能，因此其短期之内特别是从年度经营业绩的角度来看工行与中行经营业绩难以出现过大的业绩提升，那么这种拉抬一旦超越或偏离阶段内投资价值，其回落风险就随时可能产生，因此权重股的拉抬应分阶段、股价对照、经营业绩等多重因素进行考量。

参考资料来源：搜狗百科—权重

二、怎样计算最佳投资组合中个股票的权重

$E(R) = R_f + \beta * [E(R) - R_f]$ // 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 β 等于每种资产的 β 按照其市值权重累加之和
lz的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 $E(R) = 5\% + (0.5 * 2 + 0.5 * 1.2) * 6\% = 14.6\%$

三、求两只股票权重？

指数的加权市盈率为加权市值/加权利润=8.16 所以股票B的市盈是5.4应该没错吧?//
@守株待兔的夹头：回复@守株待兔的夹头：指数100%权重计算总盈利

四、股票权重如何计算的？

某股票的总市值/市场整体总市值=该股占市场的权重
权重股就是总股本巨大的上市公司股票,他的股票总数占股票市场股票总数的比重很大,也就权重很大,他的涨跌对股票指数的影响很大。

五、投资组合权重计算 投资组合的权重怎么求

$E(R) = R_f + \beta * [E(R) - R_f]$ // 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 β 等于每种资产的 β 按照其市值权重累加之和
lz的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 $E(R) = 5\% + (0.5 * 2 + 0.5 * 1.2) * 6\% = 14.6\%$

六、股市权重是如何计算的

股市权重是按照上市公司在股市中的加权乘数算出来的。

比如某个股票市场指数的市值是10000亿，A公司的总股本20亿股，股价10元/股，那么A公司占股市权重为2%。

目前上海股票市场中权重最高的前三位分别是：中国石油11.68%，工商银行6.99%，建设银行5.42%。

七、股市权重是如何计算的

股市权重是按照上市公司在股市中的加权乘数算出来的。

比如某个股票市场指数的市值是10000亿，A公司的总股本20亿股，股价10元/股，那么A公司占股市权重为2%。

目前上海股票市场中权重最高的前三位分别是：中国石油11.68%，工商银行6.99%，建设银行5.42%。

八、关于投资组合权重计算的问题

闪牛分析：权重分别为-200%和+300%，合计100%，没什么问题啊。

你这个例子也算比较极端了，卖空价值大于多头价值，造成了总价值为负值。这个权重是没问题的。

九、权重是怎么计算？？？

权重不是怎么计算，你要问得更具体点，权重是人来定的，表示某些类型相同的东西各自的重要程度，你说的例子，并没有说清楚到底要计算什么权重，你只是给了各个路口的发案率，但具体要定什么东西的权重没有说清楚，下面这个例子是告诉你什么是权重。

某学生期末总评满分为100分，其中分语文，数学，英语

三个项目，权重分别为，语文35%，数学35%，英语30%。

小明语文考了90分，数学考了95分，英语考了100分，那么根据各科目的权重比，他的总评分= $90*35\%+95*35\%+100*30 = 31.5 + 33.25 + 30 = 94.75$

参考文档

[下载：如何计算股票组合的权重.pdf](#)

[《股票型基金需要多久》](#)

[《购买新发行股票多久可以卖》](#)

[《股票涨幅过大停牌核查一般要多久》](#)

[《股票开户许可证要多久》](#)

[下载：如何计算股票组合的权重.doc](#)

[更多关于《如何计算股票组合的权重》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/34369672.html>