

股票投资组合的综合系数怎么算的--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。-股识吧

一、股票的综合指数是怎样算出来的？

$E(R) = R_f + \beta * [E(R) - R_f]$ // 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
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 $E(R) = 5\% + (0.5 * 2 + 0.5 * 1.2) * 6\% = 14.6\%$

二、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。

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

三、计算资产组合的 系数、必要收益率

$$\text{系数} = (A * 40\% + B * 10\% + C * 50\%) / 0.7 + 1.1 + 1.7$$

四、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

五、某公司购买甲、乙、丙三种股票进行投资组合，它们的系数分别为1.5、1.2和0.5，三种股票在投资组合中的比重分别为40%、30%和30%，股票的市场收益率为15%，无风险收益率为8%。则该投资组合的

abac

六、股票的综合指数是怎样算出来的？

举个例子，假设2005年12月31日整个A股股票总体平均价格是10元，定这一天为基期，基数定为1000点。假设现在A股股票总体平均价格是20元，那么当前(也就是计算期)股价是基期的 $20/10=2$ 倍，因此，当前股价指数就是 $2*1000$ (基期的1000点)=2000点。注：以上是基本原理，现实的股价计算要复杂的多，涉及各种平均法计算，和选样问题。

七、两种股票，系数为2和1.2。无风险报酬率为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

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

八、谁有股票投资组合的相关公式啊？？？

这些都是没用的，你搞得过庄家吗？金融投资，！股票：品种太多，有1000多只

票，有庄家在炒做，风险高，！T+1交易，就是当天买了，要隔天才能卖，每天限制涨跌10%（除权证），只能买涨，不能买跌，单项操作，机会少！资金运用不灵活！

基金：风险比股票小，收益不高！比放银行吃利息高那么点，！资金利用不灵活

期货：有合约限制，风险大，！

炒黄金，目前可以说是所以金融产品里面最有优势的产品，！

就黄金本身而言：黄金能够保持久远的价值 2) 黄金是对抗通货膨胀的最理想武器

3) 世界上最好的抵押品种 4) 与美圆一同作为世界各国金融储备

5) 产权转移的便利 6) 在税收上的相对优势 炒黄金的特点： 1：品种单一，

2：交易时间长，24小时即时交易，无须排队 3：金价波动大：

根据国际黄金市场行情，按照国际惯例进行报价。

因受国际上各种政治、经济因素，以及各种突发事件的影响，金价经常处于剧烈的波动之中，可以利用这差价进行实盘黄金现货交易。

4：操作简单：结合基本分析和技术分析；

掌握信息及时准确认真研判行情走势。

5：交易方式：有做多做空，机制灵活，涨跌均有机会 6：趋势好：

炒黄金在国内才刚刚兴起，股票、房地产、外汇等刚开始时利润可观，黄金也不会例外。

现在从K线图看，牛势才刚刚开始。

7：信息公开、公平、公正；

全球市场，没有任何机构可以控制价格 8：保值强：

黄金从古至今是最佳保值产品之一，升值潜力大；

现在世界上通货膨胀加剧，将推进黄金增值。

如果有需要，可以登陆我们公司网站 *24k168*点贵金属了解基本消息！

或者联系我 电话：0598-8883296转603 QQ：116516582

参考文档

[下载：股票投资组合的综合系数怎么算的.pdf](#)

[《股票是多久派一次股息》](#)

[《股票交易中午盘中休息一般多久》](#)

[《股票钱多久能到银行卡》](#)

[《股票一般多久一次卖出》](#)

[下载：股票投资组合的综合系数怎么算的.doc](#)

[更多关于《股票投资组合的综合系数怎么算的》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/35293928.html>