

svm预测股票收益率怎么算--如何计算股票预期收益？-股 识吧

一、google财经里的股息收益率是怎么算出来的？

股息可以采用不同的定义, 这个股息可以指去年股息, 也可以指今年预期股息.

二、股票预期收益率及标准差 标准离差计算

$r(B) = 12\% * 0.4 + 4\% * 0.4 + (-6\% * 20\%) = 5.2\%$
方差(B) = $(12\% - 5.2\%)^2 * 0.4 + (4\% - 5.2\%)^2 * 0.4 + (-6\% - 5.2\%)^2 * 0.2$
标准差(B) = 方差(B)的开方
 $r(A) = \text{四数和} / 4 = 6.5\%$
A的方差不会, 感觉少个相关系数, $\beta = 12\% / 20\% = 0.6$ 通过capm可以计算市场组合的收益率, 没有相关系数, 不能计算a的方差标准离差率是标准离差与期望值之比。

其计算公式为: 标准离差率 = 标准离差 / 期望值简单说就是一单位收益需要承担的风险, 风险越小越好! 市场组合白话说假如市场上有100只股票, 我构建一个市场组合包括所有的股票, 也就是100只, 比例按它们的市值当权数加权!

三、用matlab怎么算股票价格的收益率, 怎么得出收益率的图~

`price2ret(data)`表示将日指数转化为日收益率
`ret2price(data)`表示将日收益率转化为日指数

四、如何计算股票预期收益？

在衡量市场风险和收益模型中, 使用最久, 也是至今大多数公司采用的是资本资产定价模型(CAPM), 其假设是尽管分散投资对降低公司的特有风险有好处, 但大部分投资者仍然将他们的资产集中在有限的几项资产上。

比较流行的还有后来兴起的套利定价模型(APM), 它的假设是投资者会利用套利的机会获利, 既如果两个投资组合面临同样的风险但提供不同的预期收益率, 投资者会选择拥有较高预期收益率的投资组合, 并不会调整收益至均衡。

我们主要以资本资产定价模型为基础，结合套利定价模型来计算。

首先一个概念是 β 值。

它表明一项投资的风险程度： β 值=资产i与市场投资组合的协方差/市场投资组合的方差
市场投资组合与其自身的协方差就是市场投资组合的方差，因此市场投资组合的 β 值永远等于1，风险大于平均资产的投资 β 值大于1，反之小于1，无风险投资 β 值等于0。

需要说明的是，在投资组合中，可能会有个别资产的收益率小于0，这说明，这项资产的投资回报率会小于无风险利率。

一般来讲，要避免这样的投资项目，除非你已经很好到做到分散化。

下面一个问题是单个资产的收益率：一项资产的预期收益率与其 β 值线性相关：资产i的预期收益率 $E(R_i) = R_f + \beta_i [E(R_m) - R_f]$ 其中： R_f ：

无风险收益率 $E(R_m)$ ：市场投资组合的预期收益率 β_i ：投资i的 β 值。

$E(R_m) - R_f$ 为投资组合的风险溢价。

整个投资组合的 β 值是投资组合中各资产 β 值的加权平均数，在不存在套利的情况下，资产收益率。

对于多要素的情况： $E(R) = R_f + \beta [E(R_i) - R_f]$ 其中， $E(R_i)$ ：

要素i的 β 值为1而其它要素的 β 均为0的投资组合的预期收益率。

首先确定一个可接受的收益率，即风险溢价。

风险溢价衡量了一个投资者将其资产从无风险投资转移到一个平均的风险投资时所需要的额外收益。

风险溢价是你投资组合的预期收益率减去无风险投资的收益率的差额。

这个数字一般情况下要大于1才有意义，否则说明你的投资组合选择是有问题的。

风险越高，所期望的风险溢价就应该越大。

对于无风险收益率，一般是以政府长期债券的年利率为基础的。

在美国等发达市场，有完善的股票市场作为参考依据。

就目前我国的情况，从股票市场尚难得出一个合适的结论，结合国民生产总值的增长率来估计风险溢价未尝不是一个好的选择。

五、假设市场投资组合的收益率和方差分别为12%和0.25，无风险收益率为8%，A股票收益率的方差为0.16

$COV(K_a, K_m) = r \cdot \sigma_a \cdot \sigma_m = 0.4 \cdot (0.16^{0.5}) \cdot (0.25^{0.5}) = 0.4 \cdot 0.4 \cdot 0.5 = 0.08$ ， $COV(K_a, K_m)$ 是A股票收益与市场投资组合收益之间的协方差， r 是两者的相关系数， σ_a 是A股票收益的标准差，

σ_m 是市场投资组合收益的标准差 $\beta = COV(K_a, K_m) / (\sigma_a)^2 = 0.08 / 0.16 = 0.5$ ，

A股票的贝塔系数是0.5

A股票要求收益率=无风险收益率+ (市场投资组合收益率-

无风险收益率) * 贝塔系数 = $8\% + (12\% - 8\%) * 0.5 = 10\%$

六、资产定价模型里边的Rm在网上哪里能找到？或者市场上所有股票的平均报酬率怎么计算？请大虾给出详细方式！

Rm市场回报率接近GDP增长率，市场范围越大越接近社会平均回报率，可以替代使用或者略作修改使用！

七、如何计算收益率？

其实理财产品的收益和银行存款的利息计算方法是一样一样的。

它的计算公式是：收益 = 本金 * 理财天数 * 年化收益率 / 365天。

我们在选择理财产品时，会发现很多没说年化收益率，而是用了“7日年化收益”和“万份收益”来表示。

参考文档

[下载：svm预测股票收益率怎么算.pdf](#)

[《怎么知道一只股票有没有定增》](#)

[《股票封流比怎么计算》](#)

[《美股大跌a股星期一会怎么走》](#)

[《股票蓝线中有横线代表什么》](#)

[下载：svm预测股票收益率怎么算.doc](#)

[更多关于《svm预测股票收益率怎么算》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/68408018.html>