

股票期望值是什么值——什么是风险期望值?-股识吧

一、某股票的价格期望值是1000元，其贝塔系数为0.6，无风险利率为10%，全市场组合的预期收益率为17%.

设合理价格为x预期要求收益率=(1000-x)/x=无风险收益率10%+贝塔系数0.6*(17%-10%) 算出来x=876 很简单的呵呵

二、某种股票的期望收益率为10%，其标准离差为0.04，风险价值系数为30%，则该股票的风险收益率为

标准离差率 = 标准离差/期望值=0.04/10%=0.4

风险收益率 = 风险价值系数 × 标准离差率 = 30%*0.4=12%

三、股票期望收益率如何计算?

股票的预期收益率 $E(R_i) = R_f + [E(R_m) - R_f] \beta_i$ 其中： R_f ：

无风险收益率-----一般用国债收益率来衡量

$E(R_m)$ ：市场投资组合的预期收益率 β_i ：投资的价值-----市场投资组合的价值永远等于1，风险大于平均资产的投资价值大于1，反之小于1，无风险投资价值等于0

四、什么是风险期望值?

风险期望值，又称风险暴露值、预期货币值，是定量风险分析技术决策树风险货币项目的考虑。

正值表示机会，负值表示风险。

每个可能结果的数值与发生机率相乘后加总即得到。

项目风险概率和概率分布是项目风险度量中最基本的内容，项目风险度量的首要工作就是确定项目风险事件的概率分布。

一般说来，项目风险概率及其分布应该根据历史信息资料来确定。

当项目管理者没有足够历史信息和资料来确定项目风险概率及其分布时，也可以利用理论概率分布确定项目风险概率。

由于项目的一次性和独特性，不同项目的风险彼此相差很远，所以在许多情况下人们只能根据很少的历史数据样本对项目风险概率进行估计，甚至有时完全是主观判断。

因此，项目管理者在很多情况下要使用自己的经验，要主观判断项目风险概率及其概率分布，这样得到的项目风险概率被称为主观判断概率。

虽然主观判断概率是凭人们的经验和主观判断估算或预测出来的，但它也不是纯粹主观随意性的东西，因为项目管理者的主观判断是依照过去的经验做出的，所以它仍然具有一定的客观性。

五、股票投资收益期望值是什么

就是你想赚的收益

六、股票的贝塔值为1.2无风险利率为5%市场投资组合的期望收益率为10%按资本资产定价模型计算普通股资本成本

CAPM模型的形式。

$E(R_p) = R_f + \beta (E(R_M) - R_f)$ 其中 $\beta = \text{Cov}(R_i, R_M) / \text{Var}(R_M)$ $E(R_p)$ 表示投资组合的期望收益率， R_f 为无风险报酬率， $E(R_M)$ 表示市场组合期望收益率， β 为某一组合的系统风险系数，CAPM模型主要表示单个证券或投资组合同系统风险收益率之间的关系，也即是单个投资组合的收益率等于无风险收益率与风险溢价的和。

=====直接代入公式： $E(r_p) = 0.1$ ；

$$\beta = 1.2 ;$$

$$R_f = 0.05 ;$$

$$E(R_p) = R_f + \beta (E(R_M) - R_f) 0.1 = 0.05 + 1.2 (R_M -$$

$$0.05) R_M - 0.05 = (0.1 - 0.05) \div 1.2 R_M = 0.05 \div 1.2 + 0.05 = 0.1417 + 0.05$$

$$= 0.0917 \text{ 故，普通股资本的成本是 } 9.17\%$$

七、投资风险与股市风险系数（ β 系数），标准差和期望值的关

系

标准差和 是衡量证券风险的两个指标，侧重不同。

标准差强调的是证券自身的波动，波动越大，标准差越大，是绝对的波动的概念；证券A的标准差比证券B小，我们说，证券A的整体波动风险比较小，证券B的整体波动风险比较大。

标准差中，既包含了市场风险，又包含了该证券的特异风险，specificrisk。

相反， 强调的是相对于整个市场（M），这个证券的波动大小，是以整个市场为参照物的。

当市场波动1个百分点时，证券A波动1.25个百分点，所以我们说，证券A的市场风险较大；

证券B相对市场，则波动0.95个百分点，我们说，证券B的市场风险较小。

扩展资料：防范对策防范并化解财务风险。

以实现财务管理目标，是企业财务管理的工作重点。

 nbsp;nbsp; ;

(1)认真分析财务管理的宏观环境及其变化情况，提高适应能力和应变能力。

为防范财务风险，企业应对不断变化的财务管理宏观环境进行认真分析研究，把握其变化趋势及规律，并制定多种应变措施，适时调整财务管理政策和改变管理方法。

(2)不断提高财务管理人员的风险意识。

必须将风险防范贯穿于财务管理工作的始终。

(3)提高财务决策的科学化水平。

防止因决策失误而产生的财务风险。

在决策过程中。

应充分考虑影响决策的各种因素，尽量采用定量计算及分析方法并运用科学的决策模型进行决策。

对各种可行方案要认真进行分析评价。

从中选择最优的决策方案，切忌主观臆断。

(4)理顺企业内部财务关系，做到责、权、利相统一。

要明确各部门在企业财务管理中的地位、作用及应承担的职责，并赋予其相应的权力，真正做到权责分明，各负其责。

参考资料来源：股票百科-投资风险

八、股票，期望收益率，方差，均方差的计算公式

1、期望收益率计算公式： $HPR = (\text{期末价格} - \text{期初价格} + \text{现金股息}) / \text{期初价格}$ 例：
A股票过去三年的收益率为3%、5%、4%，B股票在下一年有30%的概率收益率为10

%, 40%的概率收益率为5%, 另30%的概率收益率为8%。

计算A、B两只股票下一年的预期收益率。

解：A股票的预期收益率 = $(3\% + 5\% + 4\%) / 3 = 4\%$ B股票的预期收益率

= $10\% \times 30\% + 5\% \times 40\% + 8\% \times 30\% = 7.4\%$ 2、在统计描述中，方差用来计算每一个变量（观察值）与总体均数之间的差异。

为避免出现离均差总和为零，离均差平方和受样本含量的影响，统计学采用平均离均差平方和来描述变量的变异程度。

扩展资料：1、协方差计算公式例： X_i 1.1 1.9 3, Y_i 5.0 10.4 14.6解： $E(X) =$

$(1.1+1.9+3)/3=2$ $E(Y) = (5.0+10.4+14.6)/3=10$ $E(XY)=(1.1 \times 5.0+1.9 \times 10.4+3 \times 14.6)/3=23$

.02 $Cov(X, Y)=E(XY)-E(X)E(Y)=23.02-2 \times 10=3.02$ 2、相关系数计算公式解：由上面的解题可求X、Y的相关系数为 $r(X, Y)=Cov(X, Y)/(\sigma_x \sigma_y)=3.02/(0.77 \times 3.93) = 0.9$

979参考资料来源：股票百科-期望收益率参考资料来源：股票百科-

协方差参考资料来源：股票百科-方差

九、什么是风险期望值?

风险期望值，又称风险暴露值、预期货币值，是定量风险分析技术决策树风险货币项目的考虑。

正值表示机会，负值表示风险。

每个可能结果的数值与发生机率相乘后加总即得到。

项目风险概率和概率分布是项目风险度量中最基本的内容，项目风险度量的首要工作就是确定项目风险事件的概率分布。

一般说来，项目风险概率及其分布应该根据历史信息资料来确定。

当项目管理者没有足够历史信息 and 资料来确定项目风险概率及其分布时，也可以利用理论概率分布确定项目风险概率。

由于项目的一次性和独特性，不同项目的风险彼此相差很远，所以在许多情况下人们只能根据很少的历史数据样本对项目风险概率进行估计，甚至有时完全是主观判断。

因此，项目管理者在很多情况下要使用自己的经验，要主观判断项目风险概率及其概率分布，这样得到的项目风险概率被称为主观判断概率。

虽然主观判断概率是凭人们的经验和主观判断估算或预测出来的，但它也不是纯粹主观随意性的东西，因为项目管理者主观判断是依照过去的经验做出的，所以它仍然具有一定的客观性。

参考文档

[下载：股票期望值是什么值.pdf](#)
[《转账到股票信用账户上要多久》](#)
[《德新交运股票停牌多久复牌》](#)
[《股票上升趋势多久比较稳固》](#)
[《财通证券股票交易后多久可以卖出》](#)
[《农民买的股票多久可以转出》](#)
下载：[股票期望值是什么值.doc](#)
[更多关于《股票期望值是什么值》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/author/27761817.html>