

如何计算股票投资组合的概率__三种股票投资组合风险计算-股识吧

一、三种股票投资组合风险计算

整个投资组合的方差

$=0.3 \times 0.3 \times 100 + 0.3 \times 0.3 \times 144 + 0.4 \times 0.4 \times 169 + 2 \times 0.3 \times 0.3 \times 120 + 2 \times 0.3 \times 0.4 \times 130 + 2 \times 0.3 \times 0.4 \times 156 = 139.24$

三个股票的投资组合方差 = $w_1 \times w_1 \times \text{股票1的方差} + w_2 \times w_2 \times \text{股票2的方差} + w_3 \times w_3 \times \text{股票3的方差} + 2 \times w_1 \times w_2 \times \text{股票1和2的协方差} + 2 \times w_1 \times w_3 \times \text{股票1和3的协方差} + 2 \times w_2 \times w_3 \times \text{股票2和3的协方差}$

二、证券投资组合的概率怎么算

成熟股投资收益率 = $0.1 \times 2\% + 0.3 \times 4\% + 0.4 \times 10\% + 0.2 \times 20\% = 9.4\%$ 成长股投资收益率 = $0.1 \times -3\% + 0.3 \times 3\% + 0.4 \times 7\% + 0.2 \times 10\% = 5.4\%$

两种股票组合投资收益率 = $50\% \times 0.094 + 50\% \times 0.054 = 0.074$

成熟股方差 = $0.1 \times (9.4\% - 2\%)^2 + 0.3 \times (9.4\% - 4\%)^2 + 0.4 \times (9.4\% - 10\%)^2 + 0.2 \times (9.4\% - 20\%)^2 = 0.003684$

成长股方差 = $0.1 \times [5.4\% - (-3\%)]^2 + 0.3 \times (5.4\% - 3\%)^2 + 0.4 \times (5.4\% - 7\%)^2 + 0.2 \times (5.4\% - 10\%)^2 = 0.001404$

两种股票的投资组合标准差 = $[50\% \times 50\% \times 0.003684 + 50\% \times 50\% \times 0.001404 + 2 \times 50\% \times 50\% \times (0.003684 \times 0.001404)^{(1/2)} \times 0.89]^{(1/2)} = 0.0478$

注：两个投资组合方差 = 投资组合A比例的平方 * 投资组合A的方差 + 投资组合B比例的平方 * 投资组合B的方差 + $2 \times \text{投资组合A比例} \times \text{投资组合B比例} \times \text{投资组合A的标准差} \times \text{投资组合B的标准差} \times \text{两种股票之间的相关系数}$

三、两种股票，β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β系数=1.2，两种股票最低的β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

四、投资组合收益率

成熟股投资收益率=0.1*2%+0.3*4%+0.4*10%+0.2*20%=9.4%成长股投资收益率=0.1*-3%+0.3*3%+0.4*7%+0.2*10%=5.4%两种股票组合投资收益率=50%*0.094+50%*0.054=0.074成熟股方差=0.1*(9.4%-2%)^2+0.3*(9.4%-4%)^2+0.4*(9.4%-10%)^2+0.2*(9.4%-20%)^2=0.003684成长股方差=0.1*[5.4%-(-3%)]^2+0.3*(5.4%-3%)^2+0.4*(5.4%-7%)^2+0.2*(5.4%-10%)^2=0.001404两种股票的投资组合标准差=[50%*50%*0.003684+50%*50%*0.001404+2*50%*50%*(0.003684*0.001404)^(1/2)*0.89]^(1/2)=0.0478注：两个投资组合方差=投资组合A比例的平方*投资组合A的方差+投资组合B比例的平方*投资组合B的方差+2*投资组合A比例*投资组合B比例*投资组合A的标准差*投资组合B的标准差*两种股票之间的相关系数

五、投资组合的收益率计算

是等比例吧,如果是的话,算术平均就可.(5,5+7,5+11.5)/3=8.67%

六、请问股票指数基金投资组合分配比例是怎么计算出的？基金新人

是按你投资债券基金（或股票基金）占总投资的比例来算的。
比如你拿出10万购买基金，其中3万买债券基金，7万买股票基金，那么投资比例就是“30%的债券指数基金和70%的股票指数基金”。

基金按投资风险大小共分为四种，货币性、债券型、混合型、股票型，这四种基金的风险是依次增大的，收益与风险一般是成正比。

也就是货币基金风险最小，收益也最小。

股票基金风险最大，收益也最大。

按你说的“30%的债券指数基金和70%的股票指数基金”投资比例来看，股票基金比例偏高，风险很高，适合稳健型或成长型基民。

参考文档

[下载：如何计算股票投资组合的概率.pdf](#)

[《上海科创板是什么部门》](#)

[《女朋友让我买股票怎么办》](#)

[《股票价格高低变化与什么有关》](#)

[《股票涨了仓位怎么计算》](#)

[下载：如何计算股票投资组合的概率.doc](#)

[更多关于《如何计算股票投资组合的概率》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/book/33863705.html>