

股票组合的希腊值怎么计算~某投资组合中甲乙丙丁四种股票分别为0.5、0.5、0.25、0.15、0.1，系数分别为甲=1.5、乙=3、丙=2、丁=1-股识吧

一、投资组合收益率

选择零增长模型。

戈登股利增长模型又称为“股利贴息不变增长模型”、“戈登模型(Gordon Model)”，零增长模型假定股利增长率等于零，即 $G=0$ ，也就是说未来的股利按一个固定数量支付。

零增长模型实际上是不变增长模型的一个特例。

零增长模型的应用似乎受到相当的限制，毕竟假定对某一种股票永远支付固定的股利是不合理的。

但在特定的情况下，在决定普通股票的价值时，这种模型也是相当有用的，尤其是在决定优先股的内在价值时。

因为大多数优先股支付的股利不会因每股收益的变化而发生改变，而且由于优先股没有固定的生命期，预期支付显然是能永远进行下去的。

股票内在价值的计算方法模型有: A.现金流贴现模型 B.内部收益率模型

C.零增长模型 D.不变增长模型 E.市盈率估价模型

二、如何计算股票历史波动率 详细 0 3

财富创业板技巧：下面以计算股票的历史波动率为例加以说明。

- 1、从市场上获得标的股票在固定时间间隔(如每天、每周或每月等)上的价格。
- 2、对于每个时间段，求出该时间段末的股价不该时段初的股价之比的自然对数。
- 3、求出这些对数值的标准差，再乘以一年中包含的时段数量的平方根(如，选取时间间隔为每天，则若扣除闭市，每年中有250个交易日，应乘以根号250)，得到的即为历史波动率。

历史波动率是基于过去的统计分析得出的，假定未来是过去的延伸，利用历史方法估计波动率类似于估计标的资产收益系列的标准差。

在股票市场中，历史波动率反映标的股价过去的波动。

然而，由于股价波动难以预测，利用历史波动率对权证价格进行预测一般都不能保证准确，但是由于目前我国内地没有权证市场，因而无法获得权证价格，也就无法计算隐含波动率。

因此权证发行商不投资者在权证发行初期只能利用历史波动率作参考。

三、道琼斯指数是如何计算的

1. 股价平均数的计算 股票价格平均数反映一定时点上市股票价格的绝对水平，它可分为简单算术股价平均数、修正的股价平均数、加权股价平均数三类。

人们通过对不同时点股价平均数的比较，可以看出股票价格的变动情况及趋势。

(1)简单算术股价平均数

简单算术股价平均数是将样本股票每日收盘价之和除以样本数得出的，即：

简单算术股价平均数 = $(P_1 + P_2 + P_3 + \dots + P_n)/n$ 世界上第一个股票价格平均——道·琼斯股价平均数在1928年10月1日前就是使用简单算术平均法计算的。

现假设从某一股市采样的股票为A、B、C、D四种，在某一交易日的收盘价分别为10元、16元、24元和30元，计算该市场股价平均数。

将上述数置入公式中，即得：股价平均数 = $(P_1 + P_2 + P_3 + P_4)/n$
= $(10 + 16 + 24 + 30) / 4 = 20$ (元)

四、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 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 $E(R) = 5\% + (0.5 * 2 + 0.5 * 1.2) * 6\% = 14.6\%$

五、某投资组合中甲乙丙丁四种股票分别为0.5、0.5、0.25、0.15、0.1， 系数分别为甲=1.5、乙=3、丙=2、丁=1

(1) 风险报酬率的计算公式：式中： K_R 表示风险报酬率；

β 表示风险报酬系数；

V 表示标准离差率。

则在不考虑通货膨胀因素的影响时，投资的总报酬率为： $K = R_F + K_R = R_F + \beta * V$

其中：K表示投资报酬率；

RF表示无风险报酬率。

(2) 期望收益率== (期末价格 - 期初价格 + 现金股息) / 期初价格

甲乙丙丁分别套进去计算就可以了。

六、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

七、股票内在价值的计算方法模型中，假定股票永远支付固定的股利的模型是？

选择零增长模型。

戈登股利增长模型又称为“股利贴息不变增长模型”、“戈登模型(Gordon Model)”，零增长模型假定股利增长率等于零，即 $G=0$ ，也就是说未来的股利按一个固定数量支付。

零增长模型实际上是不变增长模型的一个特例。

零增长模型的应用似乎受到相当的限制，毕竟假定对某一种股票永远支付固定的股利是不合理的。

但在特定的情况下，在决定普通股票的价值时，这种模型也是相当有用的，尤其是在决定优先股的内在价值时。

因为大多数优先股支付的股利不会因每股收益的变化而发生改变，而且由于优先股没有固定的生命期，预期支付显然是能永远进行下去的。

股票内在价值的计算方法模型有: A. 现金流贴现模型 B. 内部收益率模型

C. 零增长模型 D. 不变增长模型 E. 市盈率估价模型

八、若某一股票的期望收益率为12%，市场组合期望收益率为15%，无风险利率为8%，计算该股票的β值。

该股票相对于市场的风险溢价为： $12\% - 8\% = 4\%$ 市场组合的风险溢价为： $15\% - 8\% = 7\%$
该股票的β值为： $4\% / 7\% = 4/7$

九、这道排列组合的题怎么算？

展开全部考虑到5位数，为满足特殊条件，必须要有2个或以上的奇数，所以从3个奇数当中选出2个或3个进行排列 $P(3,2)$ 或 $P(3,3)$ 。

当奇数为 $P(3,2)$ 个时，要有加入其它3个偶数，考虑到这时有2个奇数，它们的周围有3个空位用来排列3个偶数，并且第一位不为0，所以0只能排到第2或3个空位上，有 $2 * P(2,2)$ 个排法，所以当选出2个奇数的时候，满足条件的排列为： $P(3,2) * 2 * P(2,2)$

当奇数为 $P(3,3)$ 时，需要再加入2个偶数，这时3个奇数的周围有4个空位，如下所示：
 $^1 1 ^1 1 ^1$ 其中^表示空位，1表示奇数此时若偶数中含有0，则有 $C(2,1)$ 种选法，当0在第2或3个位置时，偶数可选择的空位有 $2 * 2$ 种，当0不在第2或3位置时，有2种选法此时满足条件的排列为： $C(2,1) * (2 * 2 + 2) * P(3,3)$ 。

当偶数中不选择0的时候，有 $P(2,2)$ 种选法，此时2或3选1个空位，1或4选1个空位所以满足条件的排列为 $P(2,2) * 2 * 2 * P(3,3)$ 。

所以一共有： $P(3,2) * 2 * P(2,2) + C(2,1) * (2 * 2 + 2) * P(3,3) + P(2,2) * 2 * 2 * P(3,3)$ 种排列组合。

参考文档

[下载：股票组合的希腊值怎么计算.pdf](#)

[《川恒转债多久变成股票》](#)

[《蜻蜓点睛股票卖出后多久能取出》](#)

[《股票违规停牌一般多久》](#)

[下载：股票组合的希腊值怎么计算.doc](#)

[更多关于《股票组合的希腊值怎么计算》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/book/67951386.html>