

股票收益率用什么模型计算__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-股识吧

一、股票收益率怎么算

股票收益率= (股票现价-股票买入价) / 股票买入价 比如5元买进，现在6元，计算方法是：(6-5) / 5 = 20% 收益率就是20%

二、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。

$E(R_p) = R_f + \beta (R_M - R_f)$ 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： $E(r_p) = 0.1$ ；

$\beta = 1.2$ ；

$R_f = 0.05$ ；

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

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

$= 0.0917$ 故，普通股资本的成本是9.17%

三、股票收益率的计算公式是什么？复杂吗？

股票收益率是反映股票收益水平的指标。

投资者购买股票或债券最关心的是能获得多少收益，衡量一项证券投资收益大小以收益率来表示。

反映股票收益率的高低，一般有三个指标： 本期股利收益率。

是以现行价格购买股票的预期收益率。

持有期收益率。

股票没有到期，投资者持有股票的时间有长有短，股票在持有期间的收益率为持有期收益率。

折股后的持有期收益率。

股份公司进行折股后，出现股份增加和股价下降的情况，因此，折股后股票的价格必须调整。

股票收益率=收益额/原始投资额当股票未出卖时，收益额即为股利。

衡量股票投资收益水平指标主要有股利收益率、持有期收益率与拆股后持有期收益率等。

四、每日的股价我有，他的日收益率，日波动率我也算出来了，那个 kmv模型公式 我看不懂，不知道该怎么

大盘调整风险也在加大，而且一旦量价背离局面严重起来，调整力度还会很大。

只是这些不确定性现在已经被淹没在超级大盘股的拉升中。

股民此时不能盲目追涨，为高位的筹码埋单，要操作需要从板块轮动角度，对有成长性的二线蓝筹股给予关注，

五、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 值线形相关：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 值。

$E(R_m)-R_f$ 为投资组合的风险溢价。

整个投资组合的 值是投资组合中各资产 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： $E(R)=R_f+ \sum \beta_i[E(R_i)-R_f]$ 其中， $E(R_i)$ ：

要素i的 值为1而其它要素的 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。

六、股票收益的计算

实际每股收益大概等于： $24 * (1 - 2\%) = 23.52$ 元

七、股票收益率的计算公式是什么？复杂吗？

大盘调整风险也在加大，而且一旦量价背离局面严重起来，调整力度还会很大。

只是这些不确定性现在已经被淹没在超级大盘股的拉升中。

股民此时不能盲目追涨，为高位的筹码埋单，要操作需要从板块轮动角度，对有成长性的二线蓝筹股给予关注，

八、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

参考文档

[下载：股票收益率用什么模型计算.pdf](#)

[《股票型基金需要多久》](#)

[《股票停止交易多久》](#)

[《股票st到摘帽需要多久》](#)

[下载：股票收益率用什么模型计算.doc](#)

[更多关于《股票收益率用什么模型计算》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/read/28580484.html>