

## 两只股票的组合收益率怎么算，股票的组合收益率，组合方差怎么求？-股识吧

一、知道A，B两只股票的期望收益率分别是13%和18%，贝塔值分别为0.8和1.2

设市场收益率为 $R_M$ ，无风险收益率为 $R_F$ ，则 $13 = R_F + 0.8 * (R_M - R_F)$   $18 = R_F + 1.2 * (R_M - R_F)$  解二元一次方程组，得 $R_M = 15.5\%$   $R_F = 3\%$  同期，无风险利率为3%，市场组合收益率为15.5%

## 二、股票组合的加权平均收益怎么算

$(A \text{ 股票的盈亏幅度} * \text{持有的股数} + B \text{ 股票的盈亏程度} * \text{持有股数}) / \text{投入的总资金量} * 100\%$

## 三、多个证券组合，其风险和收益怎么求？

$0.3 * 0.4 + 0.25 * (-0.1) + 0.45 * 0.15$  这个就是你的期望收益啊求风险还需要计算收益率的方差。

四、证券投资组合计算题。若两股票Z与Y的收益率均值分别为0.05和0.03，

方差为0.36%和0.16%，若相关系数为 $P(ZY) = 0...$

五、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 $\beta$ 等于每种资产的 $\beta$ 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  $E(R) = 5\% + (0.5 * 2 + 0.5 * 1.2) * 6\% = 14.6\%$

## 六、两种股票, $\beta$ 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 $\beta$ 系数=1.2, 两种股票最低的 $\beta$ 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%

## 八、投资者预期当市场组合的收益率为6%时, A、B两支股票的收益率将是3%和8%, 当市场组合的收益率为18%时, A、B

设两股票的 $\beta$ 分别为  $\beta_A$  和  $\beta_B$ , 无风险利率为5, 则  $3 = 5 + \beta_A * (6 - 5) + \beta_B * (6 - 5)$   
 $8 = 5 + \beta_A * (18 - 5) + \beta_B * (18 - 5)$

由1) 和3) 解得,  $\beta_A = 2$ ,  $\beta_B = -4\%$   
由2) 和4) 解得,  $\beta_A = 0.6$ ,  $\beta_B = 2.4\%$   
第一第二问的 $\beta$ 和 $\beta_B$ , 就求出来了。

若想构筑无风险套利, 让AB股票构成的组合的 $\beta$ 值为零, 设A股票的权重为 $x$ , B的权重为 $1 - x$ , 则  $2x + 0.6(1 - x) = 0$  解得  $x = -3/7$

A股票的权重为 $-3/7$ , B股票权重为 $10/7$  A的权重为负值, 是卖空。

供参考。

## 九、股票的组合收益率，组合方差怎么求？

分散投资降低了风险（风险至少不会增加）。

组合预期收益率= $0.5*0.1+0.5*0.3=0.2$  两只股票收益的协方差= $-0.8*0.3*0.2=-0.048$

组合收益的方差= $(0.5*0.2)^2+(0.5*0.3)^2+2*(-0.8)*0.5*0.5*0.3*0.2=0.0085$

组合收益的标准差=0.092 组合前后发生的变化：组合收益介于二者之间；  
风险明显下降。

## 参考文档

[下载：两只股票的组合收益率怎么算.pdf](#)

[《股票多久可以买卖次数》](#)

[《股票涨幅过大停牌核查一般要多久》](#)

[《股票盘中临时停牌多久》](#)

[下载：两只股票的组合收益率怎么算.doc](#)

[更多关于《两只股票的组合收益率怎么算》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/read/37167835.html>