

投资学股票组合的收益率怎么计算|有分求助！关于证券投资组合期望收益率和无风险利率的计算-股识吧

一、股票收益率怎么求

你想知道谁的收益率？如果是数据中每天的收益率，就是最后一项的涨跌幅。如果是买卖收益率，就是：卖出获得的钱÷买入花的钱-1=股票买卖的收益率以此类推谢谢你的提问

二、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。

三、请教各位：如何运用三因素模型的组合收益率，来计算

您好运用三因素模型的组合收益率根本没有办法计算的，建议您现在做股票要快进快出，不要做中长线为好，因为现在的股票市场很不稳定，今天是超跌反弹，明天就是一次大跌，我国的股市已经进入下跌行情，加上诸多经济问题，股票市场今年几乎不会有很好的机会了，作为理财师我的经验告诉我，估计下星期还会下跌，所以您要注意资金安全，有什么问题可以继续问我，真诚回答，恳请您采纳！

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

- 1) 选择单一资产投资时，黄金由于收益率低，风险高，所以不会有人选择投资黄金。
- 2) 由于黄金与股票的相关系数为1（即完全正相关），黄金与股票的投资组合并不能抵消风险，所以投资组合中不会持有黄金。
上述假设并不能代表证券市场的均衡，因为股票收益率更高，风险更小。

五、股票估值中市场组合的预期收益率是怎么取值的？

你是说资本资产定价模型吗？CAPM。

你说的这个问题我从前也思考过。

我的一些结论：（1）CAPM模型的目的是评估风险，市场的预期收益实际是为了带入公式后计算单个资产的风险的。

（为了贴现估值时作为贴现率用）（2）从公式可以知道，其他条件不变，市场预期收益率越低，计算出的单个资产风险越小。

（3）仔细思考可得，实际上市场收益率的确定取决于投资者自己的风险偏好和该投资项目的一般预期回报和风险。

（4）我觉得如下几种取值比较合理：

A，取市场的长期收益率的几何平均值，中国股市大约是16%-17%。

B，用无风险收益率+风险溢价（无风险收益率取当下的5年期国债收益率，风险溢价可以用市场平均偏差和其他主观因素调整）

顺便说一下这其中在实践中的难点。

因为中国股市在过去20年中是高波动的，所以你算出来的贴现率可能非常大，这个在实践中是有问题的。

巴菲特在估值的时候他是直接用无风险收益率，因为他认为他选的股风险小。

六、请问在知道一个股票组合中三只股票的 系数和他们所占的比例的情况向，如何算出这个股票组合的 系数。

用各自的 系数乘以各自的资金所占百分比，再求和即可。

证券之星问股

七、有分求助！关于证券投资组合期望收益率和无风险利率的计算

资本资产定价模型公式为 证券收益率=无风险收益率+贝塔值*（市场收益率—无风险收益率）根据此公式，联立方程组 $25\% = \text{无风险收益率} + 1.5 * (\text{市场收益率} - \text{无风}$

险收益率) $15\% = \text{无风险收益率} + 0.9 * (\text{市场收益率} - \text{无风险收益率})$ 解得：市场收益率 = $1/6$ 无风险收益率 = 0

八、投资学习题：股票提供的期望收益率为18%，标准差为22%。黄金提供的期望收益率为10%，标准差为30%。

- 1) 选择单一资产投资时，黄金由于收益率低，风险高，所以不会有人选择投资黄金。
- 2) 由于黄金与股票的相关系数为1（即完全正相关），黄金与股票的投资组合并不能抵消风险，所以投资组合中不会持有黄金。
上述假设并不能代表证券市场的均衡，因为股票收益率更高，风险更小。

参考文档

[下载：投资学股票组合的收益率怎么计算.pdf](#)

[《股票委托多久才买成功》](#)

[《基金多久更换一次股票》](#)

[《财通证券股票交易后多久可以卖出》](#)

[《一只股票从增发通告到成功要多久》](#)

[下载：投资学股票组合的收益率怎么计算.doc](#)

[更多关于《投资学股票组合的收益率怎么计算》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/read/64397510.html>