

股票预期风险怎么计算公式__股票风险溢价怎么计算？ - 股识吧

一、一只股票的贝塔系数是1.3，市场的期望收益率是14%，无风险利率是5%。这只股票的预期风险必须是多少？

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 β 值线性相关：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 β 值。

$E(R_m) - R_f$ 为投资组合的风险溢价。

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

要素i的 β 值为1而其它要素的 β 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。

二、一只股票的贝塔系数是1.3，市场的期望收益率是14%，无风险利率是5%。这只股票的预期风险必须是多少？

$E(R) = R_f + \beta * [E(R) - R_f]$ // 期望收益等于无风险收益加上风险溢价
期望收益 = 无风险收益 + (市场预期收益 - 无风险收益) ;
预期风险 = 期望收益 - 市场预期收益
证券市场线方程为 $E(r) = 5\% + \beta * (14\% - 5\%)$ 即 $E(r) = 0.05 + 1.3 * 0.09 = 0.167 = 16.7\%$ 即风险收益率是16.7%。

三、请问风险怎么算

风险等于风险发生的概率乘以风险的后果

四、股票风险溢价怎么计算？

风险溢价计算公式：有风险的投资工具的报酬率与无风险报酬率的差额，风险溢价指的是投资人要求较高的收益以抵消更大的风险，而风险溢价是金融经济学的一个核心概念，对资产选择的决策，资本成本以及经济增值(EVA)的估计具有非常重要的

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 β 值线性相关：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 β 值。

$E(R_m) - R_f$ 为投资组合的风险溢价。

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

要素 i 的 β 值为 1 而其它要素的 β 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、怎样计算股票的系统风险和非系统风险

1. 系统风险不过是股票价格和本质脱离构成背离关系。

2. 非系统不过就是股民常常看的那些所谓公司分红。

公告，炒作，这些对股票都是暂时性的，跟去大趋势，时期背景，相干法律来掌控估计系统风险。

3. 系统性风险是指由于公司外部、不为公司所预计和控制的因素造成的风险。

通常表现为国家、地区性战争或骚乱，全球性或区域性的石油恐慌，国民经济严重衰退或不景气，国家出台不利于公司的宏观经济调控的法律法规，中央银行调整利率等。

4. 非系统性风险是由股份公司自身某种原因而引起证券价格的下跌的可能性，它只存在于相对独立的范围，或者是个别行业中，它来自企业内部的微观因素。

七、股市里的风控怎么计算

展开全部股市里的风控怎么计算简单说就是设定一些条件控制和降低风险，但是降低风险的同时也会降低收益，总的来说利大于弊，

参考文档

[下载：股票预期风险怎么计算公式.pdf](#)

[《上市公司股本增减变动是什么》](#)

[《欧亚集团为什么这么低估》](#)

[《同花顺融资融券户怎么看盈亏》](#)

[《盘后交易怎么看》](#)

[下载：股票预期风险怎么计算公式.doc](#)

[更多关于《股票预期风险怎么计算公式》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/store/23392843.html>