

**如何求三只股票组合的期望收益率比\_\_某人投资三种股票，这三只股票年预期收益率分别为A15%，B10%，C5%！投资比例为A0.5，B0.3，C0.2！-股识吧**

## 一、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！

**二、某人投资三种股票，这三只股票年预期收益率分别为A15%，B10%，C5%！投资比例为A0.5，B0.3，C0.2！**

搜一下：收益率分别为17%，-13%，和6%的三只股票的等权重股价指数怎么求

**三、已知某股票近三年的收益率，市场组合收益率，市场组合标准差，无风险收益率，如何求股票的期望报酬率？？**

甲股票的期望收益率为  $(10\%+6\%+8\%)/3=8\%$

乙股票的期望收益率为  $(7\%+13\%+10\%)/3=10\%$

**四、如何通过股票走势图求出股票的期望收益率？**

假定投资者将无风险的资产和一个风险证券组合再构成一个新的证券组合，投资者可以在资本市场上将以不变的无风险的资产报酬率借入或贷出资金。

在这种情况下，如何计算新的证券组合的期望报酬率和标准差？假设投资于风险证券组合的比例（投资风险证券组合的资金/自有资金）为Q，那么1-Q为投资于无风险资产的比例。

无风险资产报酬率和标准差分别用 $r_{无}$ 、 $\sigma_{无}$ 表示，风险证券组合报酬率和标准差分别用 $r_{风}$ 、 $\sigma_{风}$ 表示，因为无风险资产报酬率是不变的，所以其标准差应等于0，而无风险的报酬率和风险证券组合的报酬率不存在相关性，即相关系数等于0。

那么新的证券组合的期望报酬率和标准差公式分别为： $r_P = Qr_{风} + (1-Q)r_{无}$

## 五、某人投资三种股票，这三只股票年预期收益率分别为A15%，B10%，C5%！投资比例为A0.5，B0.3，C0.2！

设本金为D，投入的资金分别为A：0.5D B：0.3D C：0.2D总收益为： $0.5D*15\%+0.3D*10\%+0.2D*5\%=D*11.5\%$ 组合投资收益率为： $D*11.5\%/D=11.5\%$

## 参考文档

[下载：如何求三只股票组合的期望收益率比.pdf](#)

[《股票保价期是多久》](#)

[《股票放多久才能过期》](#)

[《公司上市多久后可以股票质押融资》](#)

[《股票多久才能反弹》](#)

[《农民买的股票多久可以转出》](#)

[下载：如何求三只股票组合的期望收益率比.doc](#)

[更多关于《如何求三只股票组合的期望收益率比》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/32739091.html>