

无风险收益率如何预测股票；已知两只股票相关系数为-1，如何求无风险利率，谢谢啦~~~-股识吧

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

二、宏民公司股票的系数为1.5，无风险收益率为4%，市场上所有股票的平均收益率为8%

三、宏民公司股票的系数为1.5，无风险收益率为4%，市场上所有股票的平均收益率为8%

$4 + (8 - 4) * 1.5 = 10$ 所以股票的预计收益率是10%

四、已知两只股票相关系数为-1，如何求无风险利率，谢谢啦~~~

列两个方程组，可以参考无风险套利推导公式++

五、已知某公司的 β 值为1.5，无风险收益率为4%，风险溢价为8

% , 则该公司股票的预期收益率 要公式和过

股票的预期收益率 $E(R_i) = R_f + [E(R_m) - R_f] = 4\% + 1.5 \times (8\% - 4\%) = 10\%$ 其中： R_f ：无风险收益率——一般用国债收益率来衡量 $E(R_m)$ ： β ：系统风险度；

参考文档

[下载：无风险收益率如何预测股票.pdf](#)

[《股票主力持仓突然大幅增加说明什么》](#)

[《股票里的5条均线什么意思》](#)

[《用什么办法选出股票母子均线》](#)

[《披露年中报对股票有什么影响》](#)

[下载：无风险收益率如何预测股票.doc](#)

[更多关于《无风险收益率如何预测股票》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/44841157.html>