

风险管理的百分比收益率是怎样的？

百分比收益率:

百分比收益率是当期资产总价值的变化及其现金收益占期初投资额的百分比。百分比收益率通常用百分数表示。假定期初的投资额为 P_0 ，在期末时资产的价值为 P_1 ，则百分比收益率(R)定义为期初每一单位货币投资所带来的收益，用数学公式可表示为： $R=(P_1-P_0+D)/P_0$ 。

风险收益率如何计算公？风险收益率如何计算公式

$$R_r = \beta * V$$

式中： R_r 为风险收益率；

β 为风险价值系数；

V 为标准离差率。

$$R_r = \beta * (K_m - R_f)$$

式中： R_r 为风险收益率；

β 为风险价值系数；

K_m 为市场组合平均收益率；

R_f 为无风险收益率

$(K_m - R_f)$ 为市场组合平均风险报酬率

风险收益率是投资收益率与无风险收益率之差；

风险收益率是风险价值系数与标准离差率的乘积；

扩展资料：

风险收益率，就是由投资者承担风险而额外要求的风险补偿率。风险收益率包括违

约风险收益率，流动性风险收益率和期限风险收益率。

影响因素：

风险大小和风险价格。在风险市场上，风险价格的高低取决于投资者对风险的偏好程度。

风险收益率包括违约风险收益率，流动性风险收益率和期限风险收益率。