

股票中beta是什么意思中文：beta中文意思?属于证券类的英语单词或缩写.-股识吧

一、如何解释一只股票的Beta值接近于1

beta值，是一种风险指数，用来衡量个别股票或股票基金相对于整个股市的价格波动情况。

β 值越高，意味着股票相对于业绩评价基准的波动性越大，反之亦然。

当 $\beta = 1$ 时，表示该股票的收益和风险与大盘指数收益和风险一致；

当 $\beta > 1$ ；

1时，表示该股票收益和风险均大于大盘指数的收益和风险。

二、股票中的 β 系数是什么意思

贝塔系数 β 是指个股受大盘的影响程度，举个例子：如果 β 为 1，则市场上涨 10%，股票上涨 10%；

市场下滑 10%，股票相应下滑 10%。

如果 β 为 1.1，市场上涨 10% 时，股票上涨 11%，；

三、如何解释一只股票的Beta值接近于1

其绝对值越大，显示其收益变化幅度相对于大盘的变化幅度越大；

绝对值越小，显示其变化幅度相对于大盘越小。

如果是负值，则显示其变化的方向与大盘的变化方向相反；

大盘涨的时候它跌，大盘跌的时候它涨。

由于我们投资于投资基金的目的是为了取得专家理财的服务，以取得优于被动投资于大盘的表现情况，这一指标可以作为考察基金经理降低投资波动性风险的能力。

在计算贝塔系数时，除了基金的表现数据外，还需要有作为反映大盘表现的指标。

贝塔系数(Beta coefficient)是一种评估证券系统性风险的工具，用以度量一种证券或一个投资证券组合相对总体市场的波动性。

在股票、基金等投资术语中常见。

$\beta = 0$ 表示没有风险， $\beta = 0.5$ 表示其风险仅为市场的一半， $\beta = 1$ 表示风险与市场风险相同， $\beta = 2$ 表示其风险是市场的2倍。

贝塔系数反映了个股对市场(或大盘)变化的敏感性，也就是个股与大盘的相关性或通俗说的“股性”。

可根据市场走势预测选择不同的贝塔系数的证券从而获得额外收益，特别适合作波段操作使用。

当有很大把握预测到一个大牛市或大盘某个不涨阶段的到来时，应该选择那些高贝塔系数的证券，它将成倍地放大市场收益率，为你带来高额的收益；

相反在一个熊市到来或大盘某个下跌阶段到来时，你应该调整投资结构以抵御市场风险，避免损失，办法是选择那些低贝塔系数的证券。

为避免非系统风险，可以在相应的市场走势下选择那些相同或相近贝塔系数的证券进行投资组合。

更多股票学习内容请访问棒槌网！

四、股票中beta值可以为负值吗？

股票 β 值表示投资组合对系统风险的敏感程度： β 值为1，表示指数变化时，股票价格会以相同的百分率变化；

β 值为1.8时，表示指数发生1%的变动，股票价格会呈现1.8%的变动；

β 值为0.5时，表示指数发生1%的变动，股票价格会呈现0.5%的变动。

行情上涨时，一般选取 β 值偏高的投资组合；

行情下跌时，一般选取 β 值偏低的投资组合，这样才能取得最佳收益。

当然， β 值是历史数据的统计，有一定的时效性，这一点在应用时必须考虑。

贝塔系数是量度股票投资系统风险的指标。

所谓系统风险是指股票投资中没有办法通过分散投资来减低的风险，即是由整体经济状况和整体市场因素所造成的风险(如利率变动)，与个别公司没有直接的关系。

与其相对的是非系统风险，即由个股的个别因素(如会计丑闻)所造成的风险，是可以通过分散投资来消弭掉的。

金融学运用了贝塔系数来计算在一只股票上投资者可期望的合理风险回报率：

个股合理回报率 = 无风险回报率 + $\beta \times (\text{整体股市回报率} - \text{无风险回报率})$

*可用基准债券的收益率代表 贝塔系数=1，代表该个股的系统风险等同大盘整体系统风险，即受整体经济因素影响的程度跟大盘一样；

贝塔系数>1则代表该个股的系统风险高于大盘，即受整体经济因素影响的程度甚于大盘。

贝塔系数越高，投资该股的系统风险越高，投资者所要求的回报率也就越高。

高贝塔的股票通常属于景气循环股(cyclicals)，如地产股和耐用消费品股；

低贝塔的股票亦称防御类股(defensive)

stocks), 其表现与经济景气的关联度较低, 如食品零售业和公用事业股。个股的贝塔系数可能会随着大盘的升或跌而变动, 有些股票在跌市中可能会较在升市具更高风险。

五、股票的 β 系数

目录 · 贝塔系数(β) · β 系数计算方式 · Beta 的含义 · Beta 的一般用途 贝塔系数(β)

贝塔系数衡量股票收益相对于业绩评价基准收益的总体波动性, 是一个相对指标。

β 越高, 意味着股票相对于业绩评价基准的波动性越大。

β 大于 1, 则股票的波动性大于业绩评价基准的波动性。

反之亦然。

如果 β 为 1, 则市场上涨 10%, 股票上涨 10%;

市场下滑 10%, 股票相应下滑 10%。

如果 β 为 1.1, 市场上涨 10% 时, 股票上涨 11%, ;

市场下滑 10% 时, 股票下滑 11%。

如果 β 为 0.9, 市场上涨 10% 时, 股票上涨 9%;

市场下滑 10% 时, 股票下滑 9%。

β 系数计算方式 (注: 杠杆主要用于计量非系统性风险) (一) 单项资产的 β 系数 单项资产系统风险用 β 系数来计量, 通过以整个市场作为参照物, 用单项资产的风险收益率与整个市场的平均风险收益率作比较, 即:

$\beta = *$: //szacc*/Files/BeyondPic/20051214202206830.gif 另外, 还可按协方差公式计算 β 值, 即 $\beta = *$: //szacc*/Files/BeyondPic/20051214202207148.gif

注意: 掌握 β 值的含义 ◆ $\beta = 1$, 表示该单项资产的风险收益率与市场组合平均风险收益率呈同比例变化, 其风险情况与市场投资组合的风险情况一致;

◆ $\beta > 1$;

1, 说明该单项资产的风险收益率高于市场组合平均风险收益率, 则该单项资产的风险大于整个市场投资组合的风险;

◆ $\beta < 1$;

1, 说明该单项资产的风险收益率小于市场组合平均风险收益率, 则该单项资产的风险程度小于整个市场投资组合的风险。

小结: 1) β 值是衡量系统性风险, 2) β 系数计算的两种方式。

Beta 的含义 Beta 系数起源于资本资产定价模型(CAPM 模型), 它的真实含义就是特定资产(或资产组合)的系统风险度量。

所谓系统风险, 是指资产受宏观经济、市场情绪等整体性因素影响而发生的价格波动, 换句话说, 就是股票与大盘之间的连动性, 系统风险比例越高, 连动性越强。

与系统风险相对的就是个别风险，即由公司自身因素所导致的价格波动。

总风险=系统风险+个别风险 而Beta则体现了特定资产的价格对整体经济波动的敏感性，即，市场组合价值变动1个百分点，该资产的价值变动了几个百分点——或者用更通俗的说法：大盘上涨1个百分点，该股票的价格变动了几个百分点。

用公式表示就是：实际中，一般用单个股票资产的历史收益率对同期指数(大盘)收益率进行回归，回归系数就是Beta系数。

Beta的一般用途 一般的说，Beta的用途有以下几个：

- 1)计算资本成本，做出投资决策(只有回报率高于资本成本的项目才应投资)；
- 2)计算资本成本，制定业绩考核及激励标准；
- 3)计算资本成本，进行资产估值(Beta是现金流贴现模型的基础)；
- 4)确定单个资产或组合的系统风险，用于资产组合的投资管理，特别是股指期货或其他金融衍生品的避险(或投机)。

对Beta第四种用途的讨论将是本文的重点。

组合Beta Beta系数有一个非常好的线性性质，即，资产组合的Beta就等于单个资产的Beta系数按其在组合中的权重进行加权求和的结果。

六、beta中文意思?属于证券类的英语单词或缩写.

beta不是一个缩写 它是希腊文第二个字母 在金融中

指市场风险指数beta系数是一种风险指数，是股票投资决策的重要依据。

beta系数具有统计学上的意义，它是一种证券收益和市场收益之间的协方差，除以市场收益方差的值，通过beta系数可以对某种股票或多个股票的组合的风险进行预测和度量。

beta系数表示的是个别股票相对于市场平均风险的波动倍数。

一个与股票市场同步运动的股票，它的风险与市场平均风险相同，这种股票的beta系数为1.0，一般来说，如果市场行情上涨5%，则该股票也会上涨5%，反之，如果市场行情下跌5%，则该股票也会下跌5%。

假如某个股票的beta系数为0.5，则该股票的涨跌变化幅度只是市场平均变化幅度的一半，该股票的市场风险是市场平均风险的一半。

参考文档

[下载：股票中beta是什么意思中文.pdf](#)

[《一带一路的国企改革股票有哪些》](#)

[《增发股票受理后什么时候批准》](#)

[《怎么查看基金买了什么股票》](#)

[《咖啡之翼新三板是什么》](#)

[《注册制创业板与非注册制创业板有什么区别》](#)

[下载：股票中beta是什么意思中文.doc](#)

[更多关于《股票中beta是什么意思中文》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/article/62406843.html>