

请问c股票的贝塔系数怎么算~股票的贝塔系数是1.4期望收益率是25%，求市场收益和无风险利率-股识吧

一、股票中的 系数如何解释（贝塔系数）？

用各自的 系数乘以各自的资金所占百分比，再求和即可。
证券之星问股

二、请帮忙：某公司持有A、B、C、D四种股票，其 系数分别为1.5，1，0.8和0.7，股票市场必要报酬率为15%，

1：各股票的必要回报率：A： $12\%+1.5*(15\%-10\%)=19.5\%$
A： $12\%+1*(15\%-10\%)=17\%$
A： $12\%+0.8*(15\%-10\%)=16\%$
A： $12\%+0.7*(15\%-10\%)=15.5\%$
2：该证券组合的平均收益率： $(19.5\%+17\%+16\%+15.5\%)/4=17\%$
3：该证券组合的风险收益率：证券组合 $= (1.5+1+0.8+0.7)/4=1$
证券组合风险收益率= $(17\%-12\%)=5\%$

三、股票中的贝塔系数

简单的理解就是，你的组合与大盘上涨或下跌的幅度的比率。
比如，大盘上涨20%，你的组合上涨30%，你的组合的贝塔系数就是1.5.科学的组合应该是保持在1上下，才能使你的收益体现大盘的涨跌。
大于1的系数说明你的组合是偏风险的，涨起来收益高，跌起来损失大。
小于1的组合就没劲了。
具体到股票，大盘蓝筹股的贝塔系数较小，创业板的贝塔系数大，看涨的时候如果胆子大就选贝塔系数大的股票。
要是长线投资，为的是分享经济增长的收益，就不要选择贝塔系数大的股票组合。

四、关于股票中贝塔系数和方差的问题

方差反映自身的风险。
自身的风险分两部分，一部分是系统风险，另一部分是非系统风险。
方差是这两种风险的总和。
贝塔系数只反映系统风险的大小。
你错了 横坐标是标准差。

五、股票的 值怎么算？

(Beta)系数-----BETA(N)
返回当前证券N周期收益与大盘收益相比的贝塔系数.

六、怎么算出一只股票的贝塔系数

具体公式参考此网页，比我说的全*：[//blog.163*/abhor@126/blog/static/1684612520071110111742265/](http://blog.163*/abhor@126/blog/static/1684612520071110111742265/) 系数计算方式（注：杠杆主要用于计量非系统性风险）
单项资产系统风险用 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。
另外，还可按协方差公式计算 值。

七、怎么算一个股票的贝塔系数阿？

用这支股票的今天收盘的大盘指数 - 昨天收盘的大盘指数 在除以
昨天收盘的大盘指数

八、股票的贝塔系数是1.4期望收益率是25%，求市场收益和无风险利率

贝塔系数是某只股票与大盘指数的变动幅度之比，如果一只股票上涨25%的话，大盘，也就是市场指数上涨就是 $25\%/1.4=17.9\%$ 。

所谓的无风险利率，是指市场的必要收益率，也就投资的机会成本，即投资收益中去掉风险补偿的收益率。

由于国债的风险很低，一般被认为是零风险的，所以大家公认可以把一年期国债的利率近似的认为是无风险收益率。

当前是3.9%。

九、计算贝塔系数的公式是什么？

$\beta_a = \text{Cov}(R_a, R_m) / \sigma_m^2$ 其中， β_a 是证券a的贝塔系数， R_a 为证券a的收益率， R_m 为市场收益率， $\text{Cov}(R_a, R_m)$ 是证券a的收益与市场收益的协方差， σ_m^2 是市场收益的方差。

系数也称为贝塔系数，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。

系数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。

扩展资料：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。

越高，意味着股票相对于业绩评价基准的波动性越大。

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%。

越大，证券价格波动（ β_a ）相对于总体市场波动（ σ_m ）越大；

同样， β 越小，也不完全代表 β_a 相对于 σ_m 越小。

甚至即使 $\beta =$

0也不能代表证券无风险，而有可能是证券价格波动与市场价格波动无关（ $\text{Cov}(R_a, R_m) = 0$ ），但是可以确定，如果证券无风险（ β_a ），一定为零。

参考资料来源：百科—— 系数

参考文档

[下载：请问c股票的贝塔系数怎么算.pdf](#)

[《配股分红股票多久填权》](#)

[《股票分红送股多久才能买卖》](#)

[《委托股票多久时间会不成功》](#)

[《股票一般多久一次卖出》](#)

[下载：请问c股票的贝塔系数怎么算.doc](#)

[更多关于《请问c股票的贝塔系数怎么算》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/30014974.html>