

beta在股票是什么意思_股票中的 系数是什么意思-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。

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beta值是什么意思

现货原油投资就是利用杠杆交易，资金已小博大，可以进行双向买卖交易，涨跌均有机会获利.保证金交易，买涨买跌多能赚钱，操作的好收益非常高，Q362862053

三、股票中的 系数是什么意思

我在股票百科搜索了BETA的含义，觉得不错，特在此分享： 系数也称为贝他系数（Beta coefficient），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。

简单来说，BETA是个别股票和市场指数之间的关系，这个市场指数可以是KLCI INDEX。

一个股票的BETA如果是1.10，表示其波动是股市的1.10

倍，亦即上涨时比市场表现优10%，而下跌时则更差10%；

如果BETA系数为0.5，则波动情况只及一半。

$\beta=0.5$ 为低风险股票， $\beta=1.0$ 表示为平均风险股票，而 $\beta=2.0$

高风险股票，大多数股票的 系数介于0.5到1.5间。

更详细的例子解说：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%。

计算个别股票 BETA 的方程式：

其中 $\text{Cov}(r_a, r_m)$ 是股票的收益与市场收益的协方差 (COVARIANCE) $\text{Var}^2(m)$

$=??$ 是市场收益的方差

有些人可能会好奇说，BETA 需要自己算吗？其实不需要，只要在 GOOGLE FINANCE 就能看到个别股票的 BETA 了，专家们都算好给你了，只是有多少人会去注意呢？会觉得这是有用的资讯呢？

四、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%，；

五、您好，不好意思打扰您了，请问您，我们计算投资股票中的 beta 值 (β) 的时候 β 可能小于 0 么？有什么涵义么~

有可能小于零，表示该股票跟整个市场呈反向变化，例如 $\beta = -0.5$ ，就是说，当市场上涨 1% 的时候，这个股票反而下跌 0.5%。

其实这种股票反而是很难得的，放在投资组合中，可以有效降低整个组合的风险。

六、股票中 BETA 的含义

是个比值，是计算股票与某个指标（比如市盈率，净资产之类）的关联度。

参考文档

[下载：beta在股票是什么意思.pdf](#)

[《股票买进需要多久》](#)

[《联科科技股票中签后多久不能卖》](#)

[《股票除权除息日多久》](#)

[《股票定增多久能有结果》](#)

[《股票转让后多久有消息》](#)

[下载：beta在股票是什么意思.doc](#)

[更多关于《beta在股票是什么意思》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/60801159.html>