

# 股票贝塔系数是什么；股市中的贝塔指的是什么-股识吧

## 一、股票的贝塔系数是??

评估一种证券系统性风险的工具，用以量度一种证券或一个投资证券组合相对总体市场的波动性。贝塔系数利用回归的方法计算。

贝塔系数1即证券的价格与市场一同变动。

贝塔系数高于1即证券价格比总体市场更波动。

贝塔系数低于1即证券价格的波动性比市场为低

## 二、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。

## 三、股市beta是什么意思

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。

详见股票百科

## 四、无风险利率是6%，市场上所有股票的平均收益率是10%，某

种股票的贝塔系数为1.5，则该股票的收益率为（ ）

## 五、股市中贝塔系数是？

贝塔系数很复杂，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。

不要看那些东西，最好不要炒股。

## 六、股票基础知识：什么是贝塔系数

Beta系数源自于CAPM模型？ $R_i - R_f = R_f + \beta(R_m - R_f)$ 表示的是股票收益与市场收益的敏感程度市场Beta=1则你股票Beta>1，则较平均市场有更高的风险收益反之，Beta<1，低风险低收益

七、无风险利率是6%，市场上所有股票的平均收益率是10%，某种股票的贝塔系数为1.5，则该股票的收益率为（ ）

B  $1.5 = \frac{\text{该股收益} * 10}{10 + 6}$  记不清了 别错了 匿名

## 八、阿尔法系数与贝塔系数

阿尔法系数（ ）阿尔法系数（ ）是基金的实际收益和按照系数计算的期望收益之间的差额。

其计算方法如下：超额收益是基金的收益减去无风险投资收益（在中国为1年期银行定期存款收益）；

期望收益是贝塔系数

和市场收益的乘积，反映基金由于市场整体变动而获得的收益；

超额收益和期望收益的差额即 系数。

贝塔系数 (  $\beta$  ) 贝塔系数衡量基金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，意味着基金相对于业绩评价基准的波动性越大。

大于 1，则基金的波动性大于业绩评价基准的波动性。

反之亦然。

如果  $\beta$  为 1，则市场上涨 10%，基金上涨 10%；

市场下滑 10%，基金相应下滑 10%。

如果  $\beta$  为 1.1，市场上涨 10% 时，基金上涨 11%；

市场下滑 10% 时，基金下滑 11%。

如果  $\beta$  为 0.9，市场上涨 10% 时，基金上涨 9%；

市场下滑 10% 时，基金下滑 9%。

R 平方 (R-squared) 是反映业绩基准的变动对基金表现的影响，影响程度以 0 至 100 计。

如果 R 平方值等于 100，表示基金回报的变动完全由业绩基准的变动所致；

若 R 平方值等于 35，即 35% 的基金回报可归因于业绩基准的变动。

简言之，R 平方值愈低，由业绩基准变动导致的基金业绩的变动便愈少。

此外，R 平方也可用来确定贝塔系数 (  $\beta$  ) 或阿尔法系数 (  $\alpha$  ) 的准确性。

一般而言，基金的 R 平方值愈高，其两个系数的准确性便愈高。

## 九、股市中的贝塔指的是什么

股市中的贝塔指的是该股的活跃度。

用字母 “  $\beta$  ” 表示。

一般来说  $\beta$  值越高的股票，表示这只股票越活跃。

在大盘上涨的时候，它的涨幅远高于大盘，在大盘下跌的时候，它的跌幅也比大盘的跌幅深。

## 参考文档

[下载：股票贝塔系数是什么.pdf](#)

[《股票买入委托通知要多久》](#)

[《买股票要多久才能买到》](#)

[《认缴股票股金存多久》](#)

[《股票赎回到银行卡多久》](#)

[《股票卖完后钱多久能转》](#)

[下载：股票贝搭系数是什么.doc](#)

[更多关于《股票贝搭系数是什么》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/author/14188589.html>