

## 怎么算股票权数组合的贝塔值~股票的贝塔值怎么看？-股识吧

一、请问在知道一个股票组合中三只股票的  $\beta$  系数和他们所占的比例的情况向，如何算出这个股票组合的  $\beta$  系数。

用各自的  $\beta$  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、您好请问股票  $\beta$  值怎样统计。还有听说国泰君安软件可以查到，您知道吗，谢谢。

$\beta$  值源于资本资产定价模型(CAPM)，它代表着特定资本市场上任意资产的风险与收益的均衡关系，其在数值上等于投资组合收益率相对于市场收益率的协方差与市场收益率方差的比值。

国君软件不知道，不过你可以在下面网站找到  $\beta$  值\*：[//share.jrj\\*.cn/cominfo/AllStock.asp](http://share.jrj*.cn/cominfo/AllStock.asp)这个网址.有所有的股票信息.包括BETA系数，只要点击你要查询的股票即可。

三、股票中的贝塔值是怎么回事？有什么简便计算方法？和股指什么关系？

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

$\beta$  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；

$\beta$  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  $\beta$  值偏高的投资组合；

行情下跌时，一般选取  $\beta$  值偏低的投资组合，这样才能取得最佳收益。

当然， $\beta$  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。



[下载：怎么算股票权数组合的贝塔值.pdf](#)

[《股票通常会跌多久》](#)

[《上市公司离职多久可以卖股票》](#)

[下载：怎么算股票权数组合的贝塔值.doc](#)

[更多关于《怎么算股票权数组合的贝塔值》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/21748793.html>