

股票贝塔值多少正常，贝塔，值是什么指标？-股识吧

一、股票的贝塔值为1.2无风险利率为5%市场投资组合的期望收益率为10%按资本资产定价模型计算普通股资本成本

CAPM模型的形式。

$E(R_p) = R_f + \beta (R_M - R_f)$ 其中 $\beta = Cov(R_i, R_M) / Var(R_M)$ $E(R_p)$ 表示投资组合的期望收益率， R_f 为无风险报酬率， $E(R_M)$ 表示市场组合期望收益率， β 为某一组合的系统风险系数，CAPM模型主要表示单个证券或投资组合同系统风险收益率之间的关系，也即是单个投资组合的收益率等于无风险收益率与风险溢价的和。

=====直接代入公式： $E(r_p) = 0.1$ ；

$$\beta = 1.2 ;$$

$$R_f = 0.05 ;$$

$$E(R_p) = R_f + \beta (R_M - R_f) \Rightarrow 0.1 = 0.05 + 1.2 (R_M - 0.05)$$

$$R_M - 0.05 = (0.1 - 0.05) \div 1.2 \Rightarrow R_M = 0.05 \div 1.2 + 0.05 = 0.1417 + 0.05$$

= 0.0917 故，普通股资本的成本是9.17%

二、该股票的贝塔是多少？

系数也称为贝塔系数 (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。

Investing 会列出所有股票的贝塔值。

如当前三星电子股票的贝塔值为1.23 参考资料：

百科： 系数 Investing：三星电子股票

三、股票a的标准差40%贝塔系数0.5

股票b的标准差20%贝塔系数1.5 问哪知股票的风险溢价更高？

股票b的风险溢价更高。

在一倍标准差下如果市场变化了一倍，a股变化范围是=40%*0.5=20% b股变化范围

是 $=20\% \times 1.5 = 30\%$ 即b股本身股价变化不大，但随市场变化而变的范围很大。
如果能准确把握这市场的变化，则投资b股。
a股股价，虽然自身价格的变化比较大，但随市场变化而变的特性却小多了。
是相对市场比较稳定的一个股票。

四、

五、 贝塔， 值是什么指标？

同学你好，很高兴为您解答！ ;

贝塔， 值 ;

 ;

 ;

Beta ;

 ;

 ;

 ;

 ;

 ;

 ;

 ;

 ;

 ;

 ;

 ;

比照同期的总体市场动态来度量某种特定股票的价格运动的指标。

如果股票的贝塔值低于1，即认为该股票的风险低于总体市场风险。

如果股票的贝塔值大于1，则认为该股票的风险高于市场风险。

 ;

马上就要2022年下半年CMA资格考试了，在这里祝大家好好考试，每个人都超常发挥，取得好成绩！ ;

希望我的回答能帮助您解决问题，如您满意，请采纳为最佳答案哟。

 ;

再次感谢您的提问，更多财会问题欢迎提交给高顿企业知道。
高顿祝您生活愉快！

六、股票中的beta系数

一般的股票软件里都有如：大智慧 同花顺等 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的"股性"。

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

当有很大把握预测到一个大牛市或大盘某个上涨阶段的到来时，应该选择那些高系数的证券，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的到来时，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 系数的证券。

例如，一支个股 系数为1.3，说明当大盘涨1%时，它有可能涨1.3%，同理大盘跌1%时，它有可能跌1.3%；

但如果一支个股 系数为-1.3时，说明当大盘涨1%时，它有可能跌1.3%，同理大盘跌1%时，它有可能涨1.3%。

如果跟踪 系数的变化，可以看出个股股性的变化，和主力进出的情况。

不知道是否说明白了? ^_^

七、贝塔， 值是什么意思？

比照同期的总体市场动态来度量某种特定股票的价格运动的指标。

如果股票的贝塔值低于1，即认为该股票的风险低于总体市场风险。

如果股票的贝塔值大于1，则认为该股票的风险高于市场风险。

参考文档

[下载：股票贝塔值多少正常.pdf](#)

[《st股票一般多久交易》](#)

[《股票钱卖了多久可以转银行》](#)

[《配股分红股票多久填权》](#)

[《股票k线看多久》](#)

[下载：股票贝塔值多少正常.doc](#)

[更多关于《股票贝塔值多少正常》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/43517315.html>