

## 怎么求单个股票的贝塔 - 股票T+0成本计算问题-股识吧

### 一、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

### 二、单独个股 系数在哪里可以查到？或者如何简单计算？在线等。

实际中，一般用单个股票资产的历史收益率对同期指数（大盘）收益率进行回归，回归系数就是Beta系数。

使用大盘的收益率和你选择的个股的收益率,在同花顺中可以导出excel中,然后再用数据分析进行回归分析,得到的斜率就是Beta系数.

### 三、一只股票的贝塔系数是1.3，市场的期望收益率是14%，无风险利率是5%。这只股票的预期风险必须是多少？

$E(R) = R_f + \beta * [E(R) - R_f]$  // 期望收益等于无风险收益加上风险溢价期望收益=无风险收益+（市场预期收益-无风险收益）；

预期风险=期望收益-市场预期收益证券市场线方程为 $E(r) = 5\% + \beta * (14\% - 5\%)$ 即 $E(r) = 0.05 + 1.3 * 0.09 = 0.167 = 16.7\%$ 即风险收益率是16.7%。

### 四、如何查看单个股票每年的 系数，求教详细过程，诚心感谢了

各个股票风险不同，比如银行股风险就比较小，取大盘平均风险系数为1，那某股票相对于大盘的风险系数就是贝塔系数，风险比大盘小，系数就小于1，反之，则大于1

## 五、股票T+0成本计算问题

$(22.187 \times 3000 + 10.92 \times 2000) / (3000 + 2000) = 19.68$ ;  $(19.68 \times 5000 - 11.65 \times 2000) / (5000 - 2000) = 21.70$ 。(计算未包含交易费用，有稍微的误差)

## 六、需要一只股票的贝塔值，任何股票都可以，求一个EXCL文件！！急需！

通达信软件有的计算参数"beta"，直接在公式编辑器里写上：BETA(5);1;可以计算出任何一只股票的5日 值的均值，只要 > 1，可视为短期该股强于大盘。括号中的"5"，可以按个人需要调整。

## 七、该股票的贝塔是多少？

$E(R) = R_f + \beta * [E(R) - R_f]$  // 期望收益等于无风险收益加上风险溢价  
期望收益 = 无风险收益 + (市场预期收益 - 无风险收益) ;  
预期风险 = 期望收益 - 市场预期收益  
证券市场线方程为  $E(r) = 5\% + \beta * (14\% - 5\%)$  即  $E(r) = 0.05 + 1.3 * 0.09 = 0.167 = 16.7\%$  即风险收益率是16.7%。

## 八、求 $\sin(\alpha + \beta) = \sin \alpha \cos \beta + \cos \alpha \sin \beta$ 的推导过程

两角和的余弦公式： $\cos(\alpha + \beta) = \cos \alpha \cos \beta - \sin \alpha \sin \beta$  ;  
(思路:在直角坐标系的单位圆中，根据两点间的距离公式来推导)  
作  $AOD = \alpha$  ,  $BOD = -\beta$  ,  $AOC = \alpha + \beta$  ,  $DOC = \alpha - \beta$  。  
则B (  $\cos \beta$  ,  $-\sin \beta$  ) ;

$D(1, 0)$  ;

$A(\cos \alpha, \sin \alpha)$  ;

$C[\cos(\alpha + \beta), \sin(\alpha + \beta)]$ 。

$OA=OB=OC=OD=1$   $CD=AB$ 。

$CD^2=[\cos(\alpha + \beta) - 1]^2 + [\sin(\alpha + \beta) - 0]^2$  ;  
 $=\cos^2(\alpha + \beta) - 2\cos(\alpha + \beta) + 1 + \sin^2(\alpha + \beta)$  ;  
 $=2 - 2\cos(\alpha + \beta)$ 。

$AB^2=(\cos \alpha - \cos \beta)^2 + (\sin \alpha - \sin \beta)^2$  ;  
 $=\cos^2 \alpha - 2\cos \alpha \cos \beta + \cos^2 \beta + \sin^2 \alpha - 2\sin \alpha \sin \beta + \sin^2 \beta$  ;  
 $=2 - 2[\cos \alpha \cos \beta - \sin \alpha \sin \beta]$ 。

$2 - 2\cos(\alpha + \beta) = 2 - 2[\cos \alpha \cos \beta - \sin \alpha \sin \beta]$ 。

$\cos(\alpha + \beta) = \cos \alpha \cos \beta - \sin \alpha \sin \beta$

## 参考文档

[下载：怎么求单个股票的贝塔.pdf](#)

[《股票上市一般多久解禁》](#)

[《德新交运股票停牌多久复牌》](#)

[《认缴股票股金存多久》](#)

[《股票上升趋势多久比较稳固》](#)

[下载：怎么求单个股票的贝塔.doc](#)

[更多关于《怎么求单个股票的贝塔》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/book/12755196.html>