

怎么看股票的系数__如何计算一支股票的贝塔系数-股识吧

一、你好，怎么查个股 系数

以前软件的F10中有港澳资讯提供的个股 系数，现在 系数基本没人用了，应为实践检验根本没用，所以很多软件就不显示了。

系数指的是个股相对于大盘的关联性如果 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 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 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%。

因为中国股市在短时间内齐涨共跌的特性，使该指标英雄无用武之地。

在国外， 系数曾经名噪一时，后来从理论证明没太大用处，也就回归平淡了。这方面可以看看《漫步华尔街》，里面说的很清楚。

二、如何计算一支股票的贝塔系数

关于贝塔系数在股票百科里有详细的说明，你可以去那里看看就知道了。

三、股票中的beta系数从哪里查到?

Beta系数定义：Beta系数是用以度量一项资产系统性风险(systematic risk)的指标，是资本资产定价模型(Capital Asset Pricing Model)的主要参数。

用以衡量一种证券或一个投资组合(asset allocation)相对总体市场的波动性的一种证券系统性风险的评估工具。

计算公式：(见附图)其中Cov(r_a ， r_m)是证券a的收益与市场收益的协方差； σ_m^2 是市场收益的方差。

因为： $\beta_a = \frac{\text{Cov}(r_a, r_m)}{\sigma_m^2}$ 简单理解： $\beta_a = 1$ ，

即证券的价格与市场一同变动。

1，即证券价格比总体市场更波动。

(效市场为高风险公司或投资) < ;

1，即证券价格的波动性比市场为低。

(效市场为低风险公司或投资) = 0，即证券价格的波动与市场没有关系。

< ;

0，即证券价格的波动与市场为相反，一般情况下是很少见的。

按照CAPM的规定，Beta系数是用以度量一项资产系统风险的指针，是用来衡量一种证券或一个投资组合相对总体市场的波动性（volatility）的一种风险评估工具。

也就是说，如果一个股票的价格和市场的价格波动性是一致的，那么这个股票的Beta值就是1。

如果一个股票的Beta是1.5，就意味着当市场上升10%时，该股票价格则上升15%；

而市场下降10%时，股票的价格亦会下降15%。

Beta是通过统计分析同一时期市场每天的收益情况以及单个股票每天的价格收益来计算出。

1972年，经济学家费歇尔·布莱克 (Fischer Black)、迈伦·斯科尔斯 (Myron Scholes) 等在他们发表的论文《资本资产定价模型：实例研究》中，通过研究1931年到1965年纽约证券交易所股票价格的变动，证实了股票投资组合的收益率和它们的Beta间存在着线形关系。

四、在哪可以找到股票风险系数

可通过贝塔系数查找。

贝塔系数（Beta Coefficient）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。

贝塔系数是统计学上的概念，它所反映的是某一投资对象相对于大盘的表现情况。

其绝对值越大，显示其收益变化幅度相对于大盘的变化幅度越大；

绝对值越小，显示其变化幅度相对于大盘越小。

如果是负值，则显示其变化的方向与大盘的变化方向相反；

大盘涨的时候它跌，大盘跌的时候它涨。

由于我们投资于投资基金的目的是为了取得专家理财的服务，以取得优于被动投资于大盘的表现情况，这一指标可以作为考察基金经理降低投资波动性风险的能力。

在计算贝塔系数时，除了基金的表现数据外，还需要有作为反映大盘表现的指标。

五、

六、怎么算出一只股票的贝塔系数

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%。

七、在哪里可以查询到股票的贝塔系数

为了只看一个贝塔指标去下载软件没有必要，你可以自编个指标即可实现。

BETA(60)；

或： $a1 := (\text{indexc} - \text{ref}(\text{indexc}, 1)) / \text{ref}(\text{indexc}, 1)$ ；

$a2 := (c - \text{ref}(c, 1)) / \text{ref}(c, 1)$ ；

大盘涨幅： $= a1 * 100$ ；

个股涨幅： $= a2 * 100$ ；

$k := \text{if}(\text{大盘涨幅} >$

$1, 0.9, 1)$ ；

$j := 0$ ；

$j1 := 5$ ；

$j2 := -5$ ；

贝塔： $= k * (a2 - a1) * 100$ ；

$\text{ema3} := \text{ema}(\text{贝塔}, 3)$ ；

参考文档

[下载：怎么看股票的系数.pdf](#)

[《外盘股票开户要多久才能买》](#)

[《一般股票持有多久才能赚钱》](#)

[《三一股票分红需要持股多久》](#)

[《川恒转债多久变成股票》](#)

[《股票实盘一般持多久》](#)

[下载：怎么看股票的系数.doc](#)

[更多关于《怎么看股票的系数》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/21854126.html>