

停牌的股票怎么算贝塔_股票的贝塔系数如何准确算出？用回归直线法计算与实际数的差距？-股识吧

一、股票的贝塔系数如何准确算出？用回归直线法计算与实际数的差距？

展开全部
$$j = \frac{\text{cov}(K_j, K_m)}{\sigma_m^2} = r_{jm} \frac{\sigma_j}{\sigma_m} \quad (4)$$

式中： $\text{cov}(K_j, K_m)$ 是第j种证券的收益与市场组合收益之间的协方差。

它等于该证券的标记标准差、市场组合的标准差及两者相关系数的乘积；

σ_j 为风险资产j的收益率标准差， σ_m 为市场组合收益率的标准差，

r_{jm} 为风险资产j的收益率与市场组合收益率之间的相关系数，

K_j 为风险资产j的收益率， K_m 为市场组合的收益率，

对应的市场收益率可以由上证综指计算求得，即： $K_m = \frac{P_t - P_{t-1}}{P_{t-1}}$ (5) 其中：

P_t 表示第T年末的上证综指 P_{t-1} 表示第T年初的上证综指

二、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%。

三、证券市场线中的贝塔系数如何计算？

$$J = R_{jm} \left(\frac{\sigma_j}{\sigma_m} \right)$$

四、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。

五、计算贝塔系数的公式是什么？

$\beta_a = \text{Cov}(R_a, R_m) / \sigma_m^2$ 其中， β_a 是证券a的贝塔系数， R_a 为证券a的收益率， R_m 为市场收益率， $\text{Cov}(R_a, R_m)$ 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。

系数也称为贝塔系数，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。

扩展资料：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。

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%。

越大，证券价格波动（ β_a ）相对于总体市场波动（ σ_m ）越大；

同样， β 越小，也不完全代表 β_a 相对于 σ_m 越小。

甚至即使 $\beta =$

0也不能代表证券无风险，而有可能是证券价格波动与市场价格波动无关（ $\beta_a = 0$ ），但是可以确定，如果证券无风险（ β_a ）， β_a 一定为零。

参考资料来源：百科—— 系数

六、股票里怎么样看贝塔系数？

贝塔系数是统计学上的概念，是一个在+1至-1之间的数值，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。

七、证券市场线中的贝塔系数如何计算？

展开全部 $\beta_j = \frac{\text{cov}(K_j, K_m)}{\sigma_m^2} = r_{jm} \frac{\sigma_j}{\sigma_m}$ (4)

式中： $\text{cov}(K_j, K_m)$ 是第j种证券的收益与市场组合收益之间的协方差。

它等于该证券的标记准差、市场组合的标准差及两者相关系数的乘积；

σ_j 为风险资产j的收益率标准差， σ_m 为市场组合收益率的标准差，

r_{jm} 为风险资产j的收益率与市场组合收益率之间的相关系数，

K_j 为风险资产j的收益率， K_m 为市场组合的收益率，

对应的市场收益率可以由上证综指计算求得，即： $K_m = \frac{P_t - P_{t-1}}{P_{t-1}}$ (5) 其中：

P_t 表示第T年末的上证综指 P_{t-1} 表示第T年初的上证综指

八、股票的值怎么算？

(Beta)系数-----BETA(N)

返回当前证券N周期收益与大盘收益相比的贝塔系数.

参考文档

[下载：停牌的股票怎么算贝塔.pdf](#)

[《什么样的股票有股息》](#)

[《新上市的股票为什么跌停了》](#)

[《嘉美转债怎么转股》](#)

[下载：停牌的股票怎么算贝塔.doc](#)

[更多关于《停牌的股票怎么算贝塔》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/chapter/27392457.html>