

如何计算股票的贝塔系数！请问如何计算一支股票的贝塔系数呢？具体的公式是什么呢？-股识吧

一、股市贝塔系数怎么算？

beta系数无非就是与市场回报率的协方差除以市场回报率的方差，或者跟简单的讲就是两者相关系数。

用CORREL函数即可，这里的array1可以用股票的日收益率，array2可以选定某个综合指数，也可以是自己抽取样本数（比如100个，200个。

。

。

)组成的平均收益率。

建议在计算收益率时不仅考虑价格收益率，把分红因素也放进去。

还有个什么软件，计量经济利用的，也能算

二、请问如何计算一支股票的贝塔系数呢？具体的公式是什么呢？

cov/var 就是股票收益与指数收益的协方差除以指数的方差

三、怎么算一个股票的贝塔系数阿？

用这支股票的今天收盘的大盘指数 - 昨天收盘的大盘指数 在除以
昨天收盘的大盘指数

四、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%。

五、投资组合的贝塔系数计算公式

投资组合的beta值等于被组合各项资产beta系数的加权平均数。

$$p = \sum (W_i)(\beta_i) = 40\% * 0.7 + 10\% * 1.1 + 50\% * 1.7 = 1.24$$
$$\text{组合必要收益率 } E(R_p) = R_f + [E(R_m) - R_f] * p = 3\% + (12\% - 3\%) * 1.24 = 14.16\%$$

六、股票中贝塔系数都有哪些测算方法

一般来说, 贝塔系数都是根据过去一段时间内该公司股价和大盘标杆指数的历史价格通过应用线性回归测算出来的。

最常用也是业界最普遍的方法取值范围是在过去5年, 取每月初价格, 总共60个值, 通过线性回归来计算。

七、请问如何计算一支股票的贝塔系数呢？ 具体的公式是什么呢？

cov/var 就是股票收益与指数收益的协方差除以指数的方差

八、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%。

参考文档

[下载：如何计算股票的贝塔系数.pdf](#)

[《股票会连续跌停多久》](#)

[《行业暂停上市股票一般多久》](#)

[《蜻蜓点睛股票卖出后多久能取出》](#)

[《股票实盘一般持多久》](#)

[《财通证券股票交易后多久可以卖出》](#)

[下载：如何计算股票的贝塔系数.doc](#)

[更多关于《如何计算股票的贝塔系数》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/chapter/32863960.html>