

上市公司的贝塔值怎么算—贝塔值在中国指的是什么？- 股识吧

一、2009年上市公司 β 系数求大神帮助

β 系数法主要用于估算被评估企业（或被评估企业所在行业）的风险报酬率。其基本思路是，被评估企业（或行业）风险报酬率是社会平均风险报酬率与被评估企业（或被评估企业所在行业）风险和社会平均风险的相关系数（ β 系数）的乘积。

β 系数法估算风险报酬率的步骤为：

- （1）将社会平均收益率扣除无风险报酬率，求出社会平均风险报酬率；
- （2）将企业（或企业所在行业）的风险与充分风险分散的市场投资组合的风险水平进行比较及其测算，求出企业所在行业的 β 系数；
- （3）用市场平均风险报酬率乘以企业（或企业所在行业）的 β 系数，便可得到被评估企业（或企业所在行业）的风险报酬率。

二、企业关于 β 值

展开全部 β 值是企业的系统风险，就是企业不能通过投资分散掉的风险。例如全球经济形势，利率水平等等所产生的风险。

三、贝塔值的估计？

贝塔值用来量化个别投资工具相对整个市场的波动，将个别风险引起的价格变化和整个市场波动分离开来。

通过简单举例和论述，可以得出这样结论，证券的贝塔值越高，潜在风险越大，投资收益也越高；

相反，证券的贝塔值越低，风险程度越小，投资收益也越低。

为了便于理解，试举例说明。

假设上证指数代表整个市场，贝塔值被确定为1。

当上证指数向上涨10%时，某股票价格也上涨10%，两者之间涨幅一致，风险也一

致，量化该股票个别风险的指标——贝塔值也为1。

如果这个股票波动幅度为上证指数的两倍，其贝塔值便为2，当上证指数上升10%时，该股价格应会上涨20%。

若该股票贝塔值为0.5，其波动幅度仅为上证指数的1/2，当上证指数上升10%时，该股票只涨5%。

同样道理，当上证指数下跌10%时，贝塔值为2的股票应该下跌20%，而贝塔值为0.5的股票只下跌5%。

于是，专业投资顾问用贝塔值描述股票风险，称风险高的股票为高贝塔值股票；风险低的股票为低贝塔值股票。

其他证券的个别风险同样可与对应市场坐标进行比较。

比如短期政府债券被视为市场短期利率风向标，可用来量化公司债券风险。

当短期国债利率为3%时，某公司债券利率也为3%，两者贝塔值均为1。

由于公司不具备政府的权威和信用，所以贝塔值为1的公司债券很难发出去，为了发行成功，必须提高利率。

若公司债券利率提高至4.5%，是短期国债利率的1.5倍，此债券贝塔值则为1.5，表示风险程度比国债高出50%。

四、股票中的 β 系数如何解释（贝塔系数）？

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。

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。

$\beta = 0$ 表示没有风险， $\beta = 0.5$ 表示其风险仅为市场的一半， $\beta =$

1表示风险与市场风险相同， $\beta = 2$ 表示其风险是市场的2倍。

贝塔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说的“股性”。

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

当有很大把握预测到一个大牛市或大盘某个不涨阶段的到来时，应该选择那些高贝

塔系数的证券，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，办法是选择那些低贝塔系数的证券。为避免非系统风险，可以在相应的市场走势下选择那些相同或相近贝塔系数的证券进行投资组合。
更多股票学习内容请访问棒槌网！

五、您好请问股票 β 值怎样统计。还有听说国泰君安软件可以查到，您知道吗，谢谢。

β 值源于资本资产定价模型(CAPM)，它代表着特定资本市场上任意资产的风险与收益的均衡关系，其在数值上等于投资组合收益率相对于市场收益率的协方差与市场收益率方差的比值。
国君软件不知道，不过你可以在下面网站找到 β 值*：[//share.jrj*.cn/cominfo/AllStock.asp](http://share.jrj*.cn/cominfo/AllStock.asp)这个网址.有所有的股票信息.包括BETA系数，只要点击你要查询的股票即可。

六、请问在知道一个股票组合中三只股票的 β 系数和他们所占的比例的情况向，如何算出这个股票组合的 β 系数。

用各自的 β 系数乘以各自的资金所占百分比，再求和即可。
证券之星问股

七、贝塔值在中国指的是什么？

同学你好，很高兴为您解答！贝塔，Beta值在中国的CMA管理会计中指的是比对同期总体市场运动来量度一种特定股票的价格运动。
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。
如果股票的贝塔值大于1，即认为该股票的风险高于市场。
希望高顿网校的回答能帮助您解决问题，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！

参考文档

[下载：上市公司的贝塔值怎么算.pdf](#)

[《山西省中药上市公司有哪些》](#)

[《怎么看股票周k线》](#)

[《股票10派1.85元什么意思》](#)

[《牛市初期什么股最强》](#)

[《有什么条件可以申购科创板股票》](#)

[下载：上市公司的贝塔值怎么算.doc](#)

[更多关于《上市公司的贝塔值怎么算》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/read/24154139.html>