

股票高贝塔值怎样计算_股市中贝塔值是什么?-股识吧

一、股市中贝塔值是什么？

股票 值表示投资组合对系统风险的敏感程度： 值为1，表示指数变化时，股票价格会以相同的百分率变化；

值为1.8时，表示指数发生1%的变动，股票价格会呈现1.8%的变动；

值为0.5时，表示指数发生1%的变动，股票价格会呈现0.5%的变动。

行情上涨时，一般选取 值偏高的投资组合；

行情下跌时，一般选取 值偏低的投资组合，这样才能取得最佳收益。

当然， 值是历史数据的统计，有一定的时效性，这一点在应用时必须考虑。

二、计算贝塔系数的公式是什么？

$a = \text{Cov}(R_a, R_m) / \sigma^2_m$ 其中， 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^2_m 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 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%。

越大，证券价格波动(a)相对于总体市场波动(m)越大；

同样， 越小，也不完全代表 a相对于 m越小。

甚至即使 =

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（ $\alpha_m=0$ ），但是可以确定，如果证券无风险（ α ），一定为零。

参考资料来源：百科——系数

三、股票的贝塔值怎么看？

呵呵，一般的交易软件里面根本就没计算贝塔值。

查查wind这样的软件吧，国外的股票查查blomberg，美股好像yahoo上有免费的，国内股票好像还没发现有免费的。

你也可以自己用EXCEL计算股票的贝塔值，如果需要计算方法可发邮箱地址出来

四、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

五、计算贝塔值！！！！！！！！！！！！！！

某股票预期收益率=无风险收益率+贝塔系数*(标的指数预期收益率-无风险收益率)
故此设要求的该股票贝塔值为X，则有以下等式： $11\% = 4\% + X * (18\% - 4\%)$ 解得 $X=0.5$
该股票的贝塔值为0.5。

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、怎么算出一只股票的贝塔系数

具体公式参考此网页，比我说的全*：[//blog.163.com/abhor@126/blog/static/1684612520071110111742265/](http://blog.163.com/abhor@126/blog/static/1684612520071110111742265/) 系数计算方式（注：杠杆主要用于计量非系统性风险）单项资产系统风险用 系数来计量，通过以整个市场作为参照物，用单项资产的风险收益率与整个市场的平均风险收益率作比较。

另外，还可按协方差公式计算 值。

八、股票中的贝塔系数

简单的理解就是，你的组合与大盘上涨或下跌的幅度的比率。

比如，大盘上涨20%，你的组合上涨30%，你的组合的贝塔系数就是1.5.科学的组合应该是保持在1上下，才能使你的收益体现大盘的涨跌。

大于1的系数说明你的组合是偏风险的，涨起来收益高，跌起来损失大。

小于1的组合就没劲了。

具体到股票，大盘蓝筹股的贝塔系数较小，创业板的贝塔系数大，看涨的时候如果胆子大就选贝塔系数大的股票。

要是长线投资，为的是分享经济增长的收益，就不要选择贝塔系数大的股票组合。

参考文档

[下载：股票高贝塔值怎样计算.pdf](#)

[《股票重组多久会停牌》](#)

[《学会炒股票要多久》](#)

[《上市股票中签后多久可以卖》](#)

[《股票退市重组大概多久》](#)

[《买了8万的股票持有多久可打新》](#)

[下载：股票高贝塔值怎样计算.doc](#)

[更多关于《股票高贝塔值怎样计算》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/31599937.html>