

如果某种股票的贝塔系数等于1__股票的贝塔系数是?? - 股识吧

一、如果股票的贝塔值大于1，表达什么？

= 1.0 表示为平均风险股票。

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%。

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。

扩展资料Beta的用途：计算资本成本，做出投资决策（只有回报率高于资本成本的项目才应投资）；

计算资本成本，制定业绩考核及激励标准；

计算资本成本，进行资产估值（Beta是现金流贴现模型的基础）；

确定单个资产或组合的系统风险，用于资产组合的投资管理，特别是股指期货或其他金融衍生品的避险（或投机）。

Beta系数有一个非常好的线性性质，即，资产组合的Beta就等于单个资产的Beta系数按其在组合中的权重进行加权求和的结果。

参考资料来源：股票百科—— 系数

二、股票的贝塔系数是??

评估一种证券系统性风险的工具，用以量度一种证券或一个投资证券组合相对总体市场的波动性。贝塔系数利用回归的方法计算。

贝塔系数1即证券的价格与市场一同变动。

贝塔系数高于1即证券价格比总体市场更波动。

贝塔系数低于1即证券价格的波动性比市场为低

三、如果股票的贝塔值大于1，表达什么？

如果股票的贝塔值大于1，则认为该股票的风险高于市场风险。

四、为什么有的贝塔系数会大于1啊？

贝塔系数是个股和大盘指数之间波动的对比值，指的是大盘指数每上涨或者下跌一个百分点的时候，个股上涨或者下跌的百分点，如果某个股的贝塔系数是2，那说明大盘上涨1%的时候，该股上涨2%，或者大盘下跌1%的时候，该股下跌2%。用来揭示个股的风险。

在现实中，个股的涨跌幅往往都比大盘大，所以贝塔系数也大多大于一。而且大部分的股票的贝塔系数都是正值，也就是和大盘之间呈正相关的关系。

五、如何理解市场组合的贝塔系数 = 1？

= 1.0 表示为平均风险股票。

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%。

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。

扩展资料Beta的用途：计算资本成本，做出投资决策（只有回报率高于资本成本的项目才应投资）；

计算资本成本，制定业绩考核及激励标准；

计算资本成本，进行资产估值（Beta是现金流贴现模型的基础）；

确定单个资产或组合的系统风险，用于资产组合的投资管理，特别是股指期货或其他金融衍生品的避险（或投机）。

Beta系数有一个非常好的线性性质，即，资产组合的Beta就等于单个资产的Beta系数

按其在组合中的权重进行加权求和的结果。

参考资料来源：股票百科—— 系数

六、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。

参考文档

[下载：如果某种股票的贝塔系数等于1.pdf](#)

[《设研院股票是做什么的》](#)

[《为什么新开的股票账户不能买转债》](#)

[《华润哪个板块最强》](#)

[下载：如果某种股票的贝塔系数等于1.doc](#)

[更多关于《如果某种股票的贝塔系数等于1》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/store/29726562.html>