

怎样求股票的贝塔值——如何计算一支股票的贝塔系数-股识吧

一、如何使用EXCEL计算股票的贝塔值

(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.

二、如何使用EXCEL计算股票的贝塔值

可以直接设计一个有截距值的线性回归来计算。

把股票收益率设为因变量，市场收益率设为自变量。

在Excel的“工具”中，选择“加载宏”，选中“分析数据库”，然后就可以在“工具”中找到“数据分析”，点击那个，选中“回归”，在弹出的界面中按要求选取自变量区域和因变量区域就可以了。

回归得出的斜率值就是贝塔系数了。

三、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。

四、证券市场线中的贝塔系数如何计算？

$$J=R_{jm}(j/m)$$

五、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 $\beta_j = \frac{\text{cov}(K_j, K_m)}{\sigma_m^2} = r_{jm} \frac{\sigma_j}{\sigma_m}$ (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

六、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*/abhor@126/blog/static/1684612520071110111742265/](http://blog.163*/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 β 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 β 值。

七、股票的 β 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：怎样求股票的贝塔值.pdf](#)

[《股票tick多久一次》](#)

[《股票停牌复查要多久》](#)

[《股票挂单有效多久》](#)

[下载：怎样求股票的贝塔值.doc](#)

[更多关于《怎样求股票的贝塔值》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/31658718.html>