

股票的贝塔系数如何求|股市中贝塔系数是?-股识吧

一、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。

$$\beta_p = \sum (\beta_i)(W_i) = 40\% \times 0.7 + 10\% \times 1.1 + 50\% \times 1.7 = 1.24$$

$$\text{组合必要收益率 } E(R_p) = R_f + [E(R_m) - R_f] \times \beta_p = 3\% + (12\% - 3\%) \times 1.24 = 14.16\%$$

二、证券市场线中的贝塔系数如何计算？

贝塔系数=协方差/方差贝塔系数的一个最重要的特征是：当以各种股票的市场价值占市场组合总的市场价值的比重为权数时，所有证券的贝塔系数的平均值等于1。

三、股市中贝塔系数是？

贝塔系数很复杂，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。

不要看那些东西，最好不要炒股。

四、证券市场线中的贝塔系数如何计算？

$$\beta_j = R_{jm}(\sigma_j / \sigma_m)$$

五、怎么利用K线图求贝塔系数

利用K线图计算贝塔系数如下：1.导出指数K线数据和要求的股票K线数据2.计算收益率（收益率=当日收盘价与上日收盘价之差，再除以上日收盘价）3.计算两者的协方差和指数的方差，相除即是该股票的贝塔系数协方差和方差可以直接用EXCEL

来算。
帮到楼主请采纳一下最佳答案哈。

六、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

参考文档

[下载：股票的贝塔系数如何求.pdf](#)

[《股票持股多久可以免分红税》](#)

[《股票停止交易多久》](#)

[《购买新发行股票多久可以卖》](#)

[《基金多久更换一次股票》](#)

[《一只股票从增发通告到成功要多久》](#)

[下载：股票的贝塔系数如何求.doc](#)

[更多关于《股票的贝塔系数如何求》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/33420751.html>