

股票贝塔值如何用—股票中贝塔系数都有哪些测算方法-股识吧

一、BETA指标怎么用

alpha指标是基金资产组合投资绩效的衡量指标，该指标是经风险调整后的收益指标，正(负)值表明基金的投资收益表现要高(低)于基金资产风险(用beta值衡量)所对应的收益水平。

当基金资产组合的收益与市场指数收益高度相关时，Alpha和beta是非常有效的投资绩效衡量指标。

Alpha值一般都是年利率化的。

beta指标是投资组合系统性风险的衡量指标。

两指标基于CAPM模型

二、股票中的贝塔值是怎么回事？有什么简便计算方法？和股指什么关系？

同学你好，很高兴为您解答！ 贝塔，
值 Beta

比照同期的总体市场动态来度量某种特定股票的价格运动的指标。

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风险。

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。

马上就要2021年下半年CMA资格考试了，在这里祝大家好好考试，每个人都超常发挥，取得好成绩！

希望我的回答能帮助您解决问题，如您满意，请采纳为最佳答案哟。

再次感谢您的提问，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！

三、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。

四、股票的贝塔值怎么看？

呵呵，一般的交易软件里面根本就没有计算贝塔值。

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

五、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。

六、股票中的贝塔值是什么意思

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。

贝塔值采用回归法计算，将整个市场波动带来的风险确定为1。

当某项资产的价格波动与整个市场波动一致时，其贝塔值也等于1；

如果价格波动幅度大于整个市场，其贝塔值则大于1；

如果价格波动小于市场波动，其贝塔值便小于1。

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。

贝塔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。

扩展资料贝塔值的应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，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。

比如：一支个股贝塔系数为1.3，说明当大盘涨1%时，它可能涨1.3%，反之亦然；但如果一支个股贝塔系数为-1.3%时，说明当大盘涨1%时，它可能跌1.3%，同理，大盘如果跌1%，它有可能涨1.3%。

参考资料来源：搜狗百科-贝塔值

七、股票中的贝塔值是怎么回事？有什么简便计算方法？和股指什么关系？

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。

参考文档

[下载：股票贝塔值如何用.pdf](#)

[《股票理财资金追回需要多久》](#)

[《川恒转债多久变成股票》](#)

[《股票停牌多久能恢复》](#)

[《股票盘中临时停牌多久》](#)

[《股票多久才能卖完》](#)

[下载：股票贝塔值如何用.doc](#)

[更多关于《股票贝塔值如何用》的文档...](#)

#!NwL!#

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/40598438.html>