

# 如何计算某股票的贝塔系数，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？-股识吧

## 一、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。

## 二、一道计算股票价值的题目！贝塔系数！

哦，原来是这个意思。

你说的平均风险收益率就是风险溢价，也就是已经把 $R_m + R_f$ 的和算好了，我还以为只是市场的风险收益率 $R_m$ 。

所以才有原先的算法，不过和答案里的方法都是一样的。

注意！你计算的是必要收益率，而不是预期收益率！不过公式是对的。

必要收益率  $k = \text{无风险收益率} + \beta * \text{风险溢价}$ 。

其中风险溢价（也就是你写的那个“平均风险收益率”）=市场风险收益率+无风险收益率。

你还是系统的学习下吧，这些其实都是corporate finance里面的最基本的内容。

## 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、怎么算出一只股票的贝塔系数

如果  $\beta$  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  $\beta$  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  $\beta$  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%。

## 五、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？

$\text{cov}/\text{var}$  就是股票收益与指数收益的协方差除以指数的方差

## 六、证券市场线中的贝塔系数如何计算？

$$J = R_j - \beta_j (R_m - R_f)$$

## 七、股票中的 $\beta$ 系数如何解释（贝塔系数）？

其绝对值越大，显示其收益变化幅度相对于大盘的变化幅度越大；

绝对值越小，显示其变化幅度相对于大盘越小。

如果是负值，则显示其变化的方向与大盘的变化方向相反；

大盘涨的时候它跌，大盘跌的时候它涨。

由于我们投资于投资基金的目的是为了取得专家理财的服务，以取得优于被动投资于大盘的表现情况，这一指标可以作为考察基金经理降低投资波动性风险的能力。

在计算贝塔系数时，除了基金的表现数据外，还需要有作为反映大盘表现的指标。

贝塔系数(Beta coefficient)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。

$\beta = 0$  表示没有风险， $\beta = 0.5$  表示其风险仅为市场的一半， $\beta = 1$  表示风险与市场风险相同， $\beta = 2$  表示其风险是市场的 2 倍。

贝塔系数反映了个股对市场(或大盘)变化的敏感性，也就是个股与大盘的相关性或通俗说的“股性”。

可根据市场走势预测选择不同的贝塔系数的证券从而获得额外收益，特别适合作波段操作使用。

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，为你带来高额的收益；

相反在一个熊市到来或大盘某个下跌阶段到来时，你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。

更多股票学习内容请访问棒槌网！

## 八、资本资产定价模型（CAPM）中的 系数一般怎么测算？

行业 系数与行业涨幅情况一览 名称 系数 名称 系数 软件及服务 1.338 机械 0.981 计算机硬件 1.271 日用化工 0.968 元器件 1.191 电力设备 0.950 传媒 1.177 汽车及配件 0.949 房地产 1.133 造纸包装 0.943 通信 1.118 纺织服装 0.942 综合 1.104 煤炭 0.937 家庭耐用消费品 1.094 贸易 0.934 建筑业 1.078 电力 0.924 金融 1.076 民航 0.920 农业 1.064 航运业 0.913 酒店旅游 1.036 钢铁 0.910 电子设备和仪器 1.031 医药 0.908 建材 1.030 公路与公路运输 0.900 零售商业 1.028 供水供气 0.856 有色 1.021 食品饮料 0.850 化工 0.989 石油 0.832

## 九、EXCEL计算股票市场的贝塔系数的方法可以教授我一下吗？希望可以详细一点..

找出一段时间收益率（日、周、月），用最小二乘供敞垛缎++等讹劝番滑估计，以市场溢价为自变量资产收益率为因变量，得到斜率项就是beta。

将portfolio中的beta按权重算出来就是组合的beta。

你还可以用Merri Lynch的调整beta，将第一步算出来的beta按： $新beta = 旧beta / 3 + 2/3$ 来得到结果

## 参考文档

[下载：如何计算某股票的贝塔系数.pdf](#)

[《定向增发股票多久完成》](#)

[《股票理财资金追回需要多久》](#)

[《同花顺股票多久提现》](#)

[《场内股票赎回需要多久》](#)

[下载：如何计算某股票的贝塔系数.doc](#)

[更多关于《如何计算某股票的贝塔系数》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/4259722.html>