

投资中贝塔是什么意思...什么是贝塔系数？-股识吧

一、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 β 值表示投资组合对系统风险的敏感程度： β 值为1，表示指数变化时，股票价格会以相同的百分率变化；

β 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；

β 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 β 值偏高的投资组合；

行情下跌时，一般选取 β 值偏低的投资组合，这样才能取得最佳收益。

当然， β 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。

二、什么是贝塔系数？

系数也称为贝塔系数，是一种风险指数，用来衡量个别股票或股票基金相对于整个股市的价格波动情况。

系数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。

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。

贝塔系数是统计学上的概念，是一个在+1至-1之间的数值，它所反映的是某一投资对象相对于大盘的表现情况。

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。

三、贝塔， 值是什么意思？

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。

四、股票投资中的高贝塔投资 阿尔法投资是什么意思

前者意思是选择波幅大于大盘的股票进行投资。
阿尔法意思是选择涨幅能够大于大盘的股票进行投资，通过做空股指期货，对个股的系统性风险进行对冲，追求阿尔法收益

五、股票的贝塔系数是什么意思

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。

贝塔系数是统计学上的概念，它所反映的是某一投资对象相对于大盘的表现情况。

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。

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%。

请注意：股市实践证明，贝塔系数并不能准确用来评估股票的市场风险和涨跌关系，在实盘操作中的意义不大。

六、什么是证券、基金投资中的阿尔法和贝塔收益？

由大盘上涨带来的收益，称为贝塔收益，就是水涨船高带来的收益，贝塔收益高并

不代表水平高。
而由选股带来的收益，称为阿尔法收益。

七、谁能简述贝塔系数及其大小的含义？证券投资学考试题，谢谢亲们了

系数（Beta coefficient），是一种风险指数，用来衡量个别股票或股票基金相对于整个股市的价格波动情况。

系数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。

贝塔系数利用回归的方法计算：

- 1、贝塔系数等于1即证券的价格与市场一同变动。
- 2、贝塔系数高于1即证券价格比总体市场更波动。
- 3、贝塔系数低于1即证券价格的波动性比市场为低。
- 4、如果 $\beta = 0$ 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。

八、股市中贝塔值是什么？

贝塔值，是一个相关系数，是指个股对于大盘的敏感度，当贝塔值大于1时，说明个股对大盘比较敏感，其波动性要大于大盘；

等于1，说明其波动与大盘同步；

小于1则说明其波动性要小于大盘。

参考文档

[下载：投资中贝塔是什么意思.pdf](#)

[《为什么股票价格受大盘影响大》](#)

[《股票红绿柱代表什么》](#)

[《智富创投什么时候上线的股票》](#)

[《通达信软件如何调成分笔金额》](#)
[下载：投资中贝塔是什么意思.doc](#)
[更多关于《投资中贝塔是什么意思》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/author/75639003.html>