

股票白塔系数怎么计算：财务管理中的贝尔塔系数怎么计算-股识吧

一、到底该如何得出beta系数

CAPM模型求beta系数计算方法： $BETA () = (y - c) \div x = y / x$

式中： y 为某金融商品的预期收益 - 该预期收益中的非风险部分；

x 为整个市场的预期平均收益 - 该预期收益中的非风险部分。

式中表示市场收益率变动对某一金融商品收益率变动的程度。

Beta可以视为一个放大系数，假设某只股票相对上证指数的Beta是1.5%，那么就意味着上证指数每上涨或下跌1%，这只股票就会上涨或下跌1.5%，波动较大；反之若Beta仅为0.6，那么上证指数每上涨或下跌1%，这个股票就会上涨或下跌0.6%，波动较小

二、怎么算一个股票的贝塔系数阿？

用这支股票的今天收盘的大盘指数 - 昨天收盘的大盘指数 在除以
昨天收盘的大盘指数

三、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 $\sigma_j = \text{cov}(K_j, K_m) / \sigma_m$ $\sigma_j^2 = r_{jm} \sigma_j \sigma_m$ $\sigma_j = r_{jm} \sigma_m$ (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： $K_m = (P_t - P_{t-1}) / P_{t-1}$ (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

四、财务管理中的贝塔系数怎么计算

贝塔系数=股票收益率与市场组合平均收益率之间的协方差/市场组合标准差的平方
=该股票与整个股票市场的相关系数*该股票的标准差/整个市场的标准差

系数等于1 说明它的系统风险与整个市场的平均风险相同 系数大于1 (如为2)
说明它的系统风险是市场组合系统风险的2倍 系数小于1 (如为0.5)
说明它的系统风险只是市场组合系统风险的一半

五、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。

六、财务管理中的贝塔系数怎么计算

七、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。

八、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 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 值。

九、请问在知道一个股票组合中三只股票的 系数和他们所占的比例的情况向，如何算出这个股票组合的 系数。

用各自的 系数乘以各自的资金所占百分比，再求和即可。
证券之星问股

参考文档

[下载：股票白塔系数怎么计算.pdf](#)

[《股票银证转账要多久》](#)

[《股票持有多久合适》](#)

[《股票要多久才能学会》](#)

[《联科科技股票中签后多久不能卖》](#)

[《股票改手续费要多久》](#)

[下载：股票白塔系数怎么计算.doc](#)

[更多关于《股票白塔系数怎么计算》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/book/27375541.html>