

# 股票贝塔值高代表了什么 - 贝塔，值是什么意思？-股识吧

## 一、贝塔值在中国指的是什么？

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。

通过简单举例和论述，可以得出这样结论，证券的贝塔值越高，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。

## 二、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。

## 三、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

## 四、股市中贝塔值是什么？

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

$\beta$  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；

$\beta$  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  $\beta$  值偏高的投资组合；

行情下跌时，一般选取  $\beta$  值偏低的投资组合，这样才能取得最佳收益。

当然， $\beta$  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。

## 五、 $\beta$ 系数大说明什么?股票里

$\beta$  系数反映个股相对于大盘的波动性，绝对值越大就表示波动性越强。

正值表示随大盘的趋势，越高说明大盘涨他涨得更厉害，大盘跌他跌得更厉害。

负值表示反大盘趋势，负值的绝对值越大表示大盘涨得时候他跌得更厉害，反之，表示大盘跌得时候他反而涨得更厉害。

所谓  $\beta$  系数在发达资本市场也许是一个可以参考的值，但我国资本市场发展才数十年，系统尚未形成，也非市场经济，所以这个  $\beta$  系数，这么学术化理想化的东西，除非你写报告糊弄老板，自己的话还是不要参考，免得耽误正事。

## 六、高贝塔值指数的介绍

高贝塔值指数 High Beta Index。

名。

用单数。

高贝塔值股票组成的指数。

贝塔值是个别股票相对整个市场而言的波动幅度。

## 七、股票 $\beta$ 系数最大好不好

$\beta$  系数是一个相对指标、 $\beta$  越高意味着股票相对于业绩评价基准的波动性越大、

大于1 则股票的波动性大于业绩评价基准的波动性 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%

## 参考文档

[下载：股票贝塔值高代表了什么.pdf](#)

[《转账到股票信用账户上要多久》](#)

[《亿成股票停牌多久》](#)

[《退市股票确权申请要多久》](#)

[《股票保价期是多久》](#)

[《场内股票赎回需要多久》](#)

[下载：股票贝塔值高代表了什么.doc](#)

[更多关于《股票贝塔值高代表了什么》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/chapter/40304486.html>