

股票的beta系数怎么计算股票的值怎么算？-股识吧

一、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 $\beta_j = \frac{\text{cov}(K_j, K_m)}{\sigma_m^2} = r_{jm} \frac{\sigma_j}{\sigma_m}$ (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标准差、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： $K_m = \frac{P_t - P_{t-1}}{P_{t-1}}$ (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

二、到底该如何得出beta系数

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

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

三、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*：<http://blog.163.com/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 β 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 β 值。

四、股票中的beta系数

一般的股票软件里都有如：大智慧 同花顺等 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的"股性"。

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

当有很大把握预测到一个大牛市或大盘某个上涨阶段的到来时，应该选择那些高系数的证券，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的到来时，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 系数的证券。

例如，一支个股 系数为1.3，说明当大盘涨1%时，它有可能涨1.3%，同理大盘跌1%时，它有可能跌1.3%；

但如果一支个股 系数为-1.3时，说明当大盘涨1%时，它有可能跌1.3%，同理大盘跌1%时，它有可能涨1.3%。

如果跟踪 系数的变化，可以看出个股股性的变化，和主力进出的情况。

不知道是否说明白了? ^_^

五、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。

六、股票的 值怎么算？

(Beta)系数-----BETA(N)

返回当前证券N周期收益与大盘收益相比的贝塔系数.

参考文档

[下载：股票的beta系数怎么计算.pdf](#)

[《巴奴火锅多久股票上市》](#)

[《股票k线看多久》](#)

[《股票多久才能卖完》](#)

[下载：股票的beta系数怎么计算.doc](#)

[更多关于《股票的beta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/chapter/73014681.html>