

股票贝塔值超过1怎么办...贝塔，Beta值是什么意思啊？-股识吧

一、贝塔，Beta值是什么意思啊？

同学你好，很高兴为您解答！

比对同期总体市场运动来量度一种特定股票的价格运动。

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。

如果股票的贝塔值大于1，即认为该股票的风险高于市场。

希望高顿网校的回答能帮助您解决问题，更多财会问题欢迎提交给高顿企业知道。

高顿祝您生活愉快！

二、-多样性指数可以超过1吗？

可以，证明个股风险大于市场风险。

三、如何解释一只股票的Beta值接近于1

beta值，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。

值越高，意味着股票相对于业绩评价基准的波动性越大，反之亦然。

当 $\beta=1$ 时，表示该股票的收益和风险与大盘指数收益和风险一致；

当 $\beta > 1$ ；

1时，表示该股票收益和风险均大于大盘指数的收益和风险。

四、如果股票的贝塔值低于1，表达什么？

展开全部同学你好，很高兴为您解答！贝塔值

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。

马上就要2022年下半年CMA资格考试了，在这里祝大家好好考试，每个人都超常发挥，取得好成绩！

希望我的回答能帮助您解决问题，如您满意，请采纳为最佳答案哟。

再次感谢您的提问，更多财会问题欢迎提交给高顿企业知道。

高顿祝您生活愉快！

五、股票中beta值可以为负值吗？

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。

贝塔系数是量度股票投资系统风险的指标。

所谓系统风险是指股票投资中没有办法通过分散投资来减低风险，即是由整体经济状况和整体市场因素所造成的风险(如利率变动)，与个别公司没有直接的关系。

与其相对的是非系统风险，即由个股的个别因素(如会计丑闻)所造成的风险，是可以通过分散投资来消弭掉的。

金融学运用了贝塔系数来计算在一只股票上投资者可期望的合理风险回报率：

个股合理回报率 = 无风险回报率 + β × (整体股市回报率 - 无风险回报率)

*可用基准债券的收益率代表 β = 1，代表该个股的系统风险等同大盘整体系统风险，即受整体经济因素影响的程度跟大盘一样；

β > 1则代表该个股的系统风险高于大盘，即受整体经济因素影响的程度甚于大盘。

β越高，投资该股的系统风险越高，投资者所要求的回报率也就越高。

高β的股票通常属于景气循环股(cyclicals)，如地产股和耐用消费品股；

低β的股票亦称防御类股(defensive

stocks)，其表现与经济景气的关联度较低，如食品零售业和公用事业股。

个股的β系数可能会随着大盘的升或跌而变动，有些股票在跌市中可能会较在升市具更高风险。

参考文档

[下载：股票贝塔值超过1怎么办.pdf](#)

[《巴奴火锅多久股票上市》](#)

[《二级市场高管增持的股票多久能卖》](#)

[《股票通常会跌多久》](#)

[《股票委托多久才买成功》](#)

[下载：股票贝塔值超过1怎么办.doc](#)

[更多关于《股票贝塔值超过1怎么办》的文档...](#)

??

<https://www.gupiaozhishiba.com/read/22745630.html>