

## 上市公司风险系数怎么找|-股识吧

### 一、股票的风险系数（即贝塔系数）可以在哪找到？？？或是可以通过什么方式得知？？？

简单的理解就是，你的组合与大盘上涨或下跌的幅度的比率。

比如，大盘上涨20%，你的组合上涨30%，你的组合的贝塔系数就是1.5.科学的组合应该是保持在1上下，才能使你的收益体现大盘的涨跌。

大于1的系数说明你的组合是偏风险的，涨起来收益高，跌起来损失大。

小于1的组合就没劲了。

具体到股票，大盘蓝筹股的贝塔系数较小，创业板的贝塔系数大，看涨的时候如果胆子大就选贝塔系数大的股票。

要是长线投资，为的是分享经济增长的收益，就不要选择贝塔系数大的股票组合。

### 二、用同花顺软件 怎么看一个企业的风险系数（贝塔值）

这个好像没有吧，你要自己算的吧，用  $\beta = \frac{im}{(m)^2}$ ，带入几年的数据，算一下就好了

### 三、中国A股上市公司的BETA系数那里可以查到谢谢

可以计算 系数计算方式 (注：杠杆主要用于计量非系统性风险)

(一)单项资产的 系数 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，即： $\beta =$

$\beta = \frac{r_i - r_f}{r_m - r_f}$

另外，还可按协方差公式计算 值，即  $\beta = \frac{\text{Cov}(r_i, r_m)}{\text{Var}(r_m)}$

注意：掌握 值的含义

$\beta = 1$ ，化，其风险情况与市场投资组合的风险情况一致；

$\beta > 1$ ；

1，则该单项资产的风险大于整个市场投资组合的风险；

$\beta < 1$ ；

1，则该单项资产的风险程度小于整个市场投资组合的风险。

小结：1) 值是衡量系统性风险，2) 系数计算的两种方式。

Beta的含义 Beta系数起源于资本资产定价模型(CAPM模型)，它的真实含义就是特定资产(或资产组合)的系统风险度量。

所谓系统风险，是指资产受宏观经济、就是股票与大盘之间的连动性，系统风险比例越高，连动性越强。

与系统风险相对的就是个别风险，即由公司自身因素所导致的价格波动。

总风险=系统风险+个别风险 而Beta则体现了特定资产的价格对整体经济波动的敏感性，即，该股票的价格变动了几个百分点。

用公式表示就是：实际中，一般用单个股票资产的历史收益率对同期指数(大盘)收益率进行回归，回归系数就是Beta系数。

Beta的一般用途 一般的说，Beta的用途有以下几个：

- 1)计算资本成本，做出投资决策(只有回报率高于资本成本的项目才应投资)；
- 2)计算资本成本，制定业绩考核及激励标准；
- 3)计算资本成本，进行资产估值(Beta是现金流贴现模型的基础)；
- 4)确定单个资产或组合的系统风险，用于资产组合的投资管理，特别是股指期货或其他金融衍生品的避险(或投机)。

对Beta第四种用途的讨论将是本文的重点。

组合Beta Beta系数有一个非常好的线性性质，即，

## 四、去哪里查找上市公司的这些财务数据

下载股票软件，F10或按数字10，即可进入察看。

## 五、风险报酬系数 有哪几种确定方法?

风险报酬系数是指将标准离差率转化为风险报酬的一种系数。

风险报酬系数的确定，有如下几种方法：1.根据以往的同类项目加以确定。

2.由企业领导或企业组织有关专家确定。

3.由国家有关部门组织专家确定。

## 六、

## 七、怎样能查到上市公司贝塔系数？

貌似在华西证券交易平台的每个公司的资料上就能看到，有一个  $\beta$  值的标注

## 八、在哪可以找到股票风险系数

可通过贝塔系数查找。

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。

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。

## 九、企业风险系数 类似(医药制造业)的沪深A股股票100周上市公司Beta参数计算确定

(5) 贝塔系数在证券市场中的应用贝塔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说的“股性”。

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

当有很大把握预测到一个大牛市或大盘某个不涨阶段的到来时，应该选择那些高贝塔系数的证券，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，办法是选择那些低贝塔系数的证券。

----- 系数计算挺复杂，没仔细研究过。

但我个人想法此系数主要用于研究股票对于市场的敏感程度的话，只要知道它和大盘变动的相关性就行了，可以使其简单化处理。

有一种简单的求回归系数的方法用于上面。

系数 = 股票价格波动 / 市场总体价格波动具体到医药制造业来说。

以2008.1.31和2008.12.31的指数为计算医药业的贝塔系数 =  $[(Y_{12}-Y_1)/(Y_{12}+Y_1)/2]/[(A_{12}-A_1)/(A_{12}+A_1)/2]$  Y1是医药业2008.1.31的指数，Y12是医药业2008.12.31的指数。

同理A12，A1相同。

最后计算得到0.72 既2008年熊市的情况下。

医药业跌得比大盘要慢。

这只是一年的数据，要多得到几年的数据必须慢慢计算了。

以上为个人想法。

希望交流指正。

## 参考文档

[下载：上市公司风险系数怎么找.pdf](#)

[《股票融资余额与股价背离说明什么》](#)

[《股票收益什么意义》](#)

[《新开普股票是什么板块的》](#)

[《炒股开户的证券公司有什么区别》](#)

[《股票卖3大单是什么意思》](#)

[下载：上市公司风险系数怎么找.doc](#)

[更多关于《上市公司风险系数怎么找》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/read/37476470.html>