

如何根据模型中的贝塔值选股票——股票的贝塔值怎么看？-股识吧

一、股票中的贝塔值是怎么回事？有什么简便计算方法？和股指什么关系？

cov/var 就是股票收益与指数收益的协方差除以指数的方差

二、怎么算出一只股票的贝塔系数

如果 β 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 β 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 β 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%。

三、股票中的贝塔值是怎么回事？有什么简便计算方法？和股指什么关系？

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。

四、股票的贝塔值怎么看？

呵呵，一般的交易软件里面根本就没有计算贝塔值。

查查wind这样的软件吧，国外的股票查查blomberg，美股好像yahoo上有免费的，国内股票好像还没发现有免费的。

你也可以自己用EXCEL计算股票的贝塔值，如果需要计算方法可发邮箱地址出来

五、股票中的贝塔值是什么意思

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。

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。

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。

扩展资料贝塔值的应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，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。

为避免非系统风险，可以在相应的市场走势下选择那些相同或相近贝塔系数的证券进行投资组合。

比如：一支个股贝塔系数为1.3，说明当大盘涨1%时，它可能涨1.3%，反之亦然；

但如果一支个股贝塔系数为-1.3%时，说明当大盘涨1%时，它可能跌1.3%，同理，

大盘如果跌1%，它有可能涨1.3%。

参考资料来源：搜狗百科-贝塔值

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.

七、投资组合的贝塔值计算

投资组合的贝塔是各个股票的贝塔的加权平均，具体地投资组合贝塔= $1 \times 20\% + 20 \times 10\% + 91 \times 30\% + 52 \times 40\% = 50.3$ 。

为了便于理解，试举例说明。

假设上证指数代表整个市场，贝塔值被确定为1。

当上证指数向上涨10%时，某股票价格也上涨10%，两者之间涨幅一致，风险也一致，量化该股票个别风险的指标——贝塔值也为1。

如果这个股票波动幅度为上证指数的两倍，其贝塔值便为2，当上证指数上升10%时，该股价格应会上涨20%。

若该股票贝塔值为0.5，其波动幅度仅为上证指数的1/2，当上证指数上升10%时，该股票只涨5%。

扩展资料：贝塔值性质：为了便于理解，试举例说明。

假设上证指数代表整个市场，贝塔值被确定为1。

当上证指数向上涨10%时，某股票价格也上涨10%，两者之间涨幅一致，风险也一致，量化该股票个别风险的指标——贝塔值也为1。

如果这个股票波动幅度为上证指数的两倍，其贝塔值便为2，当上证指数上升10%时，该股价格应会上涨20%。

若该股票贝塔值为0.5，其波动幅度仅为上证指数的1/2，当上证指数上升10%时，该股票只涨5%。

同样道理，当上证指数下跌10%时，贝塔值为2的股票应该下跌20%，而贝塔值为0.5的股票只下跌5%。

于是，专业投资顾问用贝塔值描述股票风险，称风险高的股票为高贝塔值股票；风险低的股票为低贝塔值股票。

参考资料来源：搜狗百科-贝塔值

八、股票中的 系数如何解释（贝塔系数）？

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。

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。

$\beta = 0$ 表示没有风险， $\beta = 0.5$ 表示其风险仅为市场的一半， $\beta = 1$ 表示风险与市场风险相同， $\beta = 2$ 表示其风险是市场的2倍。

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。

为避免非系统风险，可以在相应的市场走势下选择那些相同或相近贝塔系数的证券进行投资组合。

更多股票学习内容请访问棒槌网！

参考文档

[下载：如何根据模型中的贝塔值选股票.pdf](#)

[《上市公司回购股票多久卖出》](#)

[《股票卖出多久可以转账出来》](#)

[《财通证券股票交易后多久可以卖出》](#)

[《股票基金回笼一般时间多久》](#)

[下载：如何根据模型中的贝塔值选股票.doc](#)

[更多关于《如何根据模型中的贝塔值选股票》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/4217483.html>