贝塔系数中股票收益率怎么算.证券市场线中的贝塔系数如何计算？-股识吧

一、财务管理中的贝尔塔系数怎么计算

贝塔系数=股票收益率与市场组合平均收益率之间的协方差/市场组合标准差的平方
=该股票与整个股票市场的相关系数*该股票的标准差/整个市场的标准差
β系数等于1 说明它的系统风险与整个市场的平均风险相同 β系数大于1（如为2）
说明它的系统风险是市场组合系统风险的2倍 β系数小于1（如为0.5）
说明它的系统风险只是市场组合系统风险的一半

二、已知A股票的贝塔值和期望收益率，和B股票的贝塔值和期望收益率，怎样算无风险利率

R1 = Rf + beta1 * MPR2 = Rf + beta2 * MP其中MP为market premium，即Rm - Rf，作为整体考虑，无分解必要。
通过(R1-R2)/(beta1-beta2)计算出MP将MP带入任何一式，均可解出Rf

三、A公司股票的贝塔系数为2，无风险利率为5%，市场上所有股票的平均报酬率为10%。要求计算该公司股票的预期...

（1） 该公司股票的 预期收益率：6%＋（10%－6%）＊2．5＝16%（2）
若该股票为固定成长股票，成长率为6%，预计一年后的股利为151735元，则
该股票的价值：1．5＆＃47；
（16%－6%）＝15元（3）若未来三年股利按20%增长5而后每年增长6%，则该股票价值：2＊1．2＆＃47；
1．16＋2＊1．2＊1．2＆＃47；
（1．16＊1．16）＋2＊1．2＊1．2＊1．2＆＃47；
（1．16＊1．16＊1．16）＋2＊1．2＊1．2＊1．2＊1．06＆＃47；
（16%－6%）＝43．06元

四、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βj=cov(Kj，Km)δ2m=rjmδjδmδ2m=rjm(δjδm)(4)
式中：cov(Kj，Km)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准差、市场组合的标准差及两者相关系数的乘积；
δj为风险资产j的收益率标准差，δm为市场组合收益率的标准差，
rjm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，
Kj为风险资产j的收益率，Km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：Km=Pt-Pt-1Pt-1(5) 其中：
Pt表示第T年末的上证综指 Pt-1表示第T年初的上证综指

五、两种股票，β系数为2和1.2。无风险报酬率为5%，投资组合的风险收益率为6%。计算投资组合的预期收益率

E(R) = Rf + beta * [E(R)-Rf] // 预期收益等于无风险收益加上风险溢价= 5% + beta * 6% 其中，beta(portfolio) = w_a * beta_a + w_b * beta_b // 投资组合的beta等于每种资产的beta按照其市值权重累加之和lz的题目里没有给出两种股票的价值权重w_a，w_b。
如果我们假定投资组合中两种股票的市值相等，w_a=w_b=0.5，则E(R) = 5% + (0.5 * 2 + 0.5 * 1.2) * 6% = 14.6%

六、计算贝塔系数的公式是什么？

βa=Cov(Ra，Rm)/σ²m其中，βa是证券a的贝塔系数，Ra为证券a的收益率，Rm为市场收益率，Cov(Ra，Rm)是证券a的收益与市场收益的协方差，σ²m是市场收益的方差。
β系数也称为贝塔系数，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。
β系数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。
扩展资料：贝塔系数衡量股票收益相对于业绩评价基准收益的总体波动性，是一个相对指标。
β 越高，意味着股票相对于业绩评价基准的波动性越大。

β 大于 1，则股票的波动性大于业绩评价基准的波动性。
反之亦然。
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% 。
β 越大，证券价格波动（σ a）相对于总体市场波动（σ m）越大；
同样， β 越小，也不完全代表 σ a相对于 σ m越小。
甚至即使 β =
0也不能代表证券无风险，而有可能是证券价格波动与市场价格波动无关（ρ am= 0），但是可以确定，如果证券无风险（σ a）， β 一定为零。
参考资料来源： 百科——β 系数

七、两种股票， β 系数为2和1.2。风险报酬率为5%，投资组合的风险收益率为6%。计算投资组合的预期收益率。

展开全部这个题从现有条件看没法计算。
首先不知道无风险收益率。
另外如果组合的风险收益率为6%，市场风险报酬率为5%，则组合的 β 系数=1.2，
两种股票最低的 β 系数都为1.2，所以推导组合中只有乙股票，没有甲股票。
但由于不知道无风险收益率，所以还是没法计算。
-----个人意见

八、证券市场线中的贝塔系数如何计算？

β J=Rjm(σ j/ σ m)

九、如何计算一支股票的贝塔系数

关于贝塔系数在股票百科里有详细的说明，你可以去那里看看就知道了。

参考文档

下载：贝塔系数中股票收益率怎么算.pdf
《30万买股票能买多久》
《股票跌了多久会回来》
《股票改手续费要多久》
《大股东股票锁仓期是多久》
下载：贝塔系数中股票收益率怎么算.doc
更多关于《贝塔系数中股票收益率怎么算》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/store/27426327.html