

# 股票贝塔值怎么计算干货.怎么算一个股票的贝塔系数阿? -股识吧

## 一、如何计算调整各企业的贝塔值？

由于Beta是股票（或组合）历史收益率对同期指数收益率的回归系数，因此，在Beta计算中面临的第一个问题就是样本频率的选取，即，我们是用组合的日收益率、周收益率还是月收益率来进行回归。

目前市场上流行的Beta一般是以周收益率回归计算的，这样做主要是为了剔除涨跌停板的影响——涨跌停板的限制在一定程度上缩小了真实的Beta值。

但是，各种指数的周波动率显著大于日波动率（见表），如果我们应用Beta于股指期货的套利，那么，T+0模式下更频繁的交易显然要求我们提供更加精确的日Beta值。

## 二、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\*：[//blog.163\\*/abhor@126/blog/static/1684612520071110111742265/](http://blog.163*/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 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 值。

## 三、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。

## 四、怎么算一个股票的贝塔系数阿？

用这支股票的今天收盘的大盘指数 - 昨天收盘的大盘指数 在除以  
昨天收盘的大盘指数

## 五、如何计算调整各企业的贝塔值？

## 六、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 
$$\beta_j = \frac{\text{cov}(K_j, K_m)}{\sigma_m^2} = r_{jm} \frac{\sigma_j}{\sigma_m} \quad (4)$$

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准差、市场组合的标准差及两者相关系数的乘积；

$\sigma_j$ 为风险资产j的收益率标准差， $\sigma_m$ 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

## 七、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。

## 八、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：股票贝塔值怎么计算干货.pdf](#)

[《000611股票是做什么的》](#)

[《溢价转增股本为什么不交个税》](#)

[《股票下跌为什么主力流入》](#)

[《现在的中国股票市场处于什么阶段》](#)

[《股票连拉3个板后还可以买吗》](#)

[下载：股票贝塔值怎么计算干货.doc](#)

[更多关于《股票贝塔值怎么计算干货》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/subject/26751784.html>