

## 股票中的贝塔值是什么意思

意思是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。

证券的贝塔值越高，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。

## 美国股市中的贝塔系数是什么意思

贝塔系数"是一个统计学上的概念,是一个在 + 1至-1之间的数值,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,因此这一指标可以作为考察基金管理人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.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%.

基金较高的净值增长率可能是在承受较高风险的情况下取得的，因此仅仅根据净值增长率来评价基金的业绩表现并不全面，衡量基金表现必须兼顾收益和风险两个方面，夏普比率就是一个可以同时收益与风险加以综合考虑的指标。夏普比率又被称为夏普指数，由诺贝尔奖获得者威廉·夏普于1966年最早提出，目前已成为国际上用以衡量基金绩效表现的最为常用的一个标准化指标。

## 股票的阿尔法贝塔指的是什么

股票阿尔法是度量股票投资系统风险的指标；贝塔是一种风险指数，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。

通常股票与整个股票市场的相关系数越大，贝塔系数越大，贝塔系数大于1，说明该资产的风险大于市场平均风险。

## 股市中贝塔值是什么

股市中的贝塔值是一种风险系数，用来衡量股票相对于整个市场的波动情况。贝塔系数越高，说明股票的波动性越大机会多，同时面临的系统性风险就很高。贝塔系数越低，可能说明股价波动小，股价稳定。

### 如何根据贝塔值选股呢？

股价处于上升趋势，这个时候选择贝塔值较高的股票，因为这类股票会成倍放大市场收益，给投资者带来高额的收益；行情下跌时或调整的时候，就要调整投资机构抵御市场风险，因此可以选择贝塔值偏低的投资组合，这样才能取得最佳预期年化预期收益。

一般来说，风险和收益都是成正比的，所以如果追求高收益，自然要承担高风险。不过在选股的时候，最好不要单一地根据贝塔值选股，还需要结合基本面和技术面分析。

## 股票高贝塔值啥意思

你好，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。证券的贝塔值越高，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。

比如，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。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%。

风险提示：本信息部分根据网络整理，不构成任何投资建议，投资者不应以该等信

息取代其独立判断或仅根据该等信息作出决策，不构成任何买卖操作，不保证任何收益。如自行操作，请注意仓位控制和风险控制。