

Бета коэффициент

Орынбасаров Алмат
Бектенбай Саят

МСМ-112К



Содержание

- Что такое *бета коэффициент*?
- Расчёт коэффициента



Что такое бета коэффициент?

- *Бета-коэффициент* (бета-фактор) — показатель, рассчитываемый для ценной бумаги или портфеля ценных бумаг.
- Является мерой рыночного риска, отражая изменчивость доходности ценной бумаги (портфеля) по отношению к доходности другого портфеля.



Расчёт коэффициента

$$\beta_a = \text{Cov}(r_p, r_a) / \text{Var}(r_p)$$

- $r(a)$ — оцениваемая величина, для которой вычисляется коэффициент Бета
- $r(p)$ — эталонная величина, с которой происходит сравнение
- Cov — ковариация оцениваемой и эталонной величины
- Var — дисперсия эталонной величины



