

股票波动率怎么用、江恩股票波动率是怎么算的？举例说明-股识吧

一、如何用GARCH求股票的具体波动率数据

建议你用股票年收益波动率，具体计算步骤是：1.从finance.yahoo*上面找到你要的公司的股票资料，将其每天的历史价格下载下来，然后选用Adjusted Close Price；2.把它们复制到Excel Spreadsheet里，然后用STDEV计算标准差，就OK了。这是你要的答案么？

二、如何计算股票历史波动率 详细 0 3

财富创业板技巧：下面以计算股票的历史波动率为例加以说明。

- 1、从市场上获得标的股票在固定时间间隔(如每天、每周或每月等)上的价格。
- 2、对于每个时间段，求出该时间段末的股价与该时段初的股价之比的自然对数。
- 3、求出这些对数值的标准差，再乘以一年中包含的时段数量的平方根(如，选取时间间隔为每天，则若扣除闭市，每年中有250个交易日，应乘以根号250)，得到的即为历史波动率。

历史波动率是基于过去的统计分析得出的，假定未来是过去的延伸，利用历史方法估计波动率类似于估计标的资产收益系列的标准差。

在股票市场中，历史波动率反映标的股价过去的波动。

然而，由于股价波动难以预测，利用历史波动率对权证价格进行预测一般都不能保证准确，但是由于目前我国内地没有权证市场，因而无法获得权证价格，也就无法计算隐含波动率。

因此权证发行商不投资者在权证发行初期只能利用历史波动率作参考。

三、江恩股票波动率是怎么算的？举例说明

指标中roc就是算波动的其公式是ROC：100*(CLOSE-REF(CLOSE，N))/REF(CLOSE，N)；
MAROC：MA(ROC，M)

四、请教投资大师江恩理论的波动率如何运用?

对于江恩，我觉得有点象气功大师，他的理论很奇怪，也许他是比较早发现波动率并应用到投资上，需要知道的是在1900那个年代的资本市场是个强信息市场，股票的价格并未完全包含其内在的价值和风险，通过历史数据观察出波动率的确可以获得套利，但是现代的资本市场远远比那个年代复杂的多了，最主要的一点是汇率的影响，现在资本的流动性远远非那个时代可以相比的。

理论上波动率表示一种干扰（象wiener process），并遵循正态分布，一种算法可以通过历史数据来计算，但是计算工作难度大（注1），实际通常方法是通过市场上已有的期权价格代进black-scholes的公式中算出隐含波动率。

隐含波动率在应用中有个很著名的Var模型，通过它计算未来一段时间最坏的可能下损失有多少。

隐含波动率还可以作一个指标来预测未来股票价格上升和跌的幅度。

问题是波动率需要期权价格来指导才能观察，现在国内还没有期权市场，所以这一变量只能通过历史数据做大概估计。

同时波动率有误差，需要修正，如波动率微笑(这个现象有点象江说的共振现象).注

1：在弱信息市场理论中认为今天股票的价格已经完全表露了其价格的风险，所以今天的价格不能预测未来价格。

五、请问股票波动率如何计算

指标中roc就是算波动的其公式是ROC：100*(CLOSE-REF(CLOSE，N))/REF(CLOSE，N)；
MAROC：MA(ROC，M)

六、股票术语：波动率 什么是实际波动率

实际波动率，度量波动率的方法，是指对期权有效期内投资回报率波动程度的度量，大体上可分为参数法和非参数法两类。

要明确实际波动率，首先要从波动率的概念入手。

波动率（Volatility）：是指关于资产未来价格不确定性的度量。

它通常用资产回报率的标准差来衡量。

也可以指某一证券的一年最高价减去最低价的值再除以最低价所得到的比率。

业内将波动率定义为价格比率自然对数的标准差。

波动率的种类有：实际波动率，隐含波动率，历史波动率等等，实际波动率便是波动率的一种。

波动率指数：1、实际波动率实际波动率又称作未来波动率，它是指对期权有效期内投资回报率波动程度的度量，由于投资回报率是一个随机过程，实际波动率永远是一个未知数。

或者说，实际波动率是无法事先精确计算的，人们只能通过各种办法得到它的估计值。

2、历史波动率历史波动率是指投资回报率在过去一段时间内所表现出的波动率，它由标的资产市场价格过去一段时间的历史数据（即 S_t 的时间序列资料）反映。

这就是说，可以根据 $\{S_t\}$ 的时间序列数据，计算出相应的波动率数据，然后运用统计推断方法估算回报率的标准差，从而得到历史波动率的估计值。

显然，如果实际波动率是一个常数，它不随时间的推移而变化，则历史波动率就有可能实际波动率的一个很好的近似。

3、预测波动率预测波动率又称为预期波动率，它是指运用统计推断方法对实际波动率进行预测得到的结果，并将其用于期权定价模型，确定出期权的理论价值。

因此，预测波动率是人们对期权进行理论定价时实际使用的波动率。

这就是说，在讨论期权定价问题时所用的波动率一般均是指预测波动率。

需要说明的是，预测波动率并不等于历史波动率，因为前者是人们对实际波动率的理解和认识，当然，历史波动率往往是这种理论和认识的基础。

除此之外，人们对实际波动率的预测还可能来自经验判断等其他方面。

4、隐含波动率隐含波动率是期权市场投资者在进行期权交易时对实际波动率的认知，而且这种认知已反映在期权的定价过程中。

从理论上讲，要获得隐含波动率的大小并不困难。

由于期权定价模型给出了期权价格与五个基本参数（ $S_t, X, r, T-t$ 和 σ ）之间的定量关系，只要将其中前4个基本参数及期权的实际市场价格作为已知量代入期权定价模型，就可以从中解出惟一的未知量 σ ，其大小就是隐含波动率。

因此，隐含波动率又可以理解为市场实际波动率的预期。

期权定价模型需要的是在期权有效期内标的资产价格的实际波动率。

相对于当期时期而言，它是一个未知量，因此，需要用预测波动率代替之，一般可简单地以历史波动率估计作为预测波动率，但更好的方法是用定量分析与定性分析相结合的方法，以历史波动率作为初始预测值，根据定量资料和新得到的实际价格资料，不断调整修正，确定出波动率。

参考文档

[下载：股票波动率怎么用.pdf](#)

[《一支股票的分红多久为一期》](#)
[《中信证券卖出股票多久能提现》](#)
[《股票钱拿出来需要多久》](#)
下载：[股票波动率怎么用.doc](#)
[更多关于《股票波动率怎么用》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/author/23247955.html>