

请问股票的波动率怎样计算；eviews中如何用garch（1，1）计算股票波动率-股识吧

一、eviews中如何用garch（1，1）计算股票波动率

打开Eviews然后点击Quick然后点击Equation Estimation，然后选择ARCH方法，然后估计就行了

二、股票的波动性是按什么指标算的

你所说的波动性实际上是要求股票的某一段时间波动率来判断其中波动性最大及最小的股票股票的波动性，股票上的所谓波动率实际上就是统计学上所说的离散系数。

三、如何在eviews中用garch计算股票波动率

view里面找到garch模型

四、请问股票的波动率怎样计算，详细步骤？

我所知道的股票波动率是出自江恩理论。

由于江恩本人并没有对波动率进行过详细的描述所以现在市面上所有有关波动率的算法全是后人根据他的理念推断的。

我现在所知道的算法有三种。

第一就是两个高点（低点）的差除以两个高点（低点）之间的时间。

比如说两个高点分别为15和10，时间是10个交易日那么 $15-10=5$ ， $5/10=0.5$ ，0.5就是波动率。

第二种方法也很简单就是你自己去推断波动率，比如上证指数，你可以用10 20 40 80 160这种点数去挨个的套，股票一般用，0.1 0.2 0.4 0.8 或0.05 0.1 0.2 0.4等等看看哪个在历史上最适用。

支持这一算法的是因为江恩在他写的商品期货教程中曾经提到过5月咖啡的1*1线的画法是以前以1点、12点、30点对应一天为波动率，画1*1线的，但书中却没写为什么用这3个数。

根据我所掌握的江恩理论知识这很有可能是分别用到了太阳，木星和土星的周期。太阳，木星，土星的周期分别是1年，12年，30年。

第三种就是股票的最小波动单位，比如咱们股票的最小波动单位为0.01元。

支持这一算法是因为在江恩那个年代没有计算机，股票绘图只能是人力手工作业。江恩只用一种8*8的坐标纸，这纸上的1*1线永远是45°，而1/8美分是当时商品的最小波动单位。

五、Eviews中如何用garch (1 , 1) 计算股票波动率

打开Eviews然后单击Quick然后单击Equation Estimation，然后选择ARCH方法，然后估计就行了

六、江恩理论中的“波动率”怎么算？

市场上对波动率有两种观点：

第一种，在市场中单位时间内价格上升或下降的幅度。

第二种，市场每一段时间运行多少个周期，即频率。

在江恩角度线上的运用应选择第一种描述。

这里有个不可忽略的概念就是单位时间，它与图表的时间轴刻度有关，而且还涉及到各种不同时间划分的图表，如日线图、周线图、月线图、分时图。

现在有些分析软件扩充到季线图、年线图和自定义线图。

由于时间不同，波动率就有所不同了，也就是说波动率不是固定的。

投资者可能根据自身的需要特别关心某一类型的时间段图表，以把握其中最佳交易时机，但建议投资者多结合不同时间段图表分析。

在《江恩角度线与时间之窗》一书里曾提到过波动率的算法（这是国内惟一一本介绍了波动率算法的书）。

它认为，波动率分上升趋势的波动率计算方法和下降趋势的波动率计算方法。

上升趋势的波动率计算方法是：在上升趋势中，底部与底部的距离除以底部与底部的相隔时间，取整。

下降趋势的波动率计算方法是：在下降趋势中，顶部与顶部的距离除以顶部与顶部的相隔时间，取整。

并用它们作为坐标刻度在纸上绘制。

上升波动率 = (第二个底部 - 第一个底部) / 两底部的时间距离
下降波动率 = (第二个顶部 - 第一个顶部) / 两顶部的时间距离 (南方财富网SOUTHMONEY.COM) (责任编辑 : 张晓轩)

七、如何在eviews中用garch计算股票波动率

参考文档

[下载：请问股票的波动率怎样计算.pdf](#)

[《主动退市的股票多久能重新上市》](#)

[《股票行情收盘后多久更新》](#)

[《股票停牌多久能恢复》](#)

[《混合性股票提现要多久到账》](#)

[下载：请问股票的波动率怎样计算.doc](#)

[更多关于《请问股票的波动率怎样计算》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/author/30028617.html>