

如何计算股票日波动率|请问波动率怎么算？-股识吧

一、什么是一年期股票收益率日波动率？公式？

展开全部一年期股票收益率=（年末收盘指数-上年末收盘指数）/上年末收盘指数

二、如何能看出k线的日波动率

我所知道的股票波动率是由江恩提出的，波动率是不能很简单的看出的而是要经过计算得出的。

波动率在江恩的书中并没有明确的给出算法。

现在市面上所有的算法都是后人根据他的作品自己研究发现的。

最简单的算法也就是市面上流传最广的就是两个低点之差除以两个低点之间的时间，还有一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。

这两种方法的共同缺点就是有时不太准。

我还自创了一套波动率算法，相对于以上两种比较要精确些但是算法烦琐,要把每一次波动的都算一遍然后在众多数据中找出一个适用的。

三、请问波动率怎么算？

波动率volability其实在经济学里面多指的是方差variance(σ^2) $x^2=31.575$ 平均值,
 $(x-x^{\wedge})^2/(n-1)=[(34-31.575)^2+(35-31.575)^2+(31.2-31.575)^2+(26.1-31.575)^2]/(4-1)$
 $=19.2709/3=6.42$

四、时间，空间波动率怎么计算

股票波动率：波动率是指标的资产回报率的变化程度，有实际波动率和历史波动率之分。

它是江恩理论的一个重要内容，在期货期权市场的指导意义较股票市场更大。

下面我们将对波动率的计算及交易策略进行详细讲解，希望对股民有一定的指导意义，赶紧跟着一起学习波动率的知识吧！一、波动率：概述波动率是指标的资产回报率的变化程度，有实际波动率和历史波动率之分。

它是江恩理论的一个重要内容，在期货期权市场的指导意义较股票市场更大。

（一）、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回报率波动程度的度量，由于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。

（二）、历史波动率历史波动率是指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是实际波动率的一个很好的近似。

二、波动率：计算江恩理论认为，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。

（一）、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。

上升波动率=（第二个底部-第一个底部）/两底部的时间距离

（二）、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。

下降波动率=（第二个顶部-第一个顶部）/两顶部的时间距离

三、波动率：交易策略对于者来说，期货市场上除了牛熊市之外，更多的时间处于一种无法辨别价格走势或者价格没有大幅变化的状况。

此时的交易策略可以根据市场波动率的大小具体细分。

当市场预期波动较小价格变化不大时，可采取卖出跨式组合和卖出宽跨式组合的策略。

当预期市场波动较大但对价格上涨和下跌的方向不能确定时，可采取买入跨式组合和买入宽跨式组合的策略。

卖出跨式组合由卖出一手某一执行价格的买权，同时卖出一手同一执行价格的卖权组成。

采用该策略的动机在于：认为市场走势波动不大，可以卖出期权赚取权利金收益。但是一旦市场价格发生较大波动，那就要面对遭受损失的风险。

“波动率”：波动率是江恩理论的一个重要内容，在期货期权市场的指导意义较股票市场更大。

经过上面对波动率计算方法和交易策略的学习，相信者对波动率有了一定的了解。此外者在运用波动率指标时还需结合均线和波浪理论来综合分析。

五、市场波动率怎么算

提问者采纳

波动率volability其实在经济学里面多指的是方差variance(\hat{x}^2) $\bar{x}^2=31.575$ 平均值,
 $(x-\hat{x})^2/(n-1)=[(34-31.575)^2+(35-31.575)^2+(31.2-31.575)^2+(26.1-31.575)^2]/(4-1)$
 $=19.2709/3=6.42$

六、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线的画法是以别以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。

七、如何通过一段时间的股票价格来计算该段时期的股价波动率。请给出公式及excel函数。

股价波动率通常是通过股价收益率的波动率来表示。

在Excel里的公式也一并如下写出。

股价收益率有两种方法，一种是不连续的， $R(t)=P(t)/P(t-1)-1$ ；

一种是连续的， $R(t)=\ln[P(t)/P(t-1)]$ 。

$P(t)$ 表示第 t 天的股价， \ln 表示自然对数。

由于要用到前一天的股价来计算今天的收益率，因此所计算出的收益率的数量 $n-1$ 比你所知道的股价的数量 n 要少1个。

计算完收益率 $R(1),R(2),\dots,R(n-1)$ 之后，开始计算波动率。

所谓波动率，就是标准差。

股价收益率的波动率= $STDEV()$ ，括号里请框选出 $n-1$ 个收益率。

这里计算出的是日波动率 v 。

如果要计算年波动率 V ，请用日波动率 v 乘以每年工作天数的根号。

比如一年有252个工作日，年波动率的公式 $V=v*\sqrt{252}$

参考文档

[下载：如何计算股票日波动率.pdf](#)

[《股票打折的大宗交易多久能卖》](#)

[《增发股票会跌多久》](#)

[《股票要多久才能学会》](#)

[《一只刚买的股票多久能卖》](#)

[《股票多久才能卖完》](#)

[下载：如何计算股票日波动率.doc](#)

[更多关于《如何计算股票日波动率》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/35692290.html>