

如何计算股票波动率市场波动率怎么算-股识吧

一、Eviews怎么计算股票波动率

garch模型有一个下拉选项的，两个方程只要会解读就没问题

二、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 $V=v*\sqrt{252}$

三、如何计算股票历史波动率 详细

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。

四、如何计算上证指数的波动率

不知道是不是指江恩角度线的波动率如果是，建议你放弃这个做法.我没有找到过相关的说明，江恩也没留下.用高点-低点除天数的方式,可以计算出简单的波段波动率,但意义不大.我研究了一年的江恩角度线,实盘跟踪，也许是水平有限，后来放弃了.对实盘帮助很小,可以做为辅助分析用.

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(σ^2) $\bar{x}^2=31.575$ 平均值, $(x-\bar{x})^2/(n-1)=[(34-31.575)^2+(35-31.575)^2+(31.2-31.575)^2+(26.1-31.575)^2]/(4-1)=19.2709/3=6.42$

六、股票的波动性是怎么计算出的

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不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。

七、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？

参考文档

[下载：如何计算股票波动率.pdf](#)

[《股票锁仓后时间是多久》](#)

[《买了股票持仓多久可以用》](#)

[下载：如何计算股票波动率.doc](#)

[更多关于《如何计算股票波动率》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/chapter/32816458.html>