

# 股票市场中如何求平均波动率度量股票市场的波动性有哪些常见方法-股识吧

## 一、请问股票的波动率怎样计算，详细步骤？

就是标准差，反映的是股票的每次波动幅度之间的关系  
这个在计算beta值的时候需要用到

## 二、如何计算股票年收益波动率

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？

## 三、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。

## 四、股票波动率

- 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。

## 五、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)

## 六、请问股票波动率如何计算

就是标准差，反映的是股票的每次波动幅度之间的关系  
这个在计算beta值的时候需要用到

## 七、excel中期权定价模型怎么求解股价波动率

简单的话就通过隐含波动率的曲面进行插值，如果想精确的话，是远比B-S顺推麻烦N倍，呵呵

## 八、度量股票市场的波动性有哪些常见方法

1.首先你要知道股票的数据是时间序列数据。

经研究表明，股票数据是有自相关性的，所以古典的回归模型拟合常常是无效的。

2.另外股票数据序列是具有平稳性，或一阶差分、高阶差分平稳性所以一般来说都会采用平稳性时间序列模型。

简单的如AR(p)，MA(q)，ARMA(p，q)模型等。

3.但由于这些数据往往还有条件异方差性。

进一步的模型修正有ARCH(p)，GARCH(p，q)等模型。

3中的模型是现今一些研究股票波动的主流手段的基础。

4.如果要研究多支股票波动的联合分布，可以用Copula理论进行建模(这个一般用于VaR，ES风险度量，比较前沿，国内90年代才开始引进，但并不算太难)5.另外还有一些非实证的手段，那是搞数学的弄的了

## 参考文档

[下载：股票市场中如何求平均波动率.pdf](#)

[《申请新股票要多久》](#)

[《股票交易系统延迟多久》](#)

[《股票首发涨停停牌多久复牌》](#)

[《股票日线周线月线时间多久》](#)

[下载：股票市场中如何求平均波动率.doc](#)

[更多关于《股票市场中如何求平均波动率》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/35735548.html>