

股票价格波动率怎么计算...如何计算股票历史波动率 详细 0 3-股识吧

一、请问股票波动率如何计算

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。

二、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

三、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

四、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。

五、请问证券市场股票价格每日都会波动，那么每日波动的股价是根据什么确定的，有计算公式么？

单纯的股价 = 票面价值x股息率/银行利率。

但你指的股价波动是2级市场上大家买卖股票票据的交易行为，波动也是因为大家对股票价格认可的一个表现，每个人心中认可的价值不同，也就产生了差价波动。

六、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。

七、样本股票的股权市值年波动率怎么算？ 做模型遇到这个数据表示不会啊、。。。。

任务占坑

八、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对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。

参考文档

[?????????????????.pdf](#)

[????????????????](#)

[????????????](#)

[????????????????](#)

[????????????????](#)

[????????????](#)

[?????????????????.doc](#)

[??](#)

??

<https://www.gupiaozhishiba.com/read/68656589.html>