

如何计算一只股票每日平均波动率请问波动率怎么算？ - 股识吧

一、怎么看股票的波动率？

冲天牛为您解答：股票价格波动率被定义为股票收益率（股票价格变动比例）的标准差，它反映了股票价格的“发散”程度。

从理论上讲，可转换公司债券的价格受可转换公司债券存续期间标的股票波动率的影响；

但是，事后的波动率事前并不能准确得知。

在实际操作过程中，除了用已知衍生证券的价格和其定价公式倒推“隐含波动率”（Implied Volatility）之外，一个常用的方法是用标的股票历史的波动率来替代将来衍生证券存续期标的股票的波动率。

具体计算年波动率的方法如下：假定： n ：连续观察的交易日数

S_i ：在第 i 个交易日末的股价 令： u_i ：其中： $i=1, 2, \dots, n$ 则的估计值为：其中：

u_i 的均值 N 为年交易天数 全球股票市场的波动率平均约20%左右，亚洲偏高在30%左右，由于我国证券市场是新兴市场，因此每年的股票波动率变化幅度较大，以上证综指为例，1992年股票波动率高达96%，1993年下降到60%，到2000年只有34%，波动幅度非常大，但总体下降趋势是明显的。

望采纳！！

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.com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、请问股票波动率如何计算

波动率的计算：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。

1、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
2、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
拓展资料：股市波动率的类型：1、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投资回报率波动程度的度量，由于投资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。

2、历史波动率
历史波动率是指投资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成为实际波动率的一个很好的近似。

3、预测波动率
预测波动率又称为预期波动率，它是指运用统计推断方法对实际波动率进行预测得到的结果，并将其用于期权定价模型，确定出期权的理论价值。

因此，预测波动率是人们对期权进行理论定价时实际使用的波动率。

这就是说，在讨论期权定价问题时所用的波动率一般均是指预测波动率。

需要说明的是，预测波动率并不等于历史波动率。

4、隐含波动率
隐含波动率是期权市场投资者在进行期权交易时对实际波动率的认知，而且这种认知已反映在期权的定价过程中。

从理论上讲，要获得隐含波动率的大小并不困难。

由于期权定价模型给出了期权价格与五个基本参数（ $S_t, X, r, T-t$ 和 σ ）之间的定量关系，只要将其中前4个基本参数及期权的实际市场价格作为已知量代入期权定价模型，就可以从中解出惟一的未知量 σ ，其大小就是隐含波动率。

因此，隐含波动率又可以理解为市场实际波动率的预期。

参考链接：百度百科：波动率指数

四、怎么看股票的波动率？

冲天牛为您解答：股票价格波动率被定义为股票收益率（股票价格变动比例）的标准差，它反映了股票价格的“发散”程度。

从理论上讲，可转换公司债券的价格受可转换公司债券存续期间标的股票波动率的影响；

但是，事后的波动率事前并不能准确得知。

在实际操作过程中，除了用已知衍生证券的价格和其定价公式倒推“隐含波动率”（Implied Volatility）之外，一个常用的方法是用标的股票历史的波动率来替代将来衍生证券存续期标的股票的波动率。

具体计算年波动率的方法如下：假定： n ：连续观察的交易日数

S_i ：在第 i 个交易日末的股价 令： x ：其中： $i=1, 2, \dots, n$ 则的估计值为： \bar{x} ：其中：

\bar{x} 为 u_i 的均值 N 为年交易天数 全球股票市场的波动率平均约20%左右，亚洲偏高在30%左右，由于我国证券市场是新兴市场，因此每年的股票波动率变化幅度较大，以上证综指为例，1992年股票波动率高达96%，1993年下降到60%，到2000年只有34%，波动幅度非常大，但总体下降趋势是明显的。

望采纳！！

五、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) $\bar{x}=31.575$ 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、如何快速计算一个股票1年内的日平均振幅？

该表提供根据股票日收益数据计算的历史波动率。

分别采用20日、60日简单移动法，指数加权移动平均法和Garch模型计算日波动率。

本表使用对数收益数据。

对数收益= $\log(1+\text{百分比收益})$ 。

（来源：道富投资）

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

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

参考文档

[下载：如何计算一只股票每日平均波动率.pdf](#)

[《股票理财资金追回需要多久》](#)

[《股票亏18%需要多久挽回》](#)

[《大冶特钢股票停牌一般多久》](#)

[《股票转账多久到账》](#)

[下载：如何计算一只股票每日平均波动率.doc](#)

[更多关于《如何计算一只股票每日平均波动率》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/store/3660473.html>