

# 股票波动率怎么计算的—eviews中如何用garch (1, 1) 计算股票波动率-股识吧

## 一、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。

## 二、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。

### 三、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

### 四、江恩股票波动率是怎么算的？举例说明

指标中roc就是算波动的其公式是ROC： $100 * (\text{CLOSE} - \text{REF}(\text{CLOSE}, N)) / \text{REF}(\text{CLOSE}, N)$ ；  
MAROC： $\text{MA}(\text{ROC}, M)$

### 五、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。

### 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、怎么通过波动率计算名义资金

股票波动率：波动率是指标的资产投资回报率的变化程度，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，赶紧跟着小编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投资回报率的变化程度，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。

（二）、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：交易策略对于投资者来说，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，相信投资者对波动率有了一定的了解。

此外投资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。

## 八、Eviews中如何用garch(1,1)计算股票波动率

打开Eviews然后点击Quick然后点击Equation Estimation，然后选择ARCH方法，然后估计就行了

### 参考文档

[下载：股票波动率怎么计算的.pdf](#)

[《股票一般多久买入卖出》](#)

[《股票要多久提现》](#)

[《基金多久更换一次股票》](#)

[《启动股票一般多久到账》](#)

[《农民买的股票多久可以转出》](#)

[下载：股票波动率怎么计算的.doc](#)

[更多关于《股票波动率怎么计算的》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/subject/22514674.html>