

股票波动率指标是多少股票月收益波动率及半年收益波动率-股识吧

一、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。

二、股票月收益波动率及半年收益波动率

你的计算周期是多少天就应该多少 ~ 波动率 = $STDEV(第一天复权收盘价 \dots \dots 第N天复权收盘价) \times SQRT(N)$ 而且你有个问题，你算得是收益率，那么你这样求出来的不是收益波动率啊 ~ ~ 1、从市场上获得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)，得到的应该就是你想要的。

没错就行，因为我也只是不确定 ~ ~

三、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： $\text{MA}(\text{ROC}, M)$

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、股票月收益波动率及半年收益波动率

波动率反映标的股价在过去一段时间的波动幅度，权证发行商与投资者在权证发行初期只能利用历史波动率作参考。

一般来说，权证的隐含波动率越高，其隐含的风险也就越大。

六、正常的隐含波动率是多少？

波动率反映标的股价在过去一段时间的波动幅度，权证发行商与投资者在权证发行初期只能利用历史波动率作参考。

一般来说，权证的隐含波动率越高，其隐含的风险也就越大。

七、股票术语：波动率 什么是实际波动率

实际波动率，度量波动率的方法，是指对期权有效期内投资回报率波动程度的度量，大体上可分为参数法和非参数法两类。

要明确实际波动率，首先要从波动率的概念入手。

波动率（Volatility）：是指关于资产未来价格不确定性的度量。

它通常用资产回报率的标准差来衡量。

也可以指某一证券的一年最高价减去最低价的值再除以最低价所得到的比率。

业内将波动率定义为价格比率自然对数的标准差。

波动率的种类有：实际波动率，隐含波动率，历史波动率等等，实际波动率便是波动率的一种。

波动率指数：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，因为前者是人们对实际波动率的理解和认识，当然，历史波动率往往是这种理论和认识的基础。

除此之外，人们对实际波动率的预测还可能来自经验判断等其他方面。

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，而且这种认识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。

期权定价模型需要的是在期权有效期内标的资产价格的实际波动率。

相对于当期时期而言，它是一个未知量，因此，需要用预测波动率代替之，一般可简单地以历史波动率估计作为预测波动率，但更好的方法是用定量分析与定性分析相结合的方法，以历史波动率作为初始预测值，根据定量资料和新得到的实际价格资料，不断调整修正，确定出波动率。

八、股价波动相关的财务指标主要是哪几个??

- 1、公司净利润，当净利润大幅提升，如果市场是熊市，股价会在短期内横向或者大幅攀升，比如最近的宇通客车，以前有包钢稀土、广晟有色、正海磁材、银河磁体、三爱富、很多水泥公司。
- 2、ROE净资产收益率，次数值高达20%以上的公司适合长期持有；54%的三一重工（十年涨幅30倍），33%的中联重科（十年涨幅15倍），30%的贵州茅台（8年涨幅40倍）等等。
- 3、市净率，多数股票跌至净资产的位置便很难再次下跌，如果加上盈利好转，整个经济便进入上扬牛市（比如1994年开始大幅上涨，2005年也是底部，还有2008年年底，现在创业板太高）

参考文档

[下载：股票波动率指标是多少.pdf](#)

[《股票被炒过要多久才能再炒》](#)

[《股票委托多久才买成功》](#)

[《联科科技股票中签后多久不能卖》](#)

[《公司上市多久后可以股票质押融资》](#)

[《股票赎回到银行卡多久》](#)

[下载：股票波动率指标是多少.doc](#)

[更多关于《股票波动率指标是多少》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/author/45172778.html>