

如何统计一只股票的波动率——如何计算股票历史波动率详细??-股识吧

一、如何用excel求一支股票每天的收益率？

b2中输入 $= (a2-a1)/a1$ ，下拉

二、excel里波动率的计算公式

- 1、首先在excel表格中输入增长率的数据，需要根据增长率计算出波动率。
- 2、然后点击“fx”插入函数，选择stdev函数，并在number1中选择单元格区域。
- 3、选中区域后可以在单元格内看到选中后的单元格区域。
- 4、点击回车即可看到已经生成了计算结果，选中数据单元格并点击“数字”选项卡中的“%”符号。
- 5、设置小数点后两位数据，即可生成百分数形式下的波动率计算结果。

三、EXCEL 通过本月数据波动怎么计算出下月数据？

1987的全球股灾后，为稳定股市与保护投资者，纽约证券交易所(NYSE)于1990年引进了断路器机制(Circuit-breakers)，当股价发生异常变动时，暂时停止交易，试图降低市场的波动性来恢复投资者的信心。

但断路器机制引进不久，对于如何衡量市场波动性市场产生了许多新的认识，渐渐产生了动态显示市场波动性的需求。

因此，在NYSE采用断路器来解决市场过度波动问题不久，芝加哥期权交易所从1993年开始编制市场波动率指数(Market Volatility Index, VIX)，以衡量市场的波动率。CBOE在1973年4月开始股票期权交易后，就一直有通过期权价格来构造波动率指数的设想，以反映市场对于的未来波动程度的预期。

其间有学者陆续提出各种计算方法，Whaley(1993)[1]

提出了编制市场波动率指数作为衡量未来股票市场价格波动程度的方法。

同年，CBOE开始编制VIX指数，选择S&P100指数期权的隐含波动率为编制基础，同时计算买权与卖权的隐含波动率，以考虑交易者使用买权或卖权的偏好。

VIX表达了期权投资者对未来股票市场波动性的预期，当指数越高时，显示投资者

预期未来股价指数的波动性越剧烈；

当VIX指数越低时，代表投资者认为未来的股价波动将趋于缓和。

由于该指数可反应投资者对未来股价波动的预期，并且可以观察期权参与者的心理表现，也被称为“投资者情绪指标”(The investor fear gauge)。

经过十多年的发展和完善，VIX指数逐渐得到市场认同，CBOE于2001年推出以NASDAQ 100指数为标的的波动性指标(NASDAQ Volatility Index, VXN)；

CBOE2003年以S&P500指数为标的的计算VIX指数，使指数更贴近市场实际。

2004年推出了第一个波动性期货(Volatility Index Futures) VIX Futures，

2004年推出第二个将波动性商品化的期货，即方差期货(Variance Futures)，标的为三个月期的S&P500指数的现实方差(Realized Variance)。

2006年，VIX指数的期权开始在芝加哥期权交易所开始交易计算波动率指数(VIX)需要的核心数据是隐含波动率，隐含波动率由期权市场上最新的交易价格算出，可以反映市场投资者对于未来行情的预期。

其概念类似于债券的到期收益率(Yield To Maturity)：随着市场价格变动，利用适当的利率将债券的本金和票息贴现，当债券现值等于市场价格时的贴现率即为债券的到期收益率，也就是债券的隐含报酬率。

在计算过程中利用债券评价模型，通过使用市场价格可反推出到期收益率，这一收益率即为隐含的到期收益率。

四、如何计算股票历史波动率 详细??

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。

五、什么是期权波动率，如何计算？

隐含波动率是制期权市场投资者在进行期权交易时对实际波动率的认识，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。

扩展资料：影响：标的资产的波动率是布莱克-

斯科尔斯期权定价公式中一项重要因素。

在计算期权的理论价格时，通常采用标的资产的历史波动率：波动率越大，期权的理论价格越高；

反之波动率越小，期权的理论价格越低。

波动率对期权价格的正向影响。

可以理解为：对于期权的买方，由于买入期权付出的成本已经确定，标的资产的波动率越大，标的资产价格偏离执行价格的可能性就越大，可能获得的收益就越大，因而买方愿意付出更多的权利金购买期权；

对于期权的卖方。

由于标的资产的波动率越大，其承担的价格风险就越大，因此需要收取更高的权利金。

相反，标的资产波动率越小，期权的买方可能获得的收益就越小，期权的卖方承担的风险越小，因此期权的价格越低。

 ;

参考资料来源：股票百科-波动率

六、如何更准确判断一只股票的走势

三分钟后的股市行情，连巴菲特也不知道。

但是他依然是股神。

中国股市能获利的办法，就我所知就只有追随上涨行情一个办法。

形成上涨趋势后，这个上涨趋势随时会终止，但是没终止前，这个趋势都会一直持续下去。

在上涨趋势时买入，在上涨趋势结束后卖出。

这就是道氏理论。

从均线，成交量，股价所处的位置，综合来判断。

股价回调，在趋势线，重要均线，重要顶底部，会得到一定的支撑。

结合成交量，指标来综合判断。

但是也没办法一定确定肯定会在这个位置得到支撑。

所以要提前做好止损的准备。

当支撑不能起支撑作用时，就止损。

比方说趋势线的支撑是在10元，前面一部顶部是15元，现在的股价是11元。

那么你现在买入做的判断是上涨空间是到15元，下跌空间到10元，是用1元的亏损博取4元的利润。

你觉得股市上涨的概率和下跌的概率就市况来看是一样的话，那么这种买入就是有胜算的。

用1元的亏损博取4元的利润。

在实际操作中，要根据市场的走势来综合判断。

七、股票涨跌的值是怎么计算出来的

当前市值 / 昨日收盘价 - 1 = n % n% 就是涨跌的值，如果为负数就是跌了，如果为正数就是涨了当天的涨跌幅就是把当前市值换成当日的收盘价计算这个应该不复杂吧，公式是我自己推的，大概就是这个意思

八、统计：股票平均收益率的计算

股票收益率 = 收益额 / 原始投资额

其中：收益额 = 收回投资额 + 全部股利 - (原始投资额 + 全部佣金 + 税款)

三年的平均收益率 = 股票收益率 / 3

参考文档

[下载：如何统计一只股票的波动率.pdf](#)

[《新股票一般多久可以买》](#)

[《股票亏钱多久能结束》](#)

[《股票成交量多久一次》](#)

[下载：如何统计一只股票的波动率.doc](#)

[更多关于《如何统计一只股票的波动率》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/book/34309027.html>