

股票价值日波动率如何计算如何计算股票历史波动率 详细-股识吧

一、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*(CLOSE-REF(CLOSE，N))/REF(CLOSE，N)；
MAROC：MA(ROC，M)

二、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。

三、什么是一年期股票收益率日波动率？公式？

展开全部一年期股票收益率=(年末收盘指数-上年末收盘指数)/上年末收盘指数

四、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不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、股票日波动率的标准差怎么算？急！急！急！！！！

具体看你用什么方式来算，我接触到用garch的多。此外，那个不是乘以根号52，是乘以根号一年的交易日数。

参考文档

[下载：股票价值日波动率如何计算.pdf](#)

[《股票填权后一般多久买》](#)

[《德新交运股票停牌多久复牌》](#)

[下载：股票价值日波动率如何计算.doc](#)

[更多关于《股票价值日波动率如何计算》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/chapter/33506625.html>