

Волатильность (Volatility)

Синонимы: Изменчивость, Неустойчивость

Волатильность — статистический показатель, характеризующий изменчивость различных величин во времени. Наиболее часто используется в экономике и финансах для описания колебания стоимости финансовых активов.

Чем выше волатильность финансового инструмента, тем менее предсказуемо его поведение и тем рискованнее операции с ним. Поэтому волатильность можно рассматривать как среднюю меру риска, связанного с использованием данного инструмента.

С точки зрения анализа данных, например, прогнозирования стоимости акций, курсов валют и т.д., высокая волатильность, характерная для периодов кризиса, спадов и подъемов экономики, существенно затрудняет использование прогностических моделей и снижает точность прогноза.