

# 期权股票波动率如何计算 - 股票的波动性是按什么指标算的-股识吧

## 一、可转换债券的隐含波动率的计算公式？

最头期=-1，过去历史总和=0，想知道总第几到多少期指数，依坐标对应各股的开盘，反算回来。

就OK。

KCB，KYMDH9.18：20.12.1

## 二、股票中收益波动率是什么意思,怎么计算

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。

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。

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。

波动率计算方法1、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。

2、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。

扩展资料：股票收益率是反映股票收益水平的指标1、是反映投资者以现行价格购买股票的预期收益水平。

它是年现金股利与现行市价之比率。

本期股利收益率=(年现金股利/本期股票价格)\*100%。

2、股票投资者持有股票的时间有长有短，股票在持有期间获得的收益率为持有期收益率。

持有期收益率=[(出售价格-购买价格)/持有年限+现金股利]/购买价格\*100%。

3、公司进行拆股必然导致股份增加和股价下降，正是由于拆股后股票价格要进行调整，因而拆股后的持有期收益率也随之发生变化。

拆股后持有期收益率=(调整后的资本所得/持有期限+调整后的现金股利)/调整后的购买价格\*100%。

参考资料来源:搜狗百科-波动率

### 三、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

### 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、估算未来期权的隐含波动率有哪些方法

对波动率的预测，可以分为以下几个方面去写：1. 对波动率进行点估计。

对波动率的点估计大概有EWMA，GARCH等方法。

但是个人感觉，如果是做波动率交易的话，并没有什么卵用。

(就像预测标的价格一样.....) 2. 估计波动率的分布。

对于波动率交易来说，由于波动率有集聚效应，所以，相比起对波动率做点估计，对波动率的分布做估计可能会更加有用。

对于波动率分布的估计，通常有波动率锥、波动率曲面。

3. VIX其实VIX本身就是一个对隐含波动率的预期，因此可以作为一个参考。

4. 实际要注意的问题 如果是做跨式的话，合约的选择会是一个比较麻烦的问题

，选期限太短的，波动率不一定能上去；  
选期限太长的，会有流动性问题。

实际上做跨式的时候，你的delta并不是neutral的，因此需要做delta hedge。

不知道题主做的是什么品种，如果是50ETF的话，还要考虑期末，期权合约流动性丧失的非常快，有可能无法兑现利润。

5. 最后所有能赚钱的方法，几乎都是基于主观判断（投机）的。

赌波动率涨跌，和赌标的资产涨跌，其实一样。

最后，建议看一下Euan Sinclair的《Volatility Trading》，里面对波动率交易写得很详细了。

望采纳，谢谢！

## 六、请问股票的波动率怎样计算，详细步骤？

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。

## 七、请问股票波动率如何计算

波动率的计算：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。

1、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2、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）/两顶部的时间距离拓展资料：股市波动

率的类型：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是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。
- 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 $\sigma$ ）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 $\sigma$ ，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。
- 参考链接：百度百科：波动率指数

## 参考文档

[下载：期权股票波动率如何计算.pdf](#)  
[《入职体检后多久可以拿到股票》](#)  
[《股票亏18%需要多久挽回》](#)  
[《上市公司回购股票多久卖出》](#)  
[下载：期权股票波动率如何计算.doc](#)  
[更多关于《期权股票波动率如何计算》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/article/41668447.html>