

股票的波动率怎么分.股票的波动性是按什么指标算的-股识吧

一、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。

二、股票价格基本按照几何布朗运动，但如何确定它的波动率呢？

想计算波动率，先要计算收益率。
我悄悄告诉你，我是从云掌财经获得的答案

三、时间，空间波动率怎么计算

股票波动率：波动率是指标的资产回报率的变化程度，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回报率波动程度的度量，由于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，相信者对波动率有了一定的了解。

此外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。

四、什么是波动率指数

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&P 500 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&P 500 指数为标的计算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&P 500 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。

五、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)

参考文档

[下载：股票的波动率怎么分.pdf](#)

[《买了股票持仓多久可以用》](#)

[《股票多久能买能卖》](#)

[《股票大盘闭仓一次多久时间》](#)

[下载：股票的波动率怎么分.doc](#)

[更多关于《股票的波动率怎么分》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/22318839.html>