

股票波动率一般是多少~江恩股票波动率是怎么算的？举例说明-股识吧

一、请问股票的波动率怎样计算，详细步骤？

我所知道的股票波动率是出自江恩理论。

由于江恩本人并没有对波动率进行过详细的描述所以现在市面上所有有关波动率的算法全是后人根据他的理念推断的。

我现在所知道的算法有三种。

第一就是两个高点（低点）的差除以两个高点（低点）之间的时间。

比如说两个高点分别为15和10，时间是10个交易日那么 $15-10=5$ ， $5/10=0.5$ ，0.5就是波动率。

第二种方法也很简单就是你自己去推断波动率，比如上证指数，你可以用10 20 40 80 160这种点数去挨个的套，股票一般用，0.1 0.2 0.4 0.8 或0.05 0.1 0.2 0.4等等看看哪个在历史上最适用。

支持这一算法的是因为江恩在他写的商品期货教程中曾经提到过5月咖啡的1*1线的画法是以别以1点、12点、30点对应一天为波动率，画1*1线的，但书中却没写为什么用这3个数。

根据我所掌握的江恩理论知识这很有可能是分别用到了太阳，木星和土星的周期。太阳，木星，土星的周期分别是1年，12年，30年。

第三种就是股票的最小波动单位，比如咱们股票的最小波动单位为0.01元。

支持这一算法是因为在江恩那个年代没有计算机，股票绘图只能是人力手工作业。江恩只用一种8*8的坐标纸，这纸上的1*1线永远是45°，而1/8美分是当时商品的最小波动单位。

二、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 ，VIX)；

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。

三、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 : $100 * (\text{CLOSE} - \text{REF}(\text{CLOSE}, N)) / \text{REF}(\text{CLOSE}, N)$;

MAROC : $\text{MA}(\text{ROC}, M)$

四、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

五、2022年上证综指波动率是多少

收盘都在说的3320点之上，也在5周均线之上，认为是正常的振荡。
目前在前高初，下周有望出现短期方向，向上有望挑战3450点左右，向下有望挑战3250点左右。
周五虽然回落，还是正常的振荡，没有明显调整的迹象，因此，认为向上的概率大。

参考文档

- [下载：股票波动率一般是多少.pdf](#)
- [《当股票出现仙人指路后多久会拉升》](#)
- [《混合性股票提现要多久到账》](#)
- [《农业银行股票一般持有多久分红》](#)
- [《股票赎回到银行卡多久》](#)
- [下载：股票波动率一般是多少.doc](#)
- [更多关于《股票波动率一般是多少》的文档...](#)

??
<https://www.gupiaozhishiba.com/read/43322059.html>