

股票波动率通常是多少~股票术语：波动率 什么是实际波动率-股识吧

一、股票术语：波动率 什么是实际波动率

实际波动率，度量波动率的方法，是指对期权有效期内投资回报率波动程度的度量，大体上可分为参数法和非参数法两类。

要明确实际波动率，首先要从波动率的概念入手。

波动率（Volatility）：是指关于资产未来价格不确定性的度量。

它通常用资产回报率的标准差来衡量。

也可以指某一证券的一年最高价减去最低价的值再除以最低价所得到的比率。

业内将波动率定义为价格比率自然对数的标准差。

波动率的种类有：实际波动率，隐含波动率，历史波动率等等，实际波动率便是波动率的一种。

波动率指数：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成为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，因为前者是人们对实际波动率的理解和认识，当然，历史波动率往往是这种理论和认识的基础。

除此之外，人们对实际波动率的预测还可能来自经验判断等其他方面。

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，而且这种认知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 σ ）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，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。期权定价模型需要的是在期权有效期内标的资产价格的实际波动率。相对于当期时期而言，它是一个未知量，因此，需要用预测波动率代替之，一般可简单地以历史波动率估计作为预测波动率，但更好的方法是用定量分析与定性分析相结合的方法，以历史波动率作为初始预测值，根据定量资料和新得到的实际价格资料，不断调整修正，确定出波动率。

二、波动率的波动时间

许多初学者认为，接近到期日，时间价值耗损速度加快，所以应该在接近到期日的时后。

去放空选择权。

- - 这种观念是错误的。

市场的时间流逝，对于买卖双方是平等的。

您没有办法从时间流逝中讨到任何便宜的。

因为，您在接近到期日放空选择权，虽然时间价值流逝的速度加快，但是，相对地，您放空选择权所收取的权利金降低，两相抵销，您是讨不到半点便宜的。

但是，波动率的偏高或偏低，确实会对买卖双方造成不平等的差别待遇。

也因此，操作选择权的两个重点，就是趋势和波动率。

如果您能够两者皆掌握得宜，则您可以赚很多钱。

如果您只能够掌握其中一个重点，则您最好是对另一个重点作避险的动作。

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、正常的隐含波动率是多少？

波动率反映标的股价在过去一段时间的波动幅度，权证发行商与投资者在权证发行初期只能利用历史波动率作参考。

一般来说，权证的隐含波动率越高，其隐含的风险也就越大。

五、股票波动率

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： $\text{MA}(\text{ROC}, M)$

六、什么是股指波动率

涨跌幅度的大小

七、股票波动率

1.从finance.yahoo*上面找到你要的公司的股票资料，将其每天的历史价格下载下来，然后选用Adjusted Close Price；

2.把它们复制到Excel Spreadsheet里，然后用STDEV计算标准差，就OK了。

八、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。

参考文档

[下载：股票波动率通常是多少.pdf](#)

[《科创板交易方式跟主板有什么不同》](#)

[《工业股是什么意思》](#)

[《基金低吸加仓怎么加科学》](#)

[下载：股票波动率通常是多少.doc](#)

[更多关于《股票波动率通常是多少》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/store/39223355.html>