

股票波动率看哪个时间段--什么是江恩波动率-股识吧

一、如何计算股票历史波动率 详细

以计算股票的历史波动率为例加以说明。

- 1、从市场上获得标的股票在固定时间间隔(如每天、每周或每月等)上的价格。
- 2、对于每个时间段，求出该时间段末的股价与该时段初的股价之比的自然对数。
- 3、求出这些对数值的标准差，再乘以一年中包含的时段数量的平方根(如，选取时间间隔为每天，则若扣除闭市，每年中有 250 个交易日，应乘以根号250)，得到的即为历史波动率。

历史波动率是基于过去的统计分析得出的，假定未来是过去的延伸，利用历史方法估计波动率类似于估计标的资产收益系列的标准差。

在股票市场中，历史波动率反映标的股价过去的波动。

然而，由于股价波动难以预测，利用历史波动率对权证价格进行预测一般都不能保证准确，但是由于目前我国内地没有权证市场，因而无法获得权证价格，也就无法计算隐含波动率。

因此权证发行商不投资者在权证发行初期只能利用历史波动率作参考。

二、股票月收益波动率及半年收益波动率

你的计算周期是多少天就应该多少 ~ 波动率 = $STDEV(第一天复权收盘价.....第N天复权收盘价) \times SQRT(N)$ 而且你有个问题，你算得是收益率，那么你这样求出来的不是收益波动率啊 ~ ~ 1、从市场上获得股票在固定时间间隔(如每天、每周或每月等)上的价格。

- 2、对于每个时间段，求出该时间段末的股价与该时段初的股价之比的自然对数。
- 3、求出这些对数值的标准差，再乘以一年中包含的时段数量的平方根(如，选取时间间隔为每天，则若扣除闭市，每年中有250个交易日，应乘以根号250)，得到的应该就是你想要的。

没错就行，因为我也只是不确定 ~ ~

三、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就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，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 σ ，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。

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、什么是江恩波动率

你好，江恩波动率在其写的书中并没有明确的写明具体算法，现在市面上所有的算法都是后人根据他的作品自己研究发现的。

最简单的算法也就是市面上流传最广的就是两个低点之差除以两个低点之间的时间，还有一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。

这两种方法的共同缺点就是有时不太准。

我还自创了一套波动率算法，相对于以上两种比较要精确些但是算法烦琐，要把每一次波动的都算一遍然后在众多数据中找出一个适用的。

六、股票中日内波动率是什么意思

股票日内波动率是指某一股票，在两个交易日内围绕某一价位反复产生三次左右的涨跌，且涨跌幅度都超过该平均价位5%，我们业内称为正负浮动5%的，就叫做股票日波动率。

不能光看股票日波动率，因为产生这种情况的原因很多，主要体现在换手率高，交易日内成交量明显放大。

如果要分析原因的话要结合大盘和个股的状况，一般说来逃不脱两个状况：一是庄家高位出货需要，利用股票短期波动率放大制造上涨假象骗散户接盘；另一种是拉抬过程中要洗掉获利盘，把股票短期波动率做到最大可以有效恐吓获利盘出逃离场。

低位吸货不会用这种手段，因为很容易引起别人的关注。

不知道你的股票属于哪种情况？另外提醒你，现在大盘处于下行区域，做空动能

巨大，如果你的股票处于高位，你又发现这种状况出现，那建议你逢高减仓，反正是要警惕了。

七、一周五天，都什么时间有行情波动呢？

股市的行情从开盘到收盘都有波动的，我们可以参与的具体时间是9：30-11：30，1：00-3：00如果你想总结出来哪些时间段波动会大一些，我只能说，这个是真无法总结，建议随时关注盘面，或者请多学习，你研究的越深，你要花的时间就越少了

八、计算股价波动率时出现的问题

展开全部各数据偏离平均数的距离（离均差）的平均数，它是离差平方和平均后的方根。

用 σ 表示。

因此，标准差也是一种平均数标准差是方差的算术平方根。

标准差能反映一个数据集的离散程度。

平均数相同的，标准差未必相同有时候两个相临间隔的股价之比的自然对数是负值，这并不影响标准差的求取。

九、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。

参考文档

[下载：股票波动率看哪个时间段.pdf](#)

[《股票上市一般多久解禁》](#)

[《中泰齐富股票卖了多久可以提现》](#)

[《股票订单多久能成交》](#)

[《股票转账多久到账》](#)

[下载：股票波动率看哪个时间段.doc](#)

[更多关于《股票波动率看哪个时间段》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/subject/19511750.html>