

什么是波动率股票-开放式基金里面最大回撤，夏普比率，波动率是指什么？-股识吧

一、开放式基金里面最大回撤，夏普比率，波动率是指什么？

最大回撤，就是最高点 to 最低点的相差数据，回撤大说明风险也大。
夏普比率，每承担一份风险，要有超额收益做为补偿，夏普比率越大越好波动率，基金所买的股票上上下下，会有浮动，波动率越大风险也越大。

二、权证中的隐含波动率是什么意思？

何为权证“隐含波动率” 隐含波动率是将市场上的权证交易价格代入权证理论价格模型，反推出来的波动率数值。

以昨天上市的万科认沽权证（038002）为例，G万科昨收盘价是3.78元，万科认沽权证的价格为0.87元，行权价为3.73元，存续期为9个月（0.75年），无风险收益率取值一年期活期存款利率（税后）1.8%，将以上参数带入Black-

Scholes模型就可以反推出其隐含波动率为72.6%，是其历史波动率的两倍左右。
据德邦证券金融工程师吴谦介绍，历史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。

权证投资者除了可以利用权证的正股价格变化方向来买卖权证外，还可以从股价的波动幅度的变化中获利。

一般来说，波动率并不是可以无限上涨或下跌，而是在一个区间内来回震荡，投资者可以采取在隐含波动率较低时买入而在较高时卖出权证的方法来获利。

三、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

。

四、股票短期波动率最高什么意思？意味什么？

股票短期波动率是指某一股票，在十个交易日（即两个交易周）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，就叫做股票短期波动率。

不能光看股票短期波动率，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。

五、什么是一年期股票收益率日波动率？公式？

展开全部一年期股票收益率=（年末收盘指数-上年末收盘指数）/上年末收盘指数

六、股票的波动性是怎么计算出的

运用谷峰值计算法

七、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。

八、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。

参考文档

[下载：什么是波动率股票.pdf](#)

[《同只股票卖出多久后可以再次买入》](#)

[《股票st以后需要多久恢复》](#)

[《今天买的股票多久才能卖》](#)

[下载：什么是波动率股票.doc](#)

[更多关于《什么是波动率股票》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/13005205.html>