

什么是VIX恐慌指数？

1. 定义：VIX是由CBOE（芝加哥选择权交易所）在1993年所推出，是指数选择权隐含波动率加权平均后所得之指数。

2. 计算方式：起初是选取S&P100指数选择权的近月份与次月份最接近价平的买权及卖权共八个序列，分别计算其隐含波动率之后再加权平均所得出的指数，后来该指数在2003年修正将选取目标从S&P100改为S&P500并将最接近价平的买权及卖权的序列改为所有序列，以透过更广泛的目标物基础提供市场参与者一个更能够反映大盘整体走势的指标。

什么是VIX恐慌指数？什么是VIX恐慌指数？

我查阅的资料如下，希望对您有所帮助：1. 定义：VIX是由CBOE（芝加哥选择权交易所）在1993年所推出，是指数选择权隐含波动率加权平均后所得之指数。

2. 计算方式：起初是选取S&P100指数选择权的近月份与次月份最接近价平的买权及卖权共八个序列，分别计算其隐含波动率之后再加权平均所得出的指数，后来该指数在2003年修正将选取目标从S&P100改为S&P500并将最接近价平的买权及卖权的序列改为所有序列，以透过更广泛的目标物基础提供市场参与者一个更能够反映大盘整体走势的指标。