

Volatility Index Comparison

Questo tool permette di comparare il grafico storico di due titoli la cui rappresentazione grafico viene percentualizzata sull'asse X di sinistra per favorirne la visualizzazione. Per entrambi i titoli viene anche visualizzato il corrispondente Volatility Index. Questo permette un'approfondita e completa analisi dei movimenti dei titoli scelti.

Vengono quindi mostrati quattro grafici, ognuno può essere selezionato/deselezionato cliccando sul nome in alto.



L'indice di volatilità così come lo costruiscono nel mondo intero, ti dice quando la volatilità sale o scende perchè è costruito facendo varie somme mediate di varie scadenze. Insomma, ti dice a che numero è la volatilità.

Ottimo si potrebbe dire!

Ma a che cosa serve all'atto pratico? Come faccio a sfruttare quella indicazione per guadagnare? Io non lo so!

Ed ecco che PlayOptions.it ha costruito un indice di volatilità che indichi se la vola mi prezza una salita o una discesa!

Questo è più interessante...infatti se si posiziona il crosshair ad esempio al 10/11/2015, l'indice indica una probabile discesa del sottostante...che si è poi verificata.

Il Volatility Index di Iceberg serve per sapere se siamo in una prezzatura di vola, per individuare il trend, se sotto lo zero il trend è di salita se sopra è di discesa. Il nostro indice è chiaramente una interpolazione delle implicite, che però non rappresenta necessariamente solo il valore puro medio ponderato della vola implicita e' una cosa diversa dal VIX o dai VDAX o VSTOXX, il nostro ci da la prezzatura dei MM rispetto al trend.

Quindi il suo comportamento non è lineare con l'innalzamento o meno delle implicite, ma è pesato. Ed ecco che in una discesa della volatilità l'indice si potrebbe alzare semplicemente perchè la prezzatura

delle vola sta diminuendo la convinzione di un trend in salita. Alzandosi potrebbe portarsi nell'area sopra lo zero decretando la fine del trend in atto.

Il valore espresso degli indici classici lo posso ricavare semplicemente facendo la media della implicita delle tre opzioni "circa" ATM misurata sulla scadenza a tre mesi.

Se il sottostante batte 103 e gli strike hanno passo 5 allora prendo l'implicita dei seguenti 3 strike: 100, 105, 110 Se il sottostante batte 102 e gli strike hanno sempre passo 5 allora prendo l'implicita dei seguenti 3 strike: 95, 100, 105

Il Volatility Index di Iceberg è unico ed è uno dei due algoritmi per cui è stata presentata domanda di brevetto.

Video Tutorial



[Clicca qui per vedere altri Video di Iceberg](#)

Il menù

Symbols		Chart
Symbol 1	- Click to Select -	TimeFrame <input type="button" value="Daily"/>
Symbol 2	- Click to Select -	Bars Count <input type="button" value="500"/>
Symbol 1	cliccando su "Click to Select" è possibile selezionare il primo titolo da comparare	
Symbol 2	cliccando su "Click to Select" è possibile selezionare il secondo titolo da comparare	
TimeFrame	permette di scegliere il timeframe delle barre da visualizzare sul grafico	
Bars Count	permette di scegliere il numero di barre da visualizzare sul grafico	

From:

http://manuals.playoptions.it/Iceberg_old/ - **Iceberg Options Solutions**

Permanent link:

http://manuals.playoptions.it/Iceberg_old/it/volatility_index_comparison?rev=1468332785

Last update: **2016/08/29 11:57**