



Intraday Volatility Forecast

Volatilitätsvorhersagen für DAX[®], EURO STOXX 50[®] und Euro-Bund Futures

Der Intraday Volatility Forecast liefert Volatilitätsvorhersagen für DAX, EURO STOXX 50 und Euro-Bund Futures. Die Prognosen werden anhand der Handelsdaten der wichtigsten an der Eurex Exchange gehandelten Futures berechnet. Die Kennzahlen unterstützen Händler und andere Marktteilnehmer dabei, die Wahrscheinlichkeit von Preisänderungen und das Risiko bestimmter automatisierter Handelsstrategien einzuschätzen beziehungsweise einen guten Handelszeitpunkt zu identifizieren.

Dateninhalt

Die folgenden Kennzahlen werden zur Verfügung gestellt:

- Durchschnittliche realisierte Volatilität: eine Referenz für die letzte Sekunde wird jede Sekunde gesendet
- 10-Sekunden-Prognose: wird alle fünf Sekunden für die nächsten drei 10-Sekunden-Intervalle veröffentlicht
- 1-Minuten-Prognose: wird alle 30 Sekunden für die nächsten fünf 1-Minuten-Intervalle veröffentlicht
- 10-Minuten-Prognose: wird alle fünf Minuten für die drei folgenden 10-Minuten-Intervalle veröffentlicht

Berechnung

Der Intraday Volatility Forecast basiert auf einem proprietären mathematischen Modell, das historische Futures-Daten verwendet, um die Richtung (zunehmend oder abnehmend) und Höhe der Volatilität vorherzusagen. Die folgenden drei Komponenten gehen in die Berechnung ein:

- Kurzzeithistorie der realisierten Volatilität
- Historische Intraday-Saisonalität

- Planmäßige Veröffentlichungen makroökonomischer Daten

Die Komponente Kurzzeithistorie trägt der Tatsache Rechnung, dass der zukünftige Wert der Volatilität stark von seinem vorherigen Wert abhängt. Die zweite Komponente des Modells basiert auf einer Analyse der historischen Intraday-Saisonalität der Volatilität. Das Modell berücksichtigt automatisch Feiertage, weitere Kalendereffekte sowie tagesrelevante Effekte wie Beginn und Ende von Marktauktionen. Die letzte Modellkomponente bewertet dynamisch die durchschnittlichen Auswirkungen von planmäßigen Veröffentlichungen makroökonomischer Daten. Veröffentlichungen mit signifikanten Auswirkungen auf die Volatilität (z. B. US-Beschäftigungs- oder BIP-Zahlen) fließen in die Berechnung der Volatilitätsprognose ein.

Datenbezug

Die Übermittlung der Daten erfolgt über (a) den Eurex MIC (Multi-Interface-Channel), (b) die 10 GB Eurex Marktdatenverbindung und (c) die Deutsche Börse Datenfeeds CEF[®] Core und CEF ultra+ Eurex.

Technische Informationen

Die benötigte Bandbreite für dieses Informationsprodukt beträgt ~ 128 kbps.

Kontakt

Market Data + Services/Information
+49-(0)69-2 11-1 24 42 (Frankfurt)
mds.frontoffice@deutsche-boerse.com
www.mds.deutsche-boerse.com