

Spiegazione Open Interest Storico:



Ogni volta che viene scaricata la chain delle opzioni, tutti i dati ottenuti vengono memorizzati anche nel database storico, che comprende quindi sia i valori degli Open Interest, che dei prezzi, delle greche, della volatilità. Ad ognuno di questi valori, è assegnata anche una "etichetta" con la data e l'ora in cui sono stati scaricati. In pratica, ogni "etichetta" racchiude l'intera chain delle opzioni e tutti i valori calcolati su di essa nel momento in cui è stata scaricata.

Le "etichette" vengono usate dal software come un indice di un libro: ad ogni etichetta corrisponde una serie di valori, così come ad ogni voce di un indice di un libro, corrisponde una serie di pagine. Le etichette sono sempre mantenute ordinate, dalla più piccola (data più vecchia nel tempo) alla più grande (data più nuova nel tempo).

Quando si usa la modalità Storico per Strike o Storico per Scadenza dell'Open Interest, il software va a leggere i dati contenuti nell'archivio storico, e calcola la differenza tra due serie di dati in questo archivio. Sostanzialmente, il software prende due delle "etichette" di cui ho scritto più sopra, e controlla dove ci sono state variazioni nei valori. La variazione dei valori deve per forza di cose essere calcolata, matematicamente, come una differenza, perciò si può dire che il software esegue i calcoli applicando, per ogni valore accoppiato ad ogni etichetta, questa formula:

$$R - A = D$$

Dove R sono i dati la cui etichetta è la data di riferimento (scritta così nel software)

A sono i dati la cui etichetta è la data attuale (scritta così nel software)

D è la differenza tra i valori associati alle due etichette (valore visualizzato nel grafico)

Con questo sistema, è possibile analizzare cosa è successo da un giorno al successivo, ma anche da un giorno al precedente. Infatti se $R > A$, allora sto guardando quello che è successo il giorno precedente, mentre se $R < A$, allora sto guardando quello che è successo il giorno successivo. Precedente e successivo sono sempre ed esclusivamente riferiti alla data di riferimento, così com'è scritta nella finestra del software.

A questo punto, bisogna solo sapere come scegliere le due etichette di riferimento ed attuale per poter scegliere quindi quali dati visualizzare.

Per fare questo, bisogna servirsi dei pulsanti sotto i grafici.

Nell'immagine allegata, per comodità, ho messo dei numeri per identificare i pulsanti e la loro funzione.

1. Inizio - Serve per spostare l'etichetta data attuale ai dati più vecchi disponibili presenti nel database storico
2. Indietro - Serve per spostare l'etichetta data attuale ai dati immediatamente precedenti a quelli attualmente selezionati come attuali, prelevandoli dal database storico
3. Play Indietro - Serve per spostare l'etichetta data attuale di una posizione più indietro (più vecchia) alla volta, dalla posizione attuale alla più vecchia disponibile nel database storico, cambiando automaticamente etichetta ogni mezzo secondo. In pratica va a ritroso nel tempo.
4. Stop - Serve per fermare le funzioni automatiche di Play Indietro o Play Avanti
5. Play Avanti - Serve per spostare l'etichetta data attuale di una posizione più avanti (più nuova) alla volta, dalla posizione attuale alla più nuova

disponibile nel database storico, cambiando automaticamente etichetta ogni mezzo secondo. In pratica va avanti nel tempo.

6. Avanti - Serve per spostare l'etichetta data attuale ai dati immediatamente successivi a quelli attualmente selezionati come attuali, prelevandoli dal database storico

7. Fine - Serve per spostare l'etichetta data attuale ai dati più nuovi disponibili presenti nel database storico

Tutti questi pulsanti muovono esclusivamente l'etichetta attuale (data attuale nel software), ma non muovono l'etichetta di riferimento. Come si fa a muoverla? Bisogna fare in modo di spostare l'etichetta attuale al punto che si vuole usare come riferimento, e quindi cliccare sul pulsante 8, Usa come riferimento.

Quando si clicca sul pulsante 8 il grafico inferiore sarà completamente a 0. Questo perchè l'etichetta della data di riferimento è stata spostata nella stessa posizione dell'etichetta della data attuale, e quindi quando viene applicata la formula per calcolare la differenza tra le due, essendo queste le stesse, il risultato sarà sempre 0. Quindi, dopo aver cliccato sul pulsante 8, dovrò spostare l'etichetta data attuale in un'altra posizione per vedere la differenza con il nuovo riferimento.

L'ultimo pulsante, il numero 9, serve per eliminare i dati storici dal database storico. Ad esempio potrebbe non interessarmi quello che è successo nel dicembre 2009, ed allora usando questo pulsante posso togliere tutti i dati la cui etichetta è dicembre 2009.