

Indicateur de volatilité VI (Volatility-Index)

Principe :

L'idée de cet indicateur de repérer les assets en phase de forte compression. Pour ce faire :

- On cherche sur une partie de l'historique de l'actif, l'écart-type du maximal prix
- On divise la valeur obtenue par l'écart type actuel



Cette valeur permet de construire un oscillateur entre 0 et 1. Lorsqu'elle est proche de 0, l'actif est en phase de compression et la recherche d'un setup peut-être pertinente (à l'achat comme à la vente). Lorsqu'elle est proche de 1, il est en phase de distribution et ce n'est plus le moment d'entrer en position sur cette unité de temps.

Une borne basse et une borne haute permettent de visualiser ces zones d'accumulations et de distributions. En complément de cet oscillateur une EMA a été ajoutée. Elle permet de mettre en évidence un changement de momentum sur l'écart type. Un croisement de l'EMA en borne basse permet d'apporter un peu plus de conviction sur la recherche d'un setup.

Liste des paramètres :

