FTSE RUSSELL
An LSEG Business

FTSE MIB Implied Volatility Index

aggiornamento: 31 Dicembre 2025

L'indice FTSE MIB Implied Volatility (IVI) è un indice di volatilità che – facendo riferimento al valore implicito nei prezzi delle opzioni su indice – misura la volatilità dell'indice FTSE MIB.

Sono calcolate e diffuse le versioni (con dati annualizzati) a 30, 60, 90 e 180 giorni.

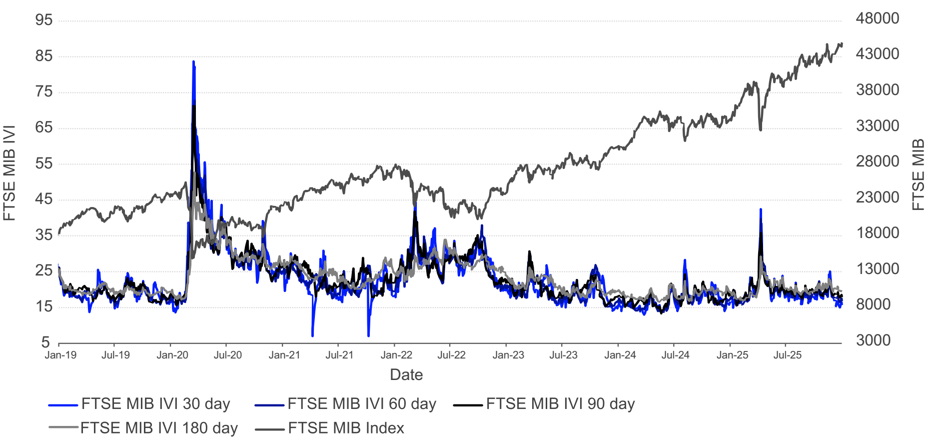
La volatilità attesa è calcolata partendo dai prezzi delle opzioni outofthe money disponibili sull'IDEM, che incorporano le previsioni sull'evoluzione futura della volatilità.

Index tickers are: IVMIB30, IVMIB60, IVMIB90, IVMIB180

FTSE MIB IVI - Volatilità implicita

	volatilità a 30 giorni			volatilità a 60 giorni			volatilità a 90 giorni			volatilità a 180 giorni		
Anno	media	max	min	media	max	min	media	max	min	media	max	min
1Y	19.23	42.47	14.95	19.44	39.76	15.85	19.93	35.77	15.61	20.15	29.24	16.89
2024	17.05	28.28	13.05	16.77	23.90	13.67	17.54	24.29	13.42	18.66	22.44	16.52
2023	19.56	30.62	13.81	19.21	26.94	14.94	20.07	30.71	15.39	20.88	26.16	17.70
2022	28.00	44.58	17.93	27.31	38.32	19.48	27.77	41.87	21.02	27.39	33.93	22.34
2021	21.37	30.93	7.05	21.77	28.83	17.66	22.96	29.61	17.43	24.20	29.44	19.93
2020	32.46	83.76	13.71	30.80	72.81	15.89	30.84	71.35	15.70	30.02	52.67	17.20
Since 4/2010	25.77	83.76	7.05	25.38	72.81	13.46	25.75	71.35	15.20	26.04	52.67	17.20

FTSE MIB IVI - Volatilità implicita



CARATTERISTICHE

Obiettivo

- L'indice fornisce una stima delle aspettative espresse dal mercato sulla volatilità dell'indice sottostante, riferite al periodo tra il momento attuale e la scadenza delle opzioni, consentendo agli investitori di effettuare decisioni di risk management e trading meglio informate.

Idoneità

- L'indice è calcolato sulla base delle opzioni out-of-the-money put e call delle due scadenze a cavallo del periodo di interesse (30, 60, 90, 180 giorni).
- Il prezzo delle opzioni incorpora le aspettative del mercato sulla volatilità futura.

Trasparenza

- Gli indici sono gestiti in base a regole trasparenti e disponibili al pubblico.

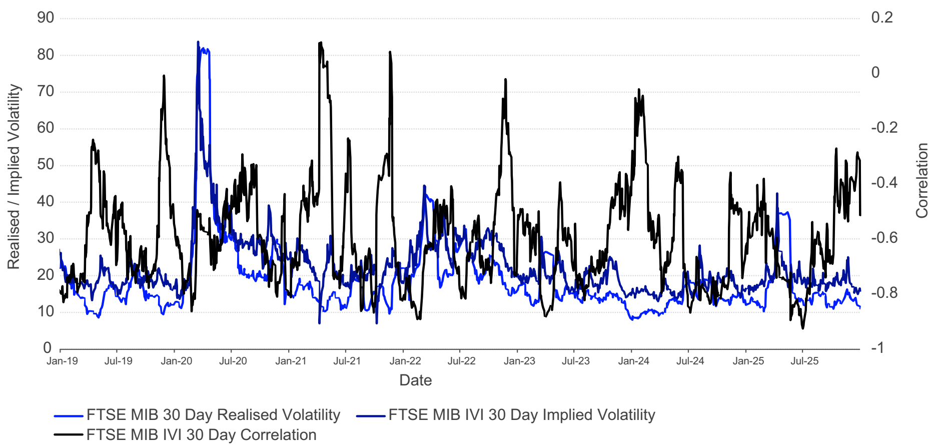
Correlazione tra FTSE MIB e FTSE MIB IVI

	correlazione 30 giorni			correlazione 90 giorni		
Anno	media	max	min	media	max	min
1Y	-0.61	-0.27	-0.92	-0.68	-0.39	-0.88
2024	-0.60	-0.06	-0.87	-0.63	-0.42	-0.79
2023	-0.63	-0.36	-0.88	-0.63	-0.45	-0.77
2022	-0.61	-0.02	-0.90	-0.54	-0.43	-0.70
2021	-0.51	0.11	-0.87	-0.63	-0.42	-0.82
2020	-0.59	-0.29	-0.86	-0.60	-0.48	-0.79
Since 4/2010	-0.55	0.11	-0.92	-0.58	-0.29	-0.82

FTSE MIB: volatilità implicità (IVI) ed effettiva (EFF)

	volatilità a 30 giorni		volatilità a 90 giorni	
Anno	IVI	EFF	IVI	EFF
1Y	19.23	16.63	19.93	17.57
2024	17.05	13.47	17.54	13.52
2023	19.56	15.68	20.07	16.60
2022	28.00	23.83	27.77	24.45
2021	21.37	15.15	22.96	16.17
2020	32.46	30.40	30.84	31.89
Since 4/2010	25.77	22.56	23.18	23.14

FTSE MIB: volatilità implicità ed effettiva



INFORMAZIONI

Lancio dell'indice
18 febbraio 2013

Frequenza di calcolo dell'indice
A fine giornata

Dati storici
Dal 1° aprile 2010

Regole dell'indice
www.ftserussell.com

Tickers
IVMIB30
IVMIB60
IVMIB90
IVMIB180

Definizioni disponibili su info@ftserussell.com

Per maggiori informazioni visitate lseg.com/ftse-russell, scrivete a info@ftserussell.com o contattate il vostro ufficio locale di FTSE:

EMEA
+44 (0) 20 7866 1810

North America
+1 877 503 6437

Asia-Pacific
Hong Kong +852 2164 3333
Tokyo +81 3 3581 2764
Sydney +61 (0) 2 8823 3521