

무제

JunDoJun
@JunDo1050



[구독자용] UVIX 업데이트 03.02.26

결국 어제의 VIX breakout은 +14%에 그치고 본장이 열리며 롱감마 형성, 매수세가 받쳐주고 숏스퀴즈도 발생하며 vix mean reversion (원래자리로 회귀하려는 힘)이 발생했습니다.

VVIX는 안착하는 구간이 어딘지가 중요한데 현재 100수준에 머물러 있습니다 (=VIX의 변동성에 대한 우려가 여전히 높은 수준) - 첫번째 참고 사진.

이 패턴은 지난번 1월 19일에 있었던 VIX breakout (하루 +30% 이상 박스가 튀는 현상) 직전에 있었던 조짐 (14-16일 VIX failed rise 이후 VVIX가 100 근처에 안착했던 패턴)과 유사하게 진행되고 있습니다 - 두번째 참고 사진

VX2! - VX1! 컨탱고는 가팔라지긴 했지만 여전히 5-6% 대로 비교적 완만한 수준을 유지 중 입니다 (time decay는 있지만 \$UVIX 가격에 강력한 하방압력은 아님).

☞ 내재변동성 폭등에 대한 우려가 여전히 남아 있는데, 그 에 비해 저렴한 보험이라 보여짐

☞ 하지만 다른 악재들이 수면위로 2-3일 안에 떠오르지 않고 컨탱고가 더 가팔라지며 time decaying 효과가 커질 수 있음으로 그 때는 과감히 손절 고려.

어제 밤에 uvix가 튀어올랐을 때 저는 포지션 일부 익절 하였는데, 남은 물량은 손실구간 진입하여 아쉽네요. 다만 바이 오더 걸어뒀던 가격 구간까지 진입하여 오히려 추매 하였고 평단은 5.70수준으로 유지 중 입니다.

크립토 시장과 원자재 시장 가격대는 여전히 불안불안 해 보이긴 합니다만, 길게 본다면 매력적인 진입구간이라 생각합니다 (DAT 재진입 고려 중).



