

# 무제 3

## [구독자용] 잠재적 변동성에 대한 우려가 아직 남아있다 🤔

JanDeKun  
@JanDeKun000 · 1월 16일

여래 전략공개용 글에 이어서 후반부 내용입니다.

<https://x.com/JanDeKun000/status/2011933084205015224?c=20>

우선 구독자용으로 올렸던 "VVIX에 관하여 2" (링크):

<https://x.com/JanDeKun000/status/2001813032256677364?c=20>

1)에 나열한 내용 중 관련 내용입니다.

### < 8. 오너리얼 지표 >

다시 말씀드리지만 이전 저 나름대로의 줄이고 항상 받아 떨어지진 않습니다. 대신 확률을 높이기 위한 전략이자 타이밍을 잡도록 도와주는 틀 정도로 봐주시기 바랍니다.

1) 최근 한달만에 VIX/VVIX가 0.96 이하로 내려갔다 기록하게 변동했는지, 이게 VVIX 진입/추가 진입을 고려하는 첫번째 테스트.

이게 통과가 되고 나면:

2) 아래의 조건 중 2가지 이상이 충족되는 지 확인:

a. VIX-VIX2 contango < 2-3% OR 빠르게 좁혀지는지

b. S&P500 index의 장기평균에 연속적인 하락 압력이 관찰되는지 (= 폭리거리 확인 완료)

c. VIX가 올랐는데도 VVIX가 다소 높은 수준 (100 근처)에 머물러 있는지

d. VIX가 상승 +30% 이상 상승하는지

e. S&P500의 상승 변동성 없이 -1.0% 이상 하락하는지 (= 바이더리얼 제련책이 지나 없음)

3) 우선 VIX/VVIX가 다시 0.16 이하로 진입했습니다 (= 잠재적 변동성에 대한 우려는 높지않은 단기 변동성은 여전히 제한적인 상태).



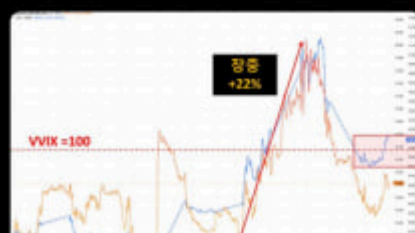
다들 말해도 여러 V자 반동을 본 상태라 여전히 VIX breakout 가능성을 시장이 보고 있는 상태라 볼 수 있습니다.

4) 그리고 5가지 테스트 중 두가지가 실패한 상태입니다.

(a) 컨탱고 좁혀지는 현상과



(d) VIX가 실패 위해 올랐는데도 VVIX가 다소 높은 수준 (100 근처)에 머물러 있는 상태가 유지 중입니다





(b)의 경우 14일에 VIX breakout이 발생하러다 14~15일 트랜즈가 되고 해버려다 (파질 때일과 이런 개입 가능심 남습, 대만 관세원제) failed rise로 마무리 되는 모습 보여줌.

+22%에 미봉고 놓치는 실재합니다.

대작까지 "UVIX에 관하여 2" 에서 설명드린 물이 지켜지고 있어서 다음 주까지는 좀 더 두고 볼 생각입니다.

당장 선물시장의 모습만 보면 오늘 장은 불안감이 해소될 가능성도 다소 있어 보이기 합니다만 ! 다음 아시타시파 분장 결과가 가장 중요합니다.

문장은 여유를 두고 분장 끝까지 보고 다음 주에 해보는 것으로.. 🍀