

אסטרטגית מסחר מבוססת VIX- הסנטימנט הכי טהור שיש

www.tipsbank4u.com

סוף שבוע מסחר

הבהרה חשובה: הנתונים המוצגים מתעדכנים ברמה היומית ומציגים את המצב של סוף יום המסחר האחרון. האישור הסופי וההובע למגמות ולשינויים יהיו ממוזגים המצב של סוף שבוע המסחר - תמונה שתוצג לכל המאוחר ביום שני של תחילת שבוע המסחר.

מכשיר הסטם ב- SVXY BOX:

אזור ירוק חתום - אזור שבו יש צפי לעלות במחיר השל המוצגת אבל עדות רמת הסכין הזה יחסית גבוהה

אזור ירוק עליון - אזור שבו יש צפי לעלות במחיר השל המוצגת ברמת כוח נמוכה יותר

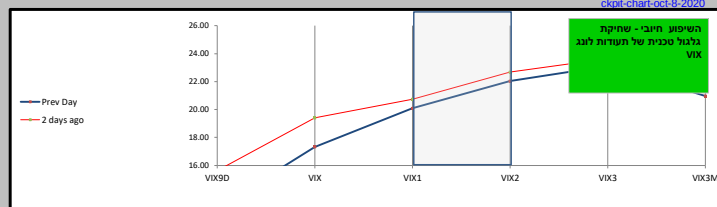
אזור אפור - אזור שבו התנהגות המעודדה איננה עקבית וסילה השתמשת כמקפץ של משותפים מסוים

חשוב - עיתוי הכניסה משפיע מאוד על פוטנציאל הרווח ולכן תלויים. היתר הריסי, פרטים נוספים במאמר

עקומת החוזים העתידיים של ה-VIX
שיפוע עולה - תנודתיות יורדת
שיפוע יורד - תנודתיות עולה
חשוב - לטווח הקצר קובע השיפוע של המקטע בין VIX1 לבין

להרחבה על עקומת החוזים העתידיים

<https://www.tipsbank4u.com/post/ckpit-chart-oct-8-2020>



MAY							JUNE							JULY							AUGUST						
Sa	Su	Mo	Tu	We	Th	Fr	Sa	Su	Mo	Tu	We	Th	Fr	Sa	Su	Mo	Tu	We	Th	Fr	Sa	Su	Mo	Tu	We	Th	Fr
3	4	5	6	7	8	9	7	8	9	10	11	12	13	5	6	7	8	9	10	11	2	3	4	5	6	7	8
10	11	12	13	14	15	16	14	15	16	17	18	19	20	12	13	14	15	16	17	18	9	10	11	12	13	14	15
17	18	19	20	21	22	23	21	22	23	24	25	26	27	19	20	21	22	23	24	25	16	17	18	19	20	21	22
24	25	26	27	28	29	30	28	29	30					26	27	28	29	30	31		23	24	25	26	27	28	
31														30	31												

ארועים משפיעים השבוע - פרוט יומי

פרסום דוחות כספיים, נתוני אבטלה,

הנפקות וכו

<https://www.tipsbank4u.com/market>

התחלת הכי טוב שאתה יכול - רוצה להגביר? - www.tipsbank4u.com

[illegible]



המידע הכולל בד"ר אים מרזה ייעץ הפקעות ואים מרזה תחליף יליעץ מקצועי המתחשב בצרכיו של המשתמש, במצב הכללי ובספחיות. המידע בד"ר אים מרזה הצעה, המלצה, או הכוונה לבצע פעולת מסחר לרכישה, מכירה או אחרת, החירותית שלטובת בידעם, העברתו הלאה או המלצתו לעובדיו לבצע פעולה כלשהי הנה באחריות ממשלתית ובלעדיה ישיקול דעתו לסיכין של המשתמש בלבד. המשתמש אחראי וזקוק על עצמו להכיר, להבין ולקבל את המידע וההמלצות המוצגות כאן, ולקבל את המלצות הספציפיות שישמשן בחיבור. בחיבור זה.

03/04/2021

סקירה מורחבת למנויים בלבד

TipsBank4u

חשוב

- ה- VIX נסוג ומבחינתו הקורונה כבר מאחורינו - לפחות לטווח הקרוב**
- סיכום קצר:
 - סיקל המסחר בטווח ובארץ עבר ל- LONG
 - מדד ה- LSM עבר ל- LONG
 - הסקטורים - ניצני התאוששות בטכנולוגיה, הפיננסים בעמדת מגנה - ראה הרחבה למטה
 - התמונה הטכנית - שיפור עם שיאים חדשים כולל שינוי כיוון של הממונטום
 - מדד ה- VIX - הפחד עודב את השוק - קורלצית הפחד שינתה כיוון - הרחבה למטה
 - איתות VIX SHORT נמשך
 - קורונה עדיין משפיעה מאד אבל נראה שהרכבת של התאוששות הכלכלית עוזבת את התחנה
 - מומנטום - שינה כיוון ותומך בהמשך העליות
 - לסיכום -

מדד ה- LSM עבר ל- LONG יחד עם סיקל המסחר

איתות VIX SHORT בתוקף

עוברים להתנהלות LONG

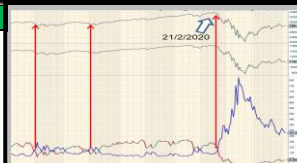
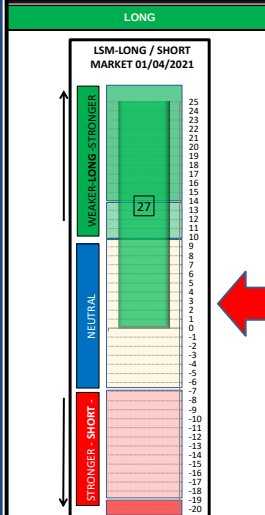
LSM - LONG / SHORT MARKET GAUGE

LONG >= 10
SHORT <= -7

לחץ לתמונת

מצב עדכנית

THE FEAR CORRELATION



לפרטים נוספים אודות קורלצית הפחד

חדש למניים בלבד:

מדד ה- LSM:

LONG / SHORT

של כלל השוק.

סיקל המסחר LONG או SHORT מספק לנו

אינדיקציה טכנית כללית - אבל הוא אינו משמש

ככלי יישומי.

המדד החדש שלנו משקלל פרמטרים טכניים

כלליים רלוונטיים - יחד עם הכלים הייחודיים שלנו

מעולמות ה- VIX.

התוצאה - אינדיקציה ברורה האם אנחנו נמצאים

במצב שוק מתאים לפוזיציות לונג או שורט - וגם

מה העומק שלו. כלל שהניקוד יותר גבוה (בערך

המוחלט) - רמת הביטחון לסחור עם הכיוון המומן

עולה.

האזורים השונים מסומנים על הגרף יחד עם הניקוד

לתאריך המצויין.

מעל הגרף יש תאור המצב להיום -

קורלצית הפחד הוכרעה ב- 1/4/21 - הסיכום הרשמי של הקורונה - מבחינת עולמות ה- VIX

מי שיתעמק בגרפים יוכח שבכל פעם שהשוק הכחול פורץ מעלה את הקו האדום ירוק - מתחילה ירידה במדד ה- VIX ובעקבותיו שיפורים בשני הגרפים העליונים - ה- NYSE 500 וה- S&P 500 Composite index.

בחלק מהפרצות זו ירידה קצרה טווח או תיקון (בל נשכח שב- 5 השנים האחרונות המגמה הראשית הייתה מגמת עליה).

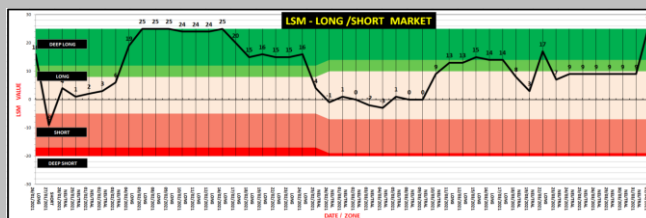
מה קרה ב- 21/2/2020 ?

וכן - העולם הכלכלי החל להפנים את המשמעות של מגפת הקורונה

כתוצאה מכך מדד ה- VIX ירדק בחדות ועבר את ה- 80 (לרוב הוא נע בטווח של 10-25 - 1-4-21 - האירוע ההיסטורי!!!)

גרף המגמה של ה- LSM:

[כיוון מחדש של התחומים 26/2/21]



סקטורים מורחב - למנויים בלבד

ההתחזקות של הסקטורים של הכלכלה הישראלית התמתנה מעט כאשר הטכנולוגיה מגלה ניצנים של שיפור והפיננסים נכנס למגננה בעקבות הקריסה של קרן הגידור שגרמה הפסדים כבדים לבנקים. אבל השיפור בפרמטרים הטכניים סולל את הדרך להמשך העליות בשוק ויש לפחות להמשיך להתחזקות של התעשייה וחומרי הגלם, גם אם הטכנולוגיה תצטרף לחגיגה.

הסקטורים המסומנים במסגרת כחולה נמצאים במגמת התחזקות כרגע ובמידה והשוק יעלה הם צפויים לתשואה עודפת כלפי כלל השוק או כלפי סקטורים אחרים.

סקטורים עיקריים	XLF סקטור הפיננסים	סקטור התשתיות XLU	סקטור הנדסה XLP - מתחזקות	סקטור הנדסה XLY - מתחזקות	סקטור הטכנולוגיה XLK
כיוון סקטור	LONG	LONG	LONG	LONG	LONG
חוזק הסקטור מול ה- SPY	WEAKER	STRONGER	STRONGER	WEAKER	WEAKER
מגמה	NEUTRAL	NEUTRAL	NEUTRAL	DOWN	NEUTRAL
סקטורים עיקריים	XLI סקטור התעשייה	סקטור האנרגיה XLE	סקטור חומרי הגלם XLB	סקטור הבריאות XLV	REAL ESTATE XLRE
כיוון סקטור	LONG	LONG	LONG	LONG	LONG
חוזק הסקטור מול ה- SPY	STRONGER	WEAKER	STRONGER	STRONGER	STRONGER
מגמה	UP	NEUTRAL	UP	NEUTRAL	UP

הסקטורים המסומנים במסגרת אדומה נמצאים במגמת החלשות כרגע ובמידה והשוק ירד הם צפויים לירידה חזקה יותר כלפי כלל השוק או סקטורים אחרים. לכן בסייקל שוק שורט הם בעדיפות למכירת שורט בתעודות הסל שלהם או במניות נבחרות הנגזרות בסקטורים

המידע הכלכלי בדף זה הוא מוהלף ויש להשתמש בו באחריות. המידע בדף זה אינו מהווה הצעה, המלצה, או הכוונה לביצוע פעולה כלשהי. המידע בדף זה אינו מהווה הבטחה או אחריות. המידע בדף זה אינו מהווה הבטחה או אחריות. המידע בדף זה אינו מהווה הבטחה או אחריות. המידע בדף זה אינו מהווה הבטחה או אחריות.

כל המידע הכלכלי בדף זה הוא מוהלף ויש להשתמש בו באחריות. המידע בדף זה אינו מהווה הצעה, המלצה, או הכוונה לביצוע פעולה כלשהי. המידע בדף זה אינו מהווה הבטחה או אחריות. המידע בדף זה אינו מהווה הבטחה או אחריות. המידע בדף זה אינו מהווה הבטחה או אחריות.

להקטן אתר: <https://www.tipsbank4u.com/copy-of-subscribers-agreement>

TipsBank4u

03/04/2021

סקירה מורחבת למנינים בלבד

TipsBank4u

פיצוחים

<https://www.tipsbank4u.com/calendar>

פרט כלל האירועים לשבוע:

אירועים ליום המסחר הקרוב:

זמן	מסב	חשיבות	אירוע	בסוף	צפי	קודם
יום שני, 5 באפריל, 2021						
16:45	USD	☆☆☆	מדד נטחל הרשט המשוקלל של (מר)	59.1		
16:45	USD	☆☆☆	מדד נטחל הרשט - מדד השירותים (מר)	59.8	60.0	
17:00	USD	☆☆☆	דחמנת מספלים (חודשי) (פבר)	2.6%	-0.5%	
17:00	USD	☆☆☆	מדד התעסוקה במגזר הלא-צריף - ISM (מר)	52.7		
17:00	USD	☆☆☆	מדד ISM במגזר הלא-צריף (מר)	55.3	58.5	
יום שלישי, 6 באפריל, 2021						
15:00	USD	☆☆☆	תחזית שוקי האגרייה לטווח הקצר (STEO)			
17:00	USD	☆☆☆	סקר מחזור פשרות מחזות ותעסוקה (פבר)	6.917M		
23:30	USD	☆☆☆	מלאי נפט שבועי - API	3.910M		

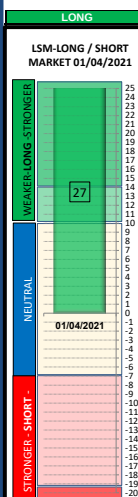
03/04/2021

מידע משלים

בפוסט היומי באתר:

<https://www.tipsbank4u.com/all-news>
לבידית המכרות שמדומות היום
<https://www.investing.com/earnings-calendar/>

ה-VIX הוכרע - ב-1/4/21 הסתיימה קורלציה הפחד שליוותה אותנו מתחילת הקורונה ב-21/2/20 כמו כן ה-VIX סגר עמוק מתחת לתמיכה - נראה בסבירות גבוהה נראה המשך הירידה שלו



מדד ה-VIX

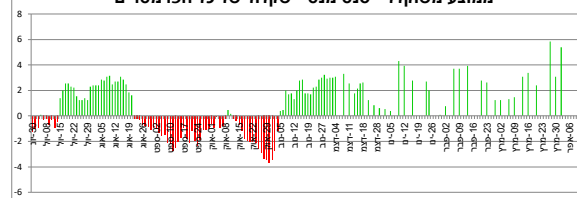
עבר ל-LONG

איתות VIX SHORT נמשך גרף המגמה מופיע למעלה ומספק מבט משלים - מעבר לרמה היומית.

התחומים כוילו מחדש 26/2/21

סנטימנט המשקיעים - חיובי עם מגמה מתחזקת של שיפור

ממוצע משוקלל - סנטימנט - שקלול של כל הפרמטרים



המידע הכללי בד"ח זה אינו מהווה ייעוץ השקעות ואינו מהווה תחליף לייעוץ מקצועי המתחשב בצרכיו של המשתמש. במסגרת הכללית יבססו את המידע בד"ח זה אינו מהווה הצעה המלצת, או הכוונה לבצע פעילות מסחר לרכישת, מכירה או אחרת, האחריות לשימוש במידע, העברתו הלאה או המלצת לאחרים לבצע פעולה כלשהי הינה באחריות מוחלטת ובלעדית לשיקול דעתו ולסיכון של המשתמש בלבד. המשתמש אחראי ורוחק על עצמו מלא הסיכון והעלות הכספית שתבצע שימוש במומרי הד"ח.

כל המידע הכלול בדוח זה הינו בעלות וכפוף לזכויות יוצרים של הפרסום. רשאים לפנות בו ריק מנשים משלמים בעלי מניין בחוק של האתר. אין להתייחס את המספר המלא או חלקים ממנו, לשכפל או לפרסם בכל מדיו פרסית או צבורית ללא אישור כתוב מראש של בעלי האתר. שימוש זה כפוף לתקנון האתר שאותו חתום עליו מתוקף המנין שרכשת לתקנון האתר: <https://www.tipsbank4u.com/copy-of-subscribers-agreement>

TipsBank4u

הסטיה שהתפתחה בין מחירי ה-SPY ל-MACD שלו התבטלה וגורא שאפקט התיקון שארך כ-3 שבועות מיצה את עצמו. ביום המסחר האחרון נפתח GAP כלפי מעלה שאמור להוות תמיכה חדשה בסגירה מתחזית עשויה לשמור כיוון אבל כמו שזה נראה עכשיו - הסבירות להמשיך העליות מתגברת.



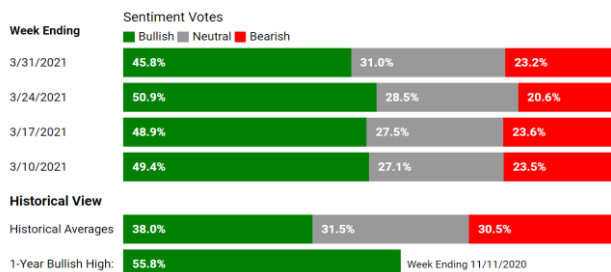
מדדים אחרים

ה-NASDAQ בהתחלה של COMEBACK עם סגירה מעל התגדול
משמעותיות ביום המסחר האחרון. הוא עבר למגמת עליה עם סגירה
מעל הממוצעים הנעים המהירים. תמונה דומה אנחנו רואים גם בראסל
2000 ויש לצפות ששניהם יתחילו לסגור את הפערים שהם פתחו מול
ה-SPY וה-DOW

סקטורים

הרעיון בסקטורים נחלש מעט - אם זה בגלל הטכנולוגיה שמראה צמיחה בתחזקות ואם המגננה שהשתחילה הפיננסיים בעקבות ארוע קר הנידון שהסב הפסדים גדולים ללקוחים. למרות זאת נראה שהקטר חומר הגלם, תשתיות ואנרגיה צפויים לתשואה עדיפה. יש לפנות ששמואל יורני: יצרנים גם בסקטורים של הצריכה.

סנטימנט המשקיעים AII השוורים נחלשו השבוע - וגם הדובים - גדל מספר היושבים על הגדר



איתות LSM LONG חדש - 1/4/21
איתות VIX SHORT מיום 22/3/21 נמשך

המידע הכלול בד"ר ח אינו מהווה ייעוץ השקעות ואינו מהווה תחליף לייעוץ מקצועי המתחשב בצרכיו של המשתמש, במצבו הכלכלי וביכולותיו. המידע בד"ר ח אינו מהווה הצעה, המלצה, או הכוונה לבצע פעילות מסחר לריבית, מכירה או אחרת, האחריות לשימוש במידע, העברתו הלאה או המצלה לאחרים לבצע פעולה כלשהי יהיה באחריות מוחלטת ובלעדית לשיקול דעתו ולסיכנון של המשתמש בלבד. המשתמש אחראי ולוקח על עצמו מלא הסיכון והעלות הכספית שתבצע שינויים בשיעור החומרי הד"ח.

כל המידע הכלול בדוח זה הינו בבעלות וספוף לזכויות יוצרים של המפרסם. רשאים לצפות ברוך מנינים משלמים בעלי מנין בתוקף של האתר. אין להעתיק, את המסמך המלא או חלקים ממנו, לשכפל או לפרסם בכל מדיה פרטית או ציבורית ואישור כתוב מראש של בעלי האתר. שימוש זה הפוך לתקנה האחרת שאינה חתום עליו מתוקף המנין שרכשת. לדעתנו המצוי

<http://www.timeshahar.com/content-of-subschapters.htm>