18/12/2020

# Daily Cockpit Chart
# לוח שליטה יומי - שוק ההון האמריקאי

**אסטרטגית מסחר מבוססת VIX- הסנטימנט הכי טהור שיש**

www.tipsbank4u.com

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

| **השוק** - כל הנתונים מתיחסים לשוק האמריקאי ולמדד העיקרי- S&P500 | **מגמה כללית** - UP, DOWN או מעבר - CHANGE | **מומנטום** | **זרימת הכסף**<br>סימן "-" = זרימה החוצה,<br>סימן "+" = זרימה פנימה | **אחזקות- טווח ארוך,** HOLD = מזומן בחוץ! | **אחזקות- טווח קצר של ימים בודדים.** HOLD = מזומן בחוץ! |
|---|---|---|---|---|---|
| | UP | CHANGE | ++++ | HOLD | HOLD |
| | ⬅ סייקל המסחר | | | | |

| **סקטורים עיקריים** | סקטור הפיננסים XLF | סקטור התשתיות XLU | סקטור הצריכה המחזורית - XLP | סקטור הצריכה הלא-מחזורית XLY | סקטור הטכנולוגיה XLK |
|---|---|---|---|---|---|
| **כיוון סקטור** ⬅ | LONG | LONG | LONG | LONG | LONG |
| **חוזק הסקטור מול ה- SPY** | חלק זה מיועד למנויים בלבד בסקירה המורחבת | | | | |

| **סקטורים עיקריים** | סקטור התעשיה XLI | סקטור האנרגיה XLE | סקטור חומרי הגלם XLB | סקטור הבריאות XLV | REAL ESTATE XLRE |
|---|---|---|---|---|---|
| **כיוון סקטור** ⬅ | LONG | CHANGE | LONG | LONG | LONG |
| **חוזק הסקטור מול ה- SPY** | חלק זה מיועד למנויים בלבד בסקירה המורחבת | | | | |

## תנודתיות - מדד הפחד

VIX ונגזרותיו

הנתונים מתיחסים לסוף יום המסחר האחרון

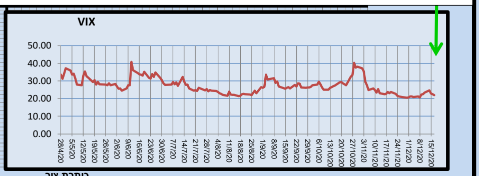
| | VIX | CONTANGO | VIXO |
|---|---|---|---|
| | 21.93 | 6.72% | 44.09 |
| | -2.53% | ככל שה- CONTANGO יותר גבוה - גדלה ההסתברות שתעודות שורט על ה- VIX (כמו SVXY ) יעלו | ככל שה- VIXO - יותר גבוה - גדלה ההסתברות שתעודות שורט על ה- VIX (כמו SVXY ) יעלו |
| **TOTAL MARKET PUT/CALL RATIO** ⬅ | 0.69 | ⬅ גבוה מ- 1 = גידור - צפי לירידה בשוק | |

**חשוב מאד:**
המסחר בנכסי תנודתיות - VIX ונגזרותיו - הינו תנודתי מאד ובעל סיכון גבוה להפסדים כבדים. המידע המוצג כאן מבוסס על נתונים טכניים נכונים ליום המסחר האחרון. מה שהיה אינו בהכרח מה שיהיה ואין לראות בסקירה זו ובכל הנאמר באתר המלצה כלשהי לרכישה ומכירה של ניירות ערך כלשהם או לבצע פעולה כלשהי בשוק ההון

## SVXY BOX

**חשוב מאד:**
**הנתונים מתיחסים לתעודת SVXY - בהגדרתה היא מבצעת עקיבה ביחס הפוך (שורט) של 0.5 X על מדד ה- VIX**
המסחר בנכסי תנודתיות - VIX ונגזרותיו - הינו תנודתי מאד ובעל סיכון גבוה להפסדים כבדים. המידע המוצג כאן מבוסס על נתונים טכניים נכונים ליום המסחר האחרון. מה שהיה אינו בהכרח מה שיהיה ואין לראות בסקירה זו ובכל הנאמר באתר המלצה כלשהי לרכישה ומכירה של ניירות ערך כלשהם או לבצע פעולה כלשהי בשוק ההון

חלק זה מיועד למנויים בלבד



כותרת ציר

כותרת ציר

מיקום הסמנים ב- SVXY BOX:

**אזור ירוק תחתון** - אזור שבו יש צפי לעליות בתעודת הסל המוצגת אבל עדיין רמת הסיכון הינה יחסית גבוהה

**אזור ירוק עליון** - אזור שבו יש צפי לעליות בתעודת הסל המוצגת ברמת סיכון נמוכה יותר

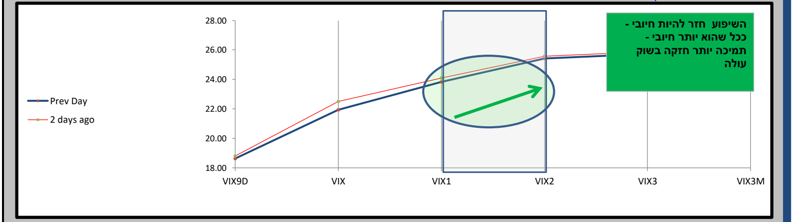
**אזור אפור**- אזור שבו התנהגות התעודה איננה עקיבית ויכולה להשתנות כפונקציה של משתנים נוספים

**חשוב - עיתוי הכניסה משפיע מאד על פוטנציאל הרווח ולכן התיזמון הינו קריטי. פרטים נוספים באתר**

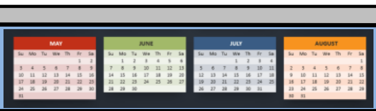
**עקומת החוזים העתידיים של ה- VIX**
שיפוע עולה - תנודתיות יורדת
שיפור יורד - תנודתיות עולה
חשוב - לטווח הקצר קובע השיפוע של המקטע בין VIX1 לבין

להרחבה על עקומת החוזים העתידיים

https://www.tipsbank4u.com/post/cockpit-chart-oct-8-2020



השיפוע חזר להיות חיובי - ככל שהוא יותר חיובי - תמיכה יותר חזקה בשוק עולה



אירועים 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**

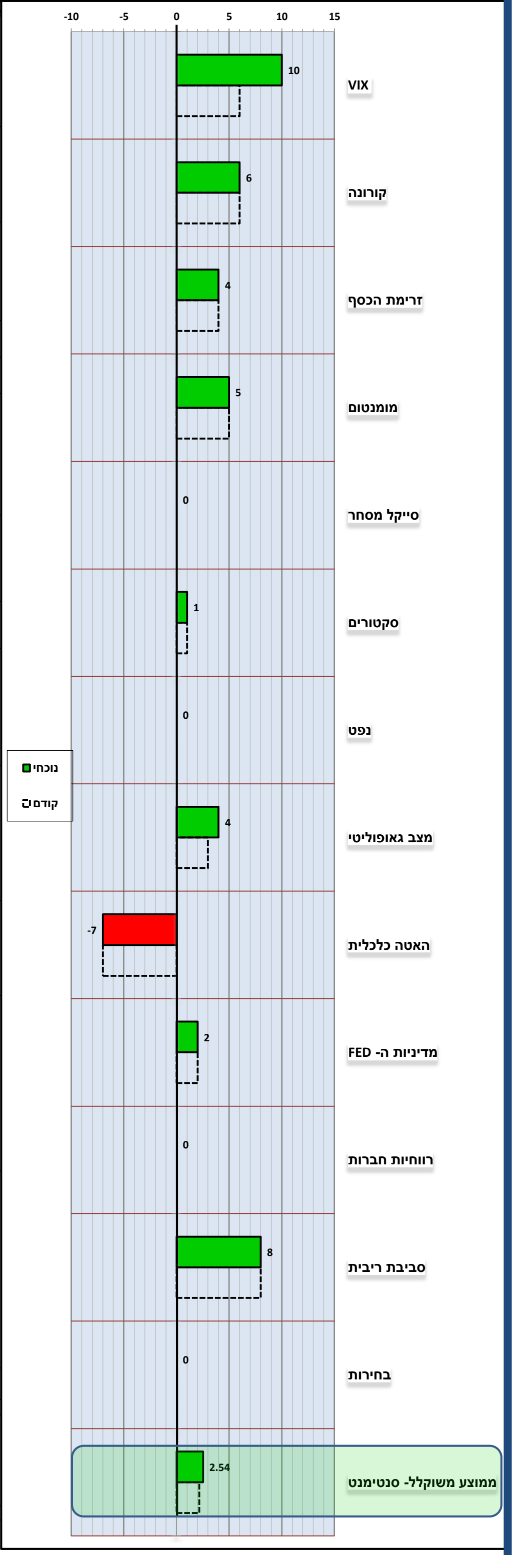
המידע הכלול בדו"ח זה אינו מהווה ייעוץ השקעות ואינו מהווה תחליף לייעוץ מקצועי המתחשב בצרכיו של המשתמש, במצבו הכלכלי וביכולותיו. המידע בדו"ח זה אינו מהווה הצעה, המלצה, או הכוונה לבצע פעולות מסחר לרכישה, מכירה או אחרת. האחריות לשימוש במידע, העברתו הלאה או המלצה לאחרים לבצע פעולה כלשהי הינה באחריות מוחלטת ובלעדית לשיקול דעתו ולסיכון של המשתמש בלבד. המשתמש אחראי ולוקח על עצמו מלוא

18/12/2020

# Daily Cockpit Chart
# לוח שליטה יומי - שוק ההון האמריקאי

## הזדמנויות איומים

| פרמטר | הסבר |
|---|---|
| VIX | **עבר למגמת ירידה** |
| **קורונה** | החיסונים ניכנסים לשלב המעשי עם אישור ראשון לפייזר ומודרנה בדרך |
| **זרימת הכסף** | 4 מתוך 4 מימדים שאנחנו מנטרים חיוביים |
| **מומנטום** | **המומנטום נחלש וכרגע בשלב מעבר** |
| **סייקל מסחר** | **עבר ל- HOLD גם בטווח הארוך וגם בטווח הקצ** |
| **סקטורים** | אין כרגע סקטורים מועדפים בצורה מובהקת |
| **נפט** | ירידה במלאים מעבר לצפוי אבל עדיין לא ברמה שמבשרת שינוי מהותי |
| **מצב גאופוליטי** | נראה שאפקט הבחירות מאחורינו. צפי ל מומנטום חיובי גלובאלי |
| **האטה כלכלית** | הקורונה עוד כאן, הגל השני מתפשט וזה משפיע על מרבית המדינות המערביות. סין קוטפת את הפירות של השתלטות על המגפה והצמיחה שם מאיצה בהתאם |
| **מדיניות ה- FED** | ללא שינוי של הריבית ובתקווה לפחות התערבות פוליטית תחת הממשל החדש |
| **רווחיות חברות** | הדוחות ממשיכים להתפרסם - אין קטסטרופות למרות שהציבור מעניש על צפי לא ברור לעתיד |
| **סביבת ריבית** | על פי הודעת הפד הריבית לא צפויה להשתנות עוד הרבה זמן |
| **בחירות** | **תחילת העברת הממשל - עדיין ללא הודאה של טראמפ בהפסד שלו.** |
| **ממוצע משוקלל- סנטימנט** | שקלול של כל הפרמטרים |
| | |
| **הערה - הניקוד לפרמטרים השונים נעשה להערכת המחבר על פי פרמטרים רלוונטיים. אין לראות בכך המלצה** | |



המידע הכלול בדו"ח זה אינו מהווה ייעוץ השקעות ואינו מהווה תחליף לייעוץ מקצועי המתחשב בצרכיו של המשתמש, במצבו הכלכלי וביכולותיו. המידע בדו"ח זה אינו מהווה הצעה, המלצה, או הכוונה לבצע פעילות מסחר לרכישה, מכירה או אחרת, האחריות לשימוש במידע, העברתו הלאה או המלצה לאחרים לבצע פעולה כלשהי הינה באחריות מוחלטת ובלעדית לשיקול דעתו ולסיכון של המשתמש בלבד. המשתמש אחראי ולוקח על עצמו מלוא הסיכון והעלות הכספית שתנבע משימוש שייעשה בחומרי הדו"ח.