



סקירה שבועית שוק מט"ח

02/02/2025





סיכום וציפיות

Sentiment:

- Short USDJPY, USDCHE, USDCAD
- Long EURUSD
- Short GBPUSD, AUDUSD
- Short GBPCAD, GBPJPY, GBPCHE
- Short AUDCAD, AUDJPY, AUDCHE
- Long EURGBP, EURAUD

- פאונד - ↓ ירידה.
- אוסטרלי - ↓ ירידה.
- קנדי - ↑ עליה.
- ין - ↑ עליה.
- פרנק - ↑ עליה.
- יורו - ↑ עליה.
- דולר - ↓ ירידה.
- סנופי - ↓ ירידה.

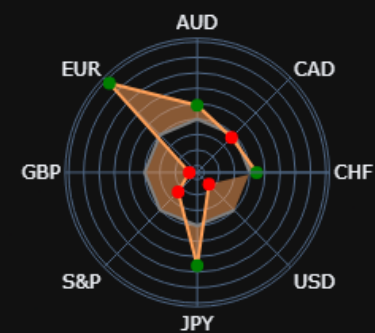




סקירה כללית



Overview



Ticker	Longs	Shorts	Total	Longs [%]	Shorts [%]	Net Pos	OI	OI chng [%]	Com-NonCom Diff	Com-NonCom Diff chng	Com-NonCom Diff chng [%]
CHF	4996	47996	52992	9	91	-43000	97264	0.9	-98450	1145	-1.1
CAD	21219	168820	190039	11	89	-147601	331109	-0.2	-310571	3294	-1
AUD	32196	104027	136223	24	76	-71831	192011	0.9	-150832	263	-0.2
EUR	153660	220264	373924	41	59	-66604	618908	1.5	-108199	-1418	1.3
GBP	59331	81003	140334	42	58	-21672	206821	-2.8	-61026	-24020	64.9
S&P	252595	308749	561344	45	55	-56154	2033094	-0.2	23149	38431	-251.5
JPY	96809	97768	194577	50	50	-959	216788	2.4	5778	29280	-124.6
USD	25273	11173	36446	69	31	14100	48881	11.5	23286	2886	6.6





סקירה כללית

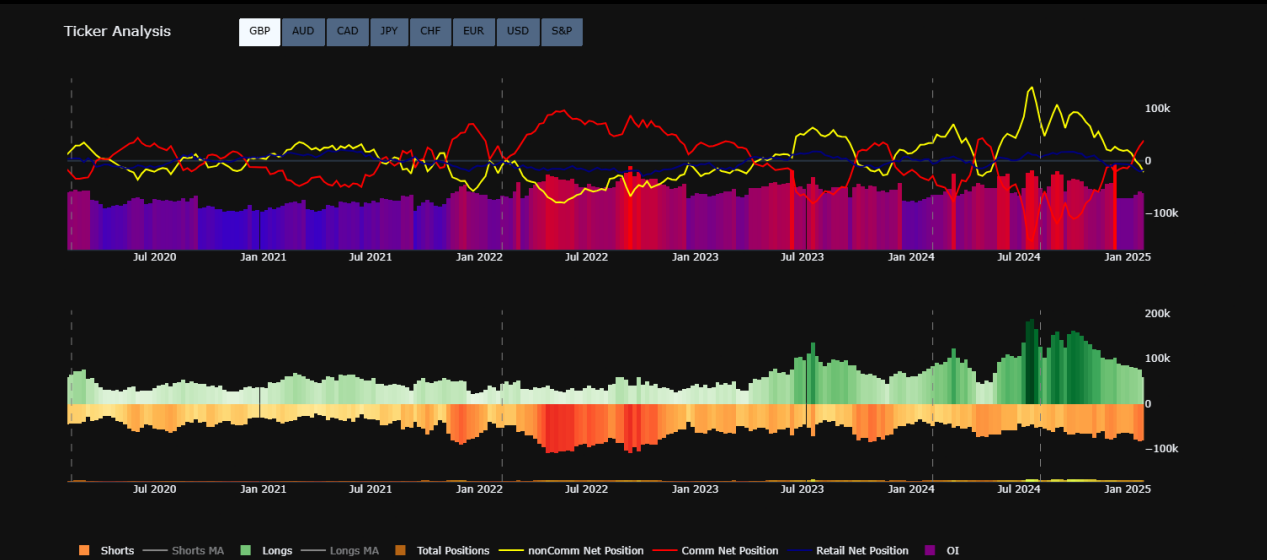
- עליה במספר החוזים הפתוחים בין, עליה מועטה ביורו. ירידה מאסיבית במספר החוזים הפתוחים בדולר, ירידה מועטה בפאונד. השאר דיי סטטיים.
- התנועה העיקרית השבוע היא התחזקות הכיוון בפאונד. הסנופי והין סתם מתרוצצים סביב אותה נקודה. שאר התנועות הן בעוצמה לא משמעותית בכלל.
- הסנופי והין ללא סנטימנט פוזיציות מובהק. הדולר בלונג. היורו והפאונד נוטים מעט לשורט, לא מובהק. הקנדי, הפראנק והאוסטרלי עדיין חזקים בשורט בצורה משמעותית.





פאונד (GBP)

- מגמת הנטו ברורה למטה, ואנחנו גם בתחתית הטווח השנתי.
- מבחינת פוזיציות, נראה שבשנה האחרונה אנחנו בתהליך איטי של צבירת שורטים, יחד עם מחזוריות של לונגים. ברגע בשלב הפריקה, במיוחד בשבוע האחרון.
- פגשנו התנגדויות חזקות, בעבר נכנסו שם הרבה שורטים. לעומת זאת, התמיכה למטה לא מיוחדת בכלל, מצפה שתישבר.



לסיכום:

מגמה כללית – למטה, מחזוריות של שנתיים צפי שבועי – למטה, עד לשבירת התמיכה



אוסטרלי (AUD)

- מגמת הנטו נראתה שורית אך נשברה חזק מטה עם פקיעת החוזים, ואנחנו באיזור התחתון של הטווח השנתי. כל זה אחרי שבאוקטובר היינו בשיא הנטו של השנים האחרונות.

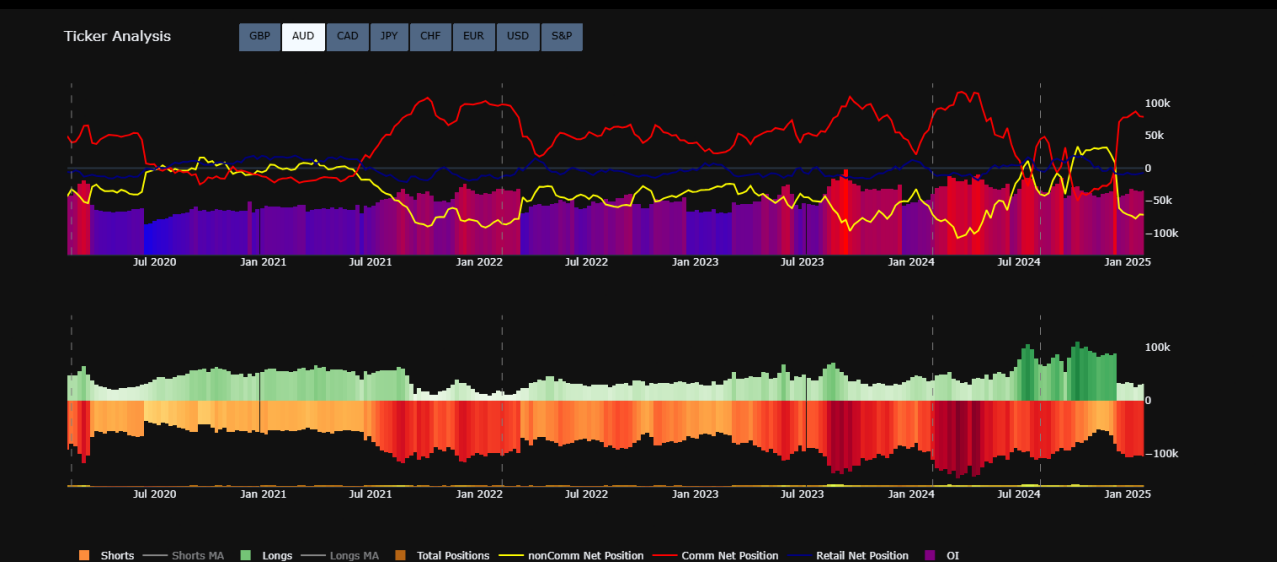
- פקיעת חוזים ללא גלגול הייתה רק בלונגים, והייתה צבירה בשורטים. כבר כמה שבועות ללא שינוי בכלל.

- תמיכה מוסדית נתנה לנו תיקון קל, אבל ההתנגדות החזקה מלמעלה אפילו בלי נגיעה שולחת אותנו למטה. מצפה לביקור מחודש בתמיכה הגדולה למטה לפני שייסגרו שורטים.

לסיכום:

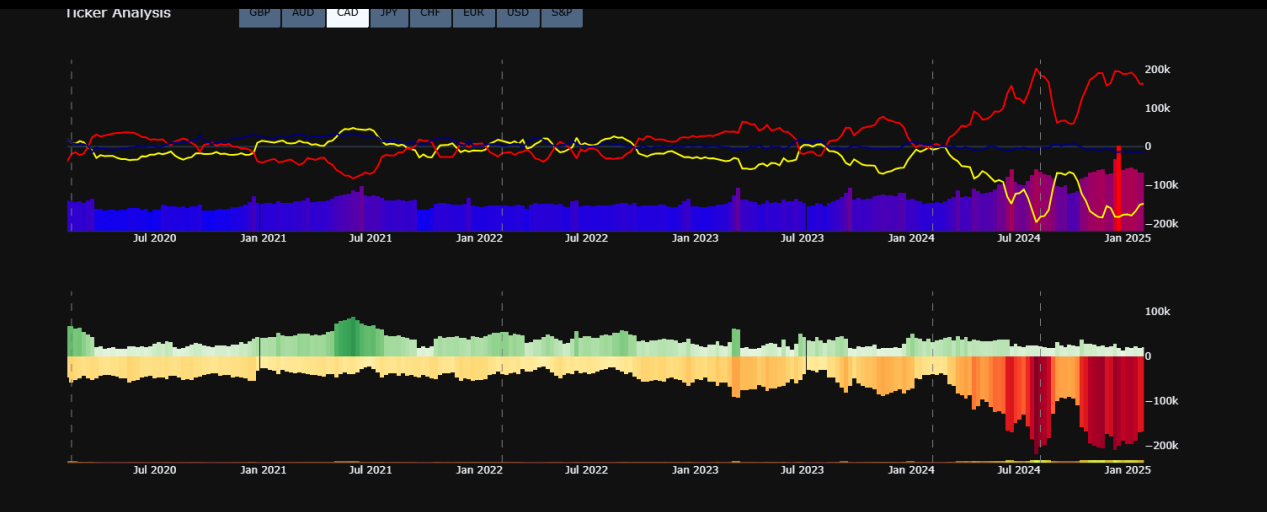
מגמה כללית – למעלה

צפי שבועי – למטה





קנדי (CAD)



- אין מגמה לנטו ברגע, ואנחנו באיזור התחתון של הטווח השנתי כבר הרבה זמן.
- אעפ"כ, אנחנו באיזור שיא כל הזמנים מאסיבי של נטו שורט ושורטים בכלל, ולא מצליחים לפרוץ אותו. מדשדשים כבר מסוף אוקטובר האחרון.
- מבחינת פוזיציות, נראה שהלונגים די סטטיים כבר הרבה זמן. השורטים עלו, ממש קרובים לשיא כל הזמנים, נראה שהתחלנו לקיחת רווחים.
- מדשדשים בתמיכה חודשית. לא קורה כלום. התנגדויות מחזיקות, אבל לא גיעים קונים אגרסיביים.

לסיכום:

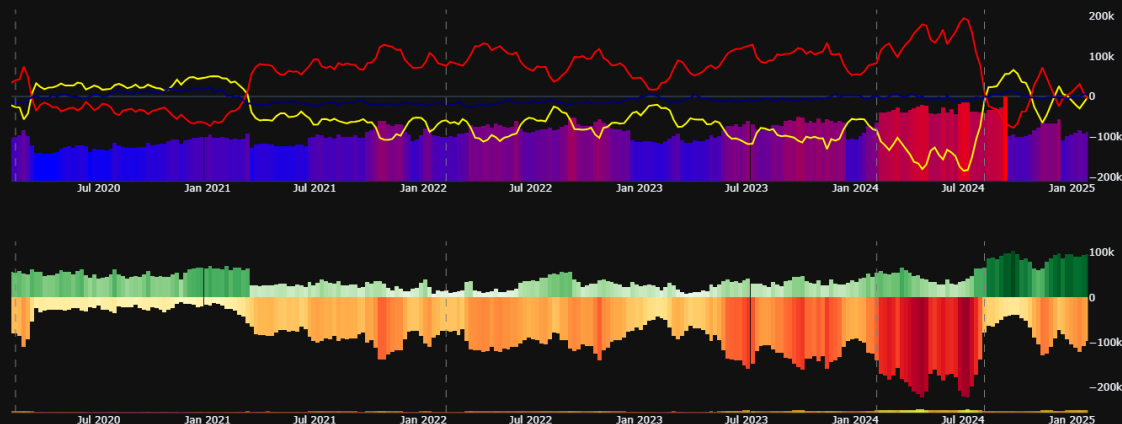
מגמה כללית – ?

צפי שבועי – למעלה, אבל עדיין תקוע



Ticker Analysis

GBP AUD CAD JPY CHF EUR USD S&P



יין (JPY)

- מגמת הנטו נראית תקועה, ואנחנו באיזור העליון של הטווח השנתי.
- אפ"כ, היינו בשיא נטו לונג של השנים האחרונות ולא פורצים אותו.
- המוסדיים והמגדרים מסכימים על שורט.
- מבחינת פוזיציות, נראה שאנחנו צוברים מעט לונגים. בו בזמן, אנחנו בסוף מחזור פתיחת שורטים. סוגרים.
- בנינו מבנה למעלה, אין הרבה התנגדות בדרך. יחד עם הסטייה מקורלציה, נראה שמצאנו תחתית בינתיים.

לסיכום:

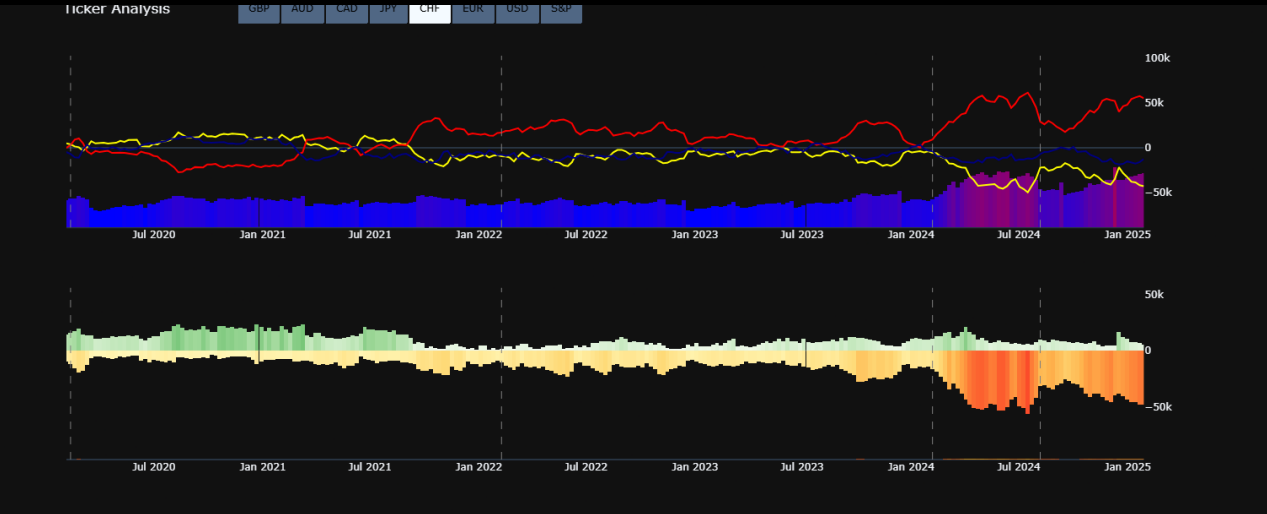
מגמה כללית – ?

צפי שבועי – למעלה





פרנק (CHF)



• מגמת הנטו שברה למטה, ואנחנו בתחתית של הטווח השנתי.

• קרובים מאוד לנמוך של השנים האחרונות בנטו שורט.

• מבחינת פוזיציות, נראה שהלונגים היו סטטיים כבר הרבה זמן, אבל בפקיעה פתחנו הרבה וסגרנו. שורטים בצבירה איטית, יש עוד מרווח עד לשיא שורטים הקרוב.

• מתקרבים לאיזור לחץ של לונגים. מצפה להמשך עלייה.

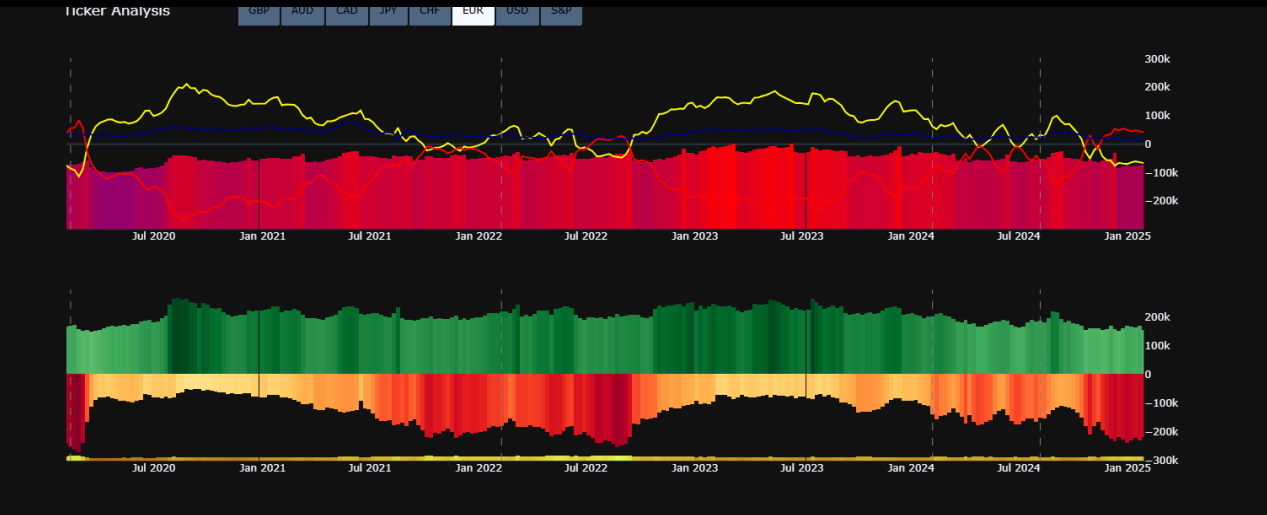
לסיכום:

מגמה כללית – נראית למעלה

צפי שבועי – למעלה, אל ההתנגדות ומעבר לה



יורו (EUR)



• מגמת הנטו נראית סטטית כבר תקופה, ואנחנו בתחתית הטווח השנתי.

• כמו"כ, שברנו את שיא הנטו שורט של ארבע השנים האחרונות וקרובים ממש לשיא שורטים.

• מבחינת פוזיציות, הלונגים במגמת ירידה קלה. ואנחנו סטטיים עם השורטים.

• מצפה לתגובה מהתמיכה שאנחנו בה בעת ושבירה של ההתנגדות מלמעלה.

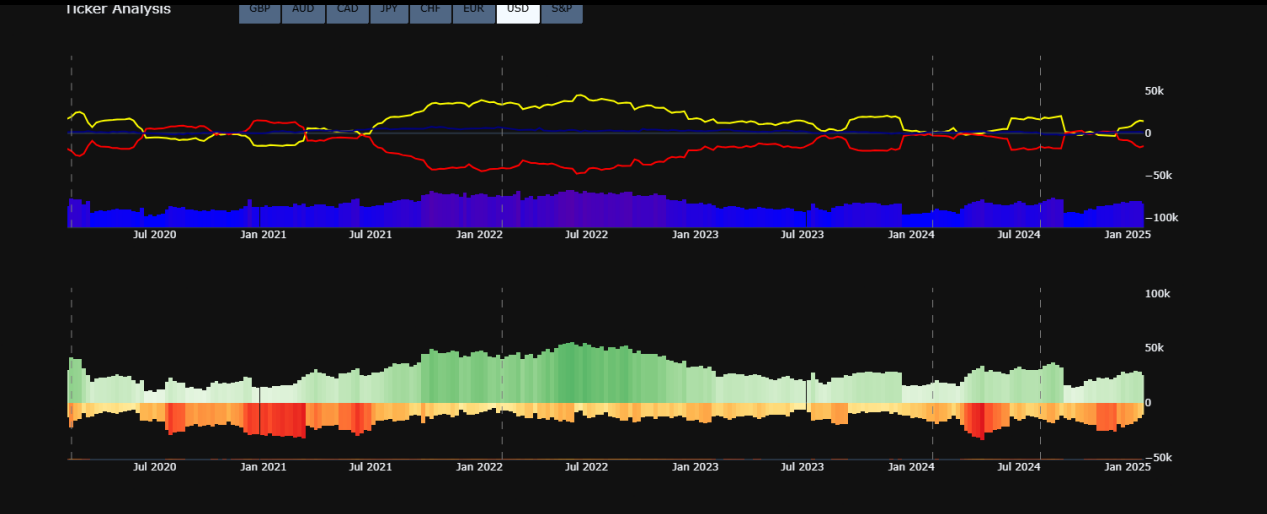
לסיכום:

מגמה כללית – ?

צפי שבועי – למעלה, עד להתנגדות



דולר (USD)



- נראה שאנחנו תקועים באיזור מגודר, בפוזיציות נטו, נמצאים בגבוה של האיזור.
- מבחינת פוזיציות, נראה שהיינו במצב בו הלונגים בצבירה איטית, שורטים בתהליך סגירה.
- ההתנגדות החודשית החזיקה.
- מצפה לירידה אל התמיכה התחתונה.



לסיכום:

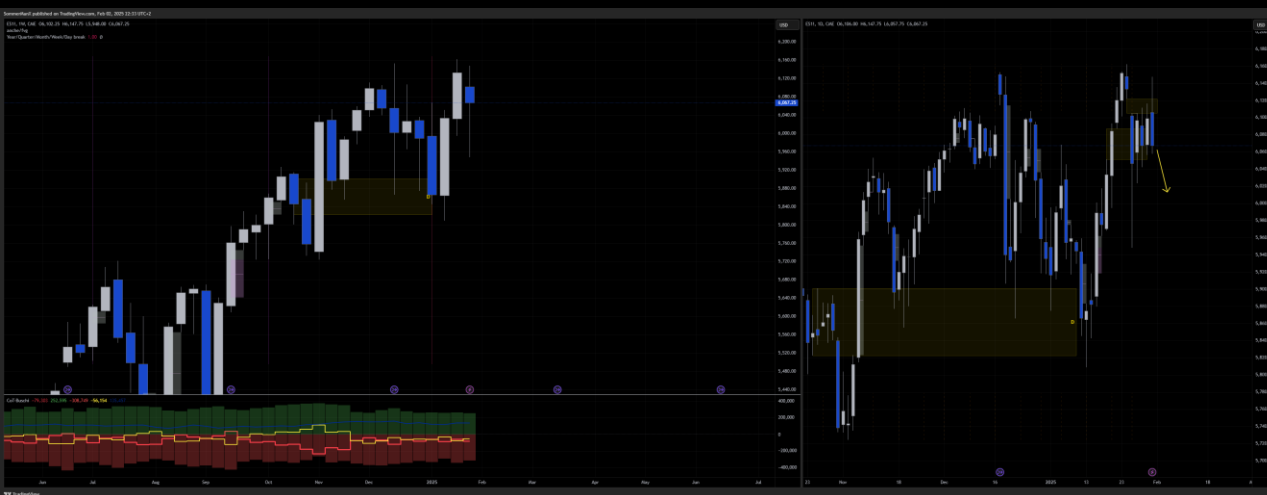
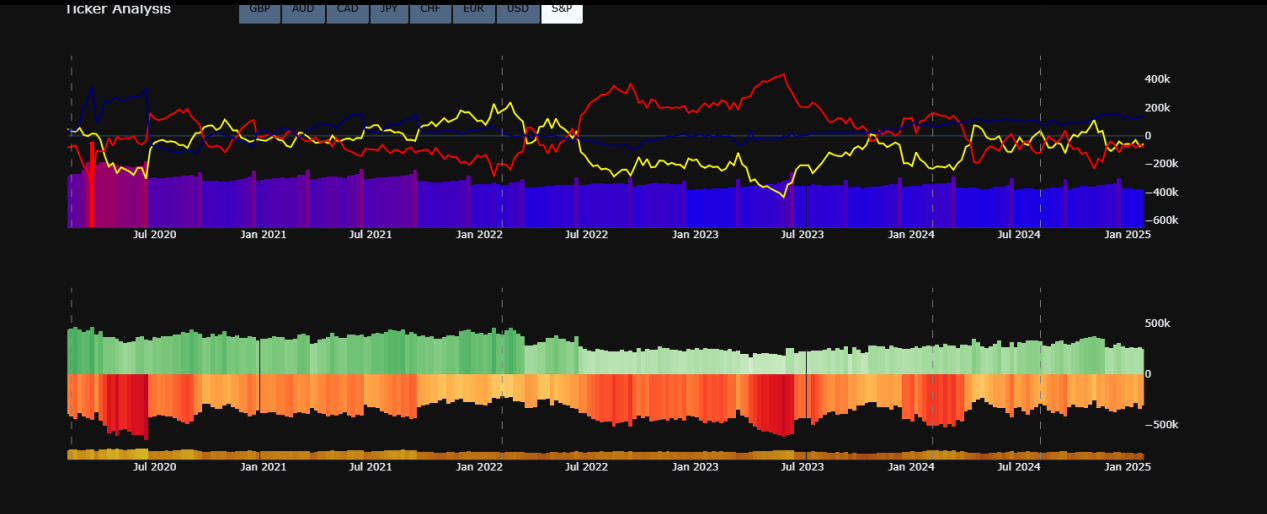
מגמה כללית – למעלה

צפי שבועי – למטה



סנרפי (S&P)

- המגדרים והמוסדיים מסכימים על שורט.
כה כבד מדצמבר.
- מגמת הנטו נראית כלום.
- שברנו לאחרונה את גבוה כל הזמנים
בנטו של שלוש השנים האחרונות.
- מבחינת פוזיציות, שורטים נראים מעט
יותר אגרסיביים מהלונגים.
- בינתיים הגאפ מחזיק בהתנגדות, עדיין
נמצאים באיזור בו נפתחו הרבה שורטים.



לסיכום:

מגמה כללית – למעלה

צפי שבועי – למטה

