

US Daily: Есть признаки коррекции, важный уровень 2780

Есть признаки замедления роста, VIX выходит из канала, но рынок пока остается в растущем канале...



Во вторник. Рынки США торговались в узком, низковолатильном диапазоне. Индекс S&P 500 торгуется в канале роста от 14 января, однако индекс Dow Jones уже вышел из канала роста от 03 января, а индекс Nasdaq подошел к нижней границе канала роста от 22 декабря. Также во вторник были опубликованы: февральский индекс непроизводственной активности ISM : 59,7 вместо ожидаемых 57,2, февральский индекс PMI в сфере услуг США : 56,0 вместо ожидаемых +56,2.

Сегодня. Фьючерс на S&P 500 продолжает движение в низковолатильном боковике. Если текущее движение продолжится, то в скором времени фьючерс будет тестировать свой локальный канал роста от 14 января. В случае выхода из канала вниз рынок может протестировать 2780 уже сегодня.

Межрынок и индикаторы. VIX (+0,75%) вновь тестирует свою верхнюю границу и с точки зрения волатильности, вероятность коррекции сохраняется. Ключевым уровнем по VIX будет глобальная поддержка \$13,6. На фоне роста запасов сырой нефти в США, фьючерс на нефть марки WTI вышел из канала тренда от 26 декабря. Ключевым уровнем поддержки будет фибо-уровень \$55,5. Фьючерс по золоту тестирует уровень \$1290 и при его пробое на хорошем объеме, продолжение коррекции будет под вопросом. Индикаторы аппетита к риску HYG/JNK пробили нижнюю границу канала, что говорит нам о осторожном поведении инвесторов на рынке. Доходность 10-летних Treasuries снизилась на фоне комментариев президента ФРС Бостона Эрика Розенгрена о том, что пауза в повышении ставок может продлиться несколько заседаний.

Сектора. Большинство секторов закрылись в минусе. Лучше рынка были потребительский сектор (+0,25%).

Из отдельных компаний стоит отметить GE (-4,72%) после того, как генеральный директор Ларри Калп заявил, что компания ожидает увидеть отрицательный денежный поток в 2019 году. TGT (+4,58%) на фоне сильного отчета.

Что ждем? В случае пробоя индексом канала роста от 14 января и пробоя 2780 на большом объеме, вероятность коррекционного сценария увеличиться. Волатильность начала расти после выхода из своего канала и есть вероятность продолжения ее роста. Основной акцент будет на сегодняшнем отчете бежевой книги ФРС и отчет по безработице в пятницу. Хотя многое будет зависеть от отчетностей, но мы не исключаем возможности коррекции по S&P 500 на этой неделе в район 2767 в случае пробоя 2780.

Действия. Удерживаем портфельные позиции, но пока воздерживаемся от новых покупок. Ждем реализации коррекции и присматриваемся к интересным активам после ее завершения. Возможно открытие спекулятивных позиций в инверсных ETF.

Защита. В случае пробоя 2767 на объеме выше среднего готовимся открывать позиции в инверсных ETF TVIX, SQQQ, SDS.

Среднесрочно | BUY LIST*:

Среднесрочно | SELL LIST:

Локально | BUY LIST:

Локально | FIX LIST:

ATVI, BA, BOX, EA, FB, GOOGL, HAS, IRBT, LMT, MGM, MMM, NFLX

*для полных параметров рекомендаций включая стоп-лоссы см. последнюю стр. репорта

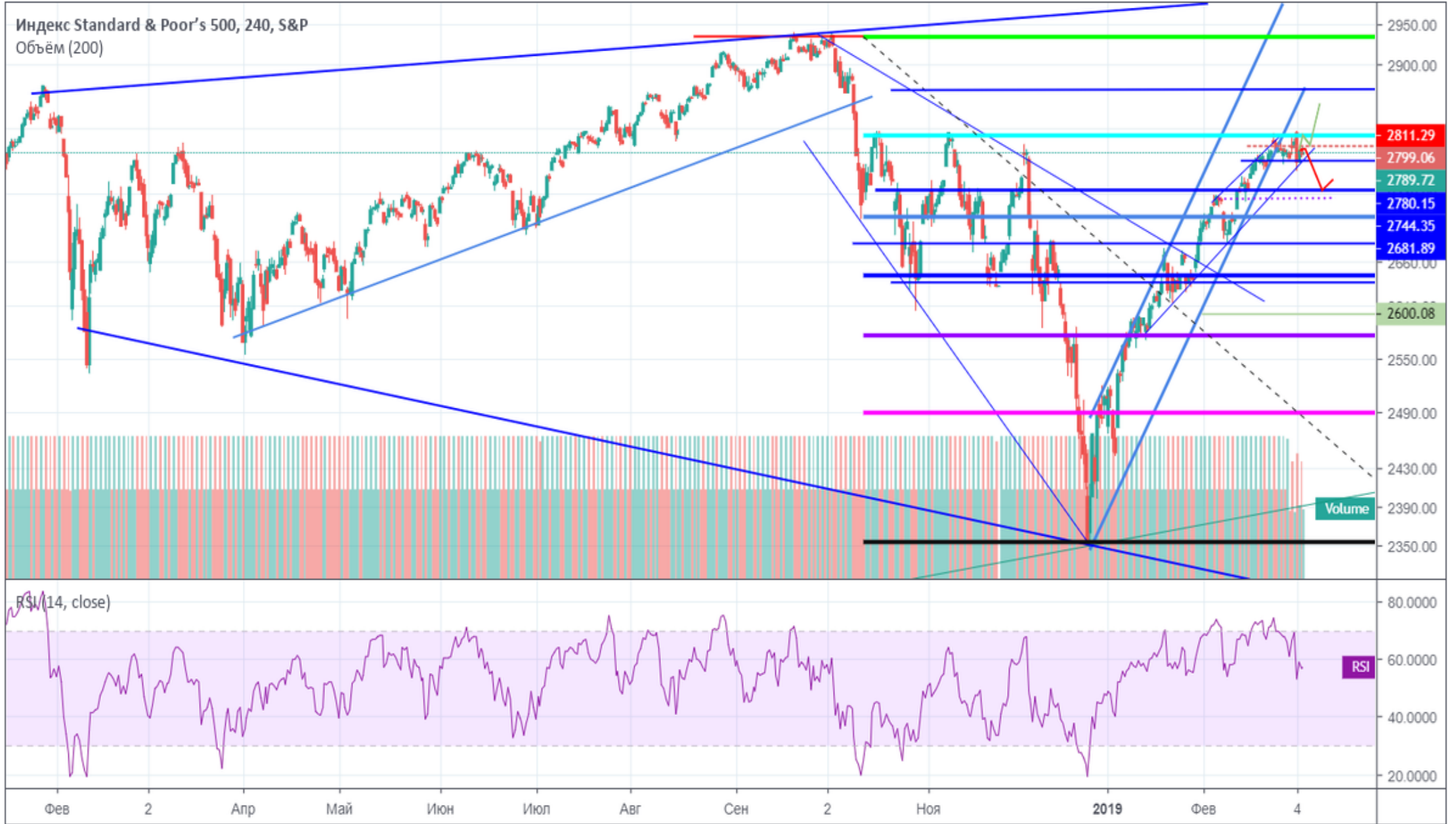
Ключевые темы и новости по рынку:

- (-) Дефицит правительства США в течение первых четырех месяцев финансового года увеличился до \$310.3B от \$ 175.7B за тот же период в FY2018.
- (=) Балансы кредитных карт США выросли на \$26 млрд в последнем квартале 2018 года, достигнув рекордных \$870 млрд по состоянию на декабрь, и «отмечают первый раз, когда остатки по кредитным картам снова достигли номинального пика 2008 года», согласно отчету ФРС.
- (=) Второй по величине акционер TSLA, британская инвестиционная компания Baillie Gifford, высказалась против текущего пребывания Илона Маска в качестве генерального директора.
- (=) Наиболее заметные отчеты о доходах, запланированные на среду, включают Abercrombie & Fitch (ANF), Dollar Tree (DLTR) до открытия рынка и American Eagle Outfitters (AEO) после закрытия рынка.
- (=) Американские официальные лица заявили, что если Турция продолжит покупку российских систем противозвушной обороны S-400, США отзовут свое предложение о продаже пакета ракет Patriot стоимостью \$ 3,5 млрд. производства RTN.
- (+) FDA одобряет применение назального спрея SPRAVATO (esketamine) CIII компании JNJ для носа вместе с преоральным антидепрессантом для взрослых.
- (=) По словам Чарльза Гаспарино из Fox Business Network, управляющие TSLA сказали банкирам, что в ближайшем будущем нет необходимости привлекать капитал, несмотря на недавние "неприятности" в компании.
- (+) AMZN ведет переговоры с центральным банком Мексики, чтобы помочь запустить новую систему мобильных платежей, поддерживаемую правительством, которая позволит покупателям расплачиваться QR-кодом, согласно сообщению Reuters.
- (+) PM и MO позитивно восприняли сообщения о том, что комиссар FDA Скотт Готтлиб ушел в отставку со своей позиции. Готтлиб занял очень жесткую позицию в отношении использования сигарет и электронных сигарет среди молодежи.
- (+) MSFT может выпустить Xbox One S без дисков в следующем месяце, согласно отчету Windows Central. Microsoft настойчиво продвигает свой Xbox Game Pass, который предлагает доступ к цифровым играм.
- (+) По данным IDC, мировой рынок носимых устройств вырос в третьем квартале на 31% и составил 59,3 млн единиц из которых 16,2 млн устройств производство APPL.
- (-) CTL снижается третий день подряд, на фоне понижения рейтинга до «Sell» by Edward Jones.

Daily Market Snapshot

Среднесрочный сценарий: при пробое 2780 возможна коррекция, смотрим на уровни

imanalin опубликовал(а) на TradingView.com, Март 06, 2019 15:28:08 +06
 SP:SPX, 240 2789.65 ▼ -3.16 (-0.11%) O:2788.67 H:2796.44 L:2787.95 C:2789.72



Создано при помощи TradingView

Локальный сценарий: волатильность в случае пробоя 2780

imanalin опубликовал(а) на TradingView.com, Март 06, 2019 17:06:13 +06
 FX:SPX500, 240 2787.5 ▼ -0.8 (-0.03%) O:2786.2 H:2787.5 L:2785.4 C:2787.5



Создано при помощи TradingView

Daily Market Snapshot

Фазы трендов акций: 1 day vs. 1 week



Daily Market Snapshot

(жирным начертанием в таблице отмечены обновленные комментарии)

Обзор акций на вторичном рынке |

Тикер	Market Cap, \$ млрд	TP avg	AVG апсайд	RSI	дн	кв	год	Тип акции	Портф-ые позиции	Портфельный комментарий	Локальные позиции	Локальный комментарий
AA	5	41	41%	50	↘	↘	↘	Cyclical	hold	удерживать есть позитив	ждать	
AAPL	828	177	1%	64	↗	↗	↗	Cyclical	hold	ждем пробой 176,5	ждать	
ABBV	116	92	16%	41	↘	↘	↘	Speculative Growth	hold	держат до 75,1	ждать	
ACN	104	170	4%	69	↗	↗	↗	Aggressive Growth	hold	Удерживаем	ждать	
ADBE	126	291	13%	54	↗	↗	↗	Aggressive Growth	hold	по пробую 262	ждать	SL 250
ALB	9	109	24%	58	↗	↗	↘	Cyclical	hold	фиксировать ниже 70	ждать	SL 86
ALXN	30	162	20%	66	↗	↗	↗	Aggressive Growth	hold	-	ждать	
AMAT	37	47	22%	53	↘	↗	↘	Cyclical	hold	есть дивергенция, ждем	ждать	SL 36,8
AMD	24	23	-2%	54	↘	↗	↗	Cyclical	hold	-	ждать	
AMGN	117	209	11%	47	↘	↘	↘	Slow Growth	hold	-	ждать	
AMZN	831	2 115	25%	61	↗	↗	↗	Cyclical	hold	по пробую 1721	ждать	
ATVI	32	54	28%	42	↘	↘	↘	Slow Growth	hold	удерживаем	фиксировать	SL на 40,8
AVGO	110	294	6%	56	↗	↗	↗	Cyclical	hold	фиксировать на 271	ждать	
BA	243	446	4%	68	↗	↗	↗	Cyclical	hold	удерживаем	фиксировать	SL на 412
BABA	480	205	11%	71	↗	↗	↗	Aggressive Growth	hold	вход по пробую 185	ждать	
BAC	281	33	14%	55	↗	↗	↘	Cyclical	hold	вход по пробую 29,7	ждать	
BOX	3	24	25%	32	↘	↗	↗	Speculative Growth	hold	-	фиксировать	-
BR	12	113	13%	47	↘	↘	↘	Cyclical	hold	интересен	ждать	-
CMCSA	175	44	14%	62	↘	↗	↗	Classic Growth	hold	вход по пробую 38,8	ждать	-
CMD	3	101	47%	27	↘	↘	↘	Aggressive Growth	hold	удерживать	фиксировать	SL на 70
CME	63	194	10%	42	↘	↘	↗	Cyclical	hold	удерживать	ждать	локально интересен
CPRT	13	62	6%	73	↗	↗	↗	Cyclical	hold	-	ждать	
CTL	13	15	22%	29	↘	↘	↘	High Yield	hold	-	ждать	
CTRP	23	40	-5%	83	↗	↗	↘	Cyclical	hold	слабый отчет, возможное формирование дна	ждать	-
DIS	170	125	9%	58	↗	↗	↗	Classic Growth	hold	-	ждать	-
DLB	7	75	17%	45	↘	↘	↘	Slow Growth	hold	-	ждать	-
EA	29	102	6%	51	↗	↗	↗	Classic Growth	hold	по пробую 111 на ограниченный объем	фиксировать	SL на 92,4
FB	489	195	14%	68	↗	↗	↘	Aggressive Growth	hold	удерживаем	фиксировать	SL на 156,5
FIT	1	7	15%	42	↘	↘	↗	Distressed	hold	-	ждать	-
FTNT	14	86	3%	56	↗	↗	↗	Speculative Growth	hold	-	ждать	SL на 81,7
GOLD	22	14	12%	47	↘	↘	↗	Cyclical	hold	-	ждать	-
GOOGL	810	1 337	14%	68	↗	↗	↗	Speculative Growth	hold	интересен	фиксировать	SL на 1108
GS	75	230	18%	52	↘	↗	↘	Cyclical	hold	поддержка 169	ждать	-
HAS	11	97	9%	54	↘	↗	↘	Cyclical	hold	Смотрим	фиксировать	-
IBB	8	#N/A	-	59	↗	↗	↗	Aggressive Growth	hold	-	ждать	-
IBM	123	143	4%	60	↗	↗	↘	Slow Growth	hold	Ждем точку входа на 153,9	ждать	-
INTC	241	54	0%	69	↗	↗	↗	Cyclical	hold	на 53 смотреть на пробой	ждать	
IRBT	4	110	-15%	79	↗	↗	↗	Cyclical	hold	-	фиксировать	SL на 118
ISRG	63	566	4%	56	↗	↗	↗	Speculative Growth	hold	-	ждать	
JNJ	370	145	4%	68	↗	↘	↗	Slow Growth	hold	Следим	ждать	
JPM	341	116	11%	51	↗	↗	↘	Cyclical	hold	ждем 103 как минимум	ждать	
KHC	40	38	16%	21	↘	↘	↘	Slow Growth	hold	изучаем	ждать	
KNSL	3	#N/A	-	62	↗	↗	↘	Cyclical	hold	-	ждать	
KRE	1	73	-	73	↗	↗	↗	Aggressive Growth	hold	удерживаем	ждать	появился дневной дивер
LC	1	4	42%	42	↘	↘	↘	Distressed	hold	ждем пробоя вверх	ждать	ждем 3,03 для спекулятивного входа
LLY	133	124	-3%	71	↗	↗	↗	Classic Growth	hold	-	ждать	
LMT	86	340	11%	59	↘	↗	↘	Cyclical	hold	удерживаем, но возможна коррекция	фиксировать	SL на 297
LUV	30	62	17%	43	↘	↘	↘	Cyclical	hold	-	ждать	
LVS	46	66	12%	50	↘	↗	↘	High Yield	hold	-	ждать	
MA	232	238	5%	71	↗	↗	↗	Cyclical	hold	пробой 225	ждать	
MCD	139	199	10%	52	↗	↘	↗	Cyclical	hold	-	ждать	
MGM	14	34	27%	41	↘	↘	↘	Cyclical	hold	следим	фиксировать	SL на 26,88
MKSI	5	102	21%	57	↘	↗	↘	Aggressive Growth	hold	удерживаем	ждать	
MMM	117	204	0%	49	↗	↗	↘	Cyclical	hold	-	фиксировать	SL на 202
MO	99	57	8%	68	↗	↘	↘	High Yield	hold	изучаем	ждать	
MOMO	7	39	11%	65	↗	↗	↗	Speculative Growth	hold	изучаем	ждать	
MSFT	857	126	13%	62	↘	↗	↗	Classic Growth	hold	-	ждать	
MU	45	47	18%	49	↘	↗	↘	Cyclical	hold	-	ждать	
NFLX	155	393	11%	54	↗	↗	↗	Aggressive Growth	hold	ждем пробоя 380	фиксировать	SL на 347
NKE	134	88	2%	60	↗	↗	↗	Cyclical	hold	удерживаем	ждать	
NTNX	6	48	42%	16	↘	↘	↘	Speculative Growth	hold	-	ждать	
NVDA	95	177	13%	55	↘	↘	↘	Cyclical	hold	-	ждать	
PANW	22	281	20%	57	↗	↗	↗	Speculative Growth	hold	держат	ждать	
PAYC	10	174	-2%	64	↗	↗	↗	Aggressive Growth	hold	-	ждать	
PEP	163	120	3%	62	↗	↘	↗	Slow Growth	hold	-	ждать	
PFE	238	45	6%	54	↗	↘	↗	Slow Growth	hold	-	ждать	
PM	135	89	2%	73	↗	↗	↘	High Yield	hold	-	ждать	
PYPL	113	101	5%	60	↗	↗	↗	Cyclical	hold	-	ждать	
QRVO	9	71	2%	66	↗	↗	↘	Cyclical	hold	-	ждать	
REGN	48	426	-2%	63	↗	↗	↗	Aggressive Growth	hold	-	ждать	
RUN	2	19	21%	63	↘	↗	↗	Distressed	hold	-	ждать	
SBUX	89	70	-2%	67	↗	↗	↗	Cyclical	hold	-	ждать	
SGMS	3	34	23%	61	↗	↗	↘	Cyclical	hold	-	ждать	
SKYY	2	#N/A	-	66	↗	↗	↗	Aggressive Growth	hold	-	ждать	
SQ	32	82	7%	54	↘	↗	↗	Speculative Growth	hold	-	ждать	
SSD	3	67	11%	52	↗	↗	↗	Cyclical	hold	-	ждать	
STMP	2	120	27%	26	↘	↘	↘	Aggressive Growth	hold	-	ждать	
STZ	32	208	24%	45	↘	↘	↘	Classic Growth	hold	-	ждать	
T	218	35	16%	43	↗	↘	↘	High Yield	hold	покупать на 32 как защитную бумагу	ждать	
TREX	4	80	7%	52	↗	↗	↗	Cyclical	hold	-	ждать	
TRVG	2	6	19%	40	↘	↘	↘	Cyclical	hold	фиксировать на 5,2	ждать	
TSLA	48	326	18%	36	↘	↘	↘	Cyclical	hold	-	ждать	
TWLO	14	125	9%	54	↘	↗	↗	Speculative Growth	hold	-	ждать	
TWTR	24	33	7%	48	↘	↘	↘	Speculative Growth	hold	-	фиксировать	
UAA	9	21	-7%	61	↗	↘	↗	Cyclical	hold	-	ждать	
ULTA	19	316	1%	66	↗	↗	↗	Cyclical	hold	-	ждать	
V	297	162	9%	65	↗	↗	↗	Cyclical	hold	удерживаем	ждать	
VRSK	21	127	1%	70	↗	↗	↗	Cyclical	hold	удерживаем	ждать	
VSH	3	25	17%	51	↘	↗	↗	Cyclical	hold	удерживаем	ждать	
VZ	232	59	6%	52	↘	↘	↘	High Yield	hold	точка входа на 58,5	ждать	
WBA	60	75	18%	24	↘	↘	↘	Aggressive Growth	hold	-	ждать	
WMT	286	109	11%	53	↘	↗	↗	Slow Growth	hold	-	ждать	
WP	30	109	14%	69	↘	↗	↗	Cyclical	hold	точка входа на 97,5	ждать	
WYNN	13	139	12%	50	↘	↗	↘	Cyclical	hold	-	ждать	
XLRN	2	62	34%	61	↗	↘	↗	Distressed	hold	-	ждать	