

US Daily: Начало коррекции, следим за уровнем 2747

Пробой уровня 2767 на хорошем объеме, вызовет повышенную волатильность. Смотрим на уровни...



В среду. На открытии сессии индекс ожидаемо снизился пробив уровень 2780 пунктов и пошел ниже к целям на нижней границе, уровень 2767. Важно, что индекс **вышел** из нижней границы канала сформированного от 14 января. Пробой привел к коррекции до уровня 2770. Признаков дивергенций нет. Остальные индексы США Nasdaq и Dow Jones также вышли из своих каналов роста.

Сегодня. Huawei обостряет торговые переговоры США и Китая. Компания подает в суд на США, утверждая, что запрет их продукции противоречит Конституции США. Также есть заминка по вопросам тарифов после подписания торговой сделки. Официальные лица США хотят иметь возможность повторно внедрить тарифы на китайские товары, если не удастся договориться о механизмах принуждения в отношении краж интеллектуальной собственности и связанных с этим вопросы. Однако, данное условие не устраивает китайскую сторону. Переговоры находятся в «финальной стадии», так как обе стороны планируют провести саммит в конце марта в Мар-а-Лаго, в резиденции Трампа.

Сегодня также пройдет заседание Совета ЕЦБ, на котором будут обсуждать дальнейшие прогнозы ВВП и изменение банковских процентных ставок в Еврозоне. На этом фоне фьючерс S&P 500 тестирует уровень 2767 с крайне низкими объемами.

Межрынок и индикаторы. Уровень \$13,6 защитил VIX от дальнейшего падения. При этом VIX вышел из нисходящего канала, что сигнализирует о повышенной волатильности. Следующие ключевые уровни по VIX, уровень сопротивления - \$18,6. В ближайшие торговые сессии ожидаем роста волатильности.

Фьючерс на нефть марки WTI торгуется в низковолатильном боковике. Фьючерс по золоту также демонстрирует скромное движение, учитывая осторожный тон на рынке США. Индикаторы аппетита к риску HYG/JNK подтверждают осторожное поведение инвесторов на рынке.

Сектора. Все сектора, кроме сектора материалов (+0,22%), закрылись в красной зоне. Хуже рынка были сектор здравоохранения (-1,46%), энергетический сектор (-1,27%), сектора полупроводников (-1,36%) и биотеха (-3%). Инверсные ETF TVIX (+5,4%) и DUST (5,6%) в точности отразили ситуацию на рынке.

Что ждем? Индекс пробил нижнюю границу канала роста и продолжает снижаться. Если продолжение коррекции будут сопровождать объемы выше среднего, то не исключен вариант тестирования защитного уровня 2747. Ключевым моментом будет отчет по безработице США в пятницу и тест уровня 2747. Говорить о завершении коррекции пока рано.

Действия. Удерживаем портфельные позиции, но пока воздерживаемся от новых портфельных 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

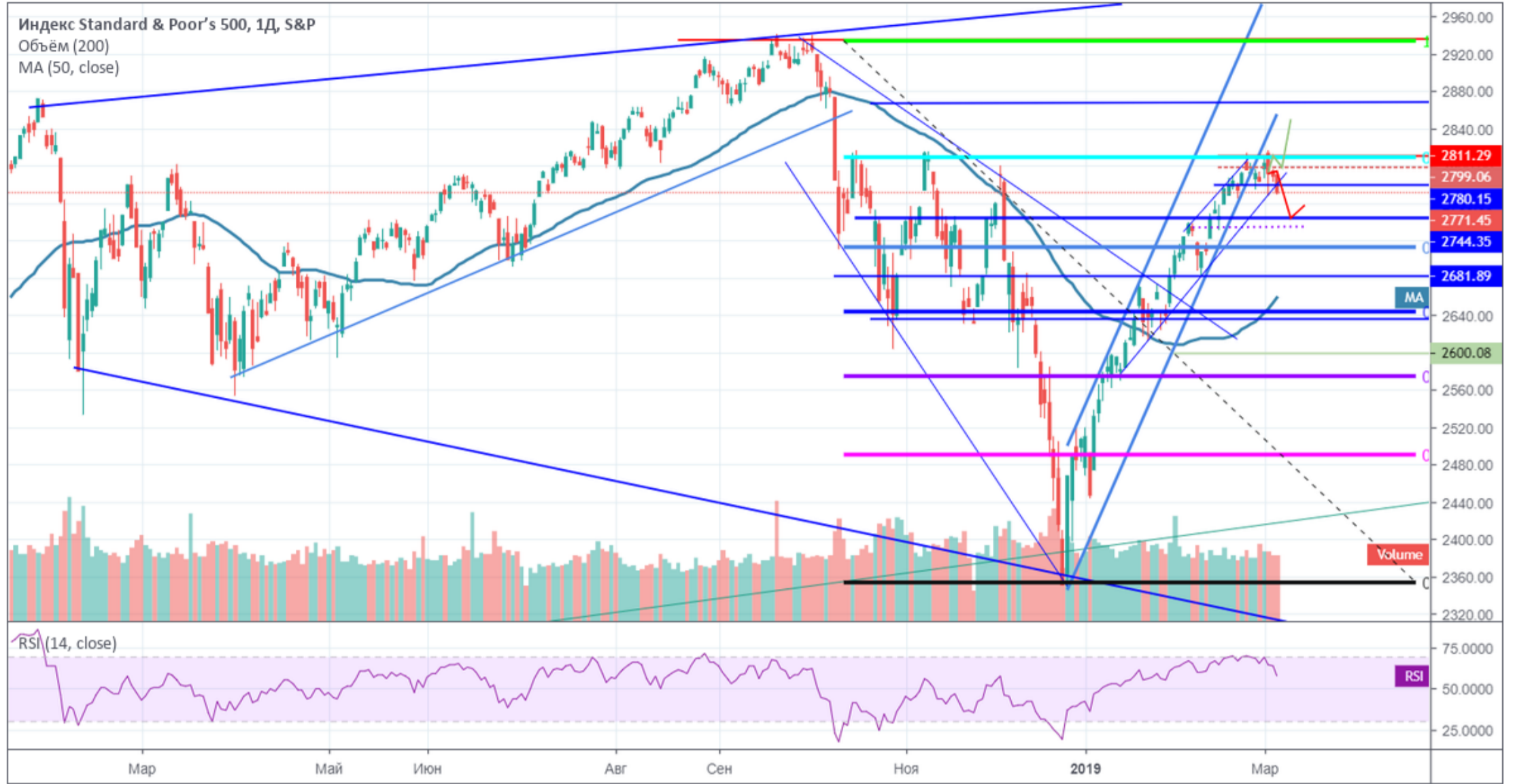
Ключевые темы и новости по рынку:

- (-) Торговый дефицит США вырос в декабре до 10-летнего максимума в \$59,8 млрд, что не оправдало ожидания рынка, несмотря на усилия Трампа по сокращению этого показателя.
- (=) 10 из 12 округов ФРС продемонстрировали незначительный или умеренный экономический рост в конце января и февраля, при этом только Филадельфия и Сент-Луис отчитались нейтрально, согласно отчету ФРС.
- (+) Государственная Шанхайская строительная группа (SCG) поставила приоритетную цель построить в первую очередь завод по производству электромобилей Tesla в Шанхае. Ожидаемый срок завершения строительства в мае этого года.
- (+) BA анонсируют программу нового реактивного самолета среднего класса, что станет первой совершенно новой реактивной программой для крупнейшего в мире авиастроителя за последние десять лет.
- (+) FB не видит путей продвижения в Китае, сообщил источник в компании BuzzFeed. В заметке генерального директора Марка Цукерберга, в которой излагается будущее компании, сказано, что компания будет ориентирована на конфиденциальность.
- (=) Генеральный прокурор США Уильям Барр проведет в четверг форум с руководителями AAPL, MSFT и GOOGL, чтобы попросить о помощи в предотвращении технических мошенничеств, особенно для пожилых людей.
- (=) Турция не вернется к соглашению о покупке систем ПРО С-400 у России. Президент Турции также добавил, что его страна может в последующем заняться покупкой систем С-500.
- (+) MSFT и Invenergy сообщили о запуске нового проекта по производству солнечной энергии. Мощность данного проекта будет составлять 74 мегаватта с расположением в Северной Каролине. Проект обеспечит инвестиции, новые рабочие места и чистую энергию для MSFT.
- (=) Согласно источникам WSJ, AMZN закрывает все 87 POP-UP STORE в США к концу апреля.
- (+) FB создает два новых магистральных волоконно-оптических маршрута в восточной части США. Новые маршруты обеспечат прямую связь между дата-центрами в Огайо, Вирджинии и Северной Каролине. Компания намерена продавать избыточные мощности через новую оптовую дочернюю компанию.
- (=) Инвесторы обеспокоены перспективами сектора биотеха, после внезапного уведомления об отставке комиссара FDA Скотта Готлиба, который был поборником более эффективных действий агентства. Инвесторы надеются увидеть еще одного дружественного для отрасли руководителя от администрации Трампа.

Daily Market Snapshot

Среднесрочный сценарий: начало коррекции, ожидаем тест 2747 и возможно 2712

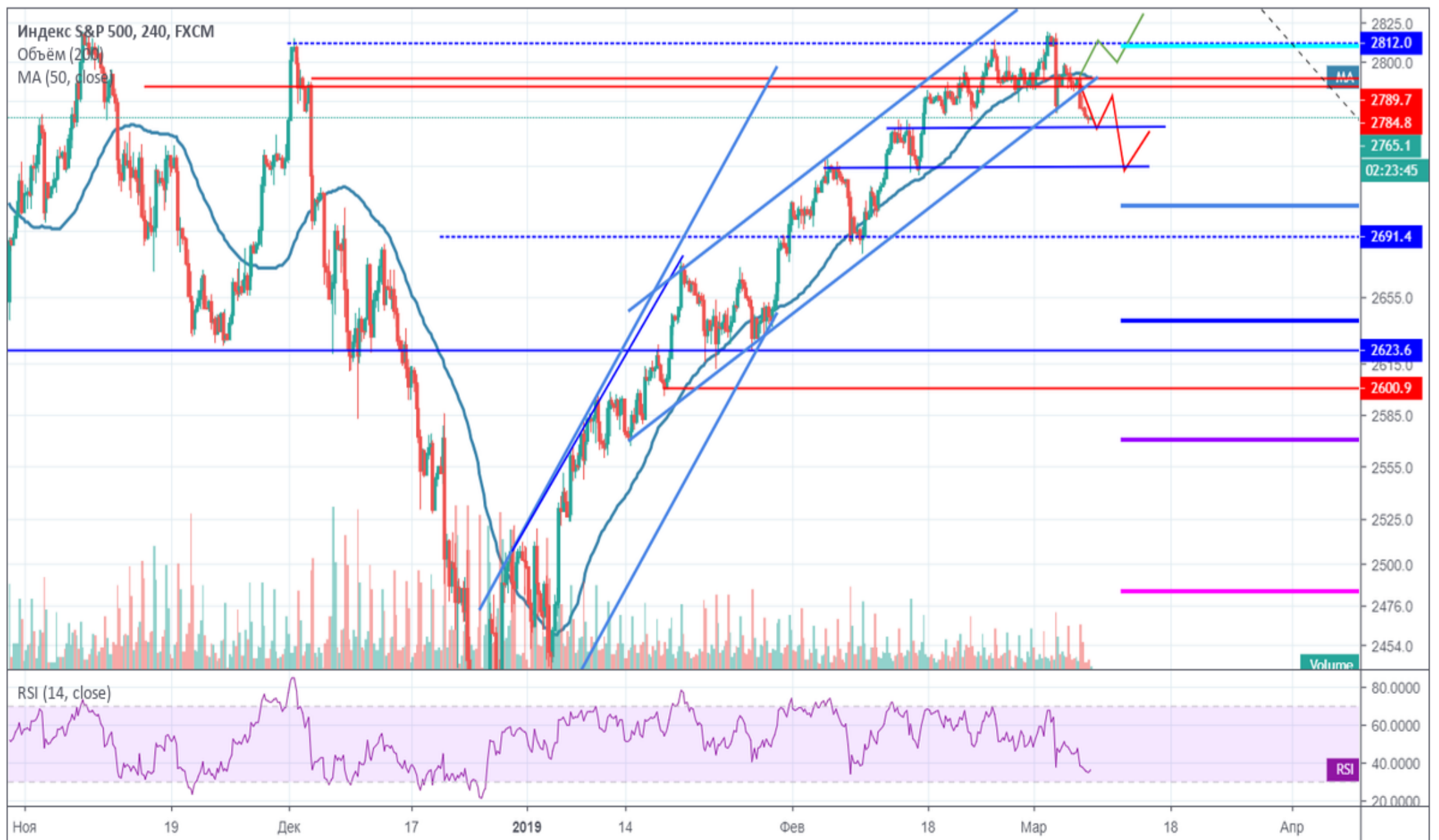
imanalin опубликовал(а) на TradingView.com, Март 07, 2019 14:22:00 +06
 SP:SPX, 1D 2771.45 ▼ -18.20 (-0.65%) O:2790.27 H:2790.27 L:2768.69 C:2771.45



Создано при помощи TradingView

Локальный сценарий: пробой 2767 и далее тестирование 2747.

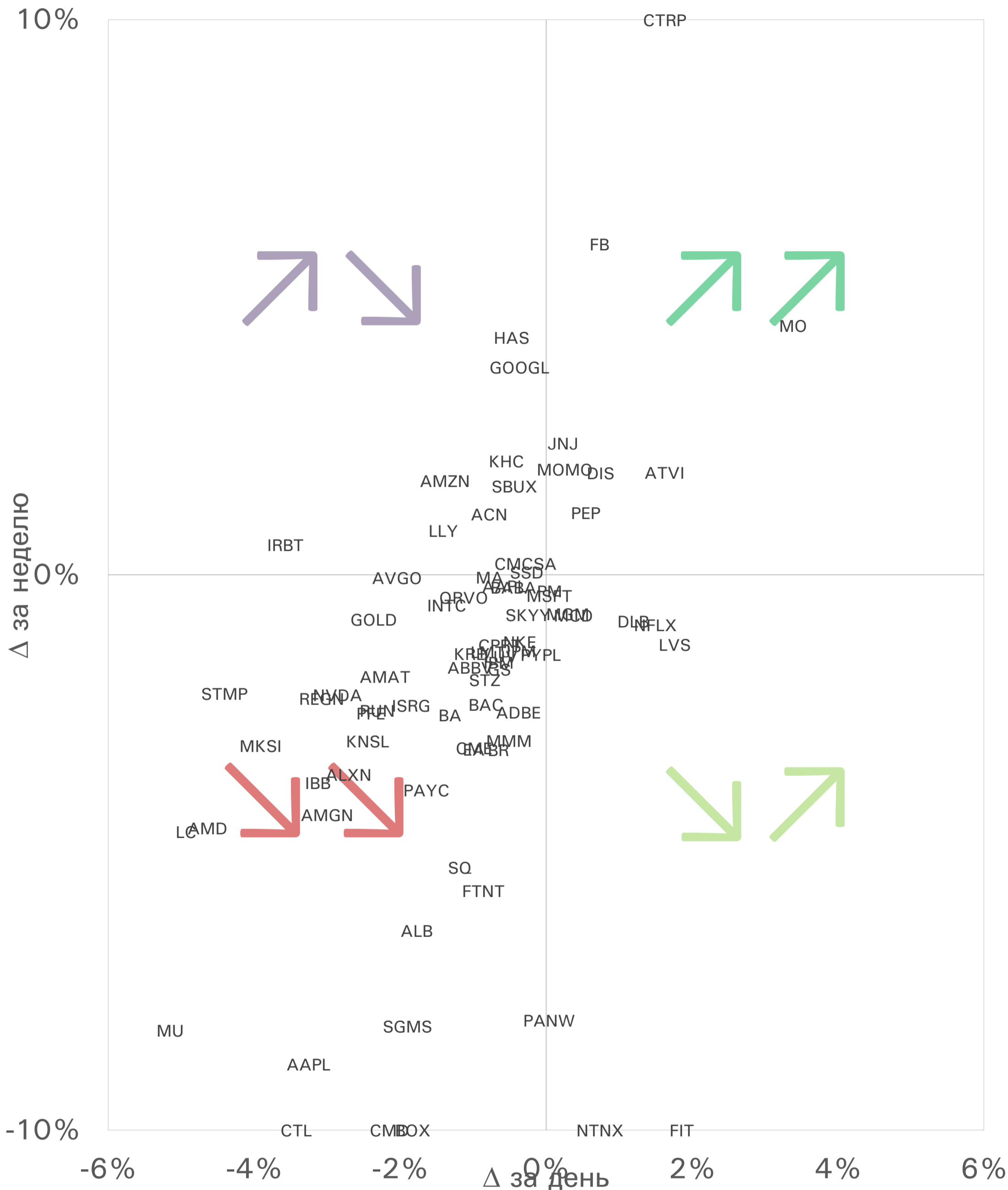
imanalin опубликовал(а) на TradingView.com, Март 07, 2019 17:36:15 +06
 FX:SPX500, 240 2765.1 ▼ -5.6 (-0.2%) O:2763.8 H:2765.9 L:2763.1 C:2765.1



Создано при помощи TradingView

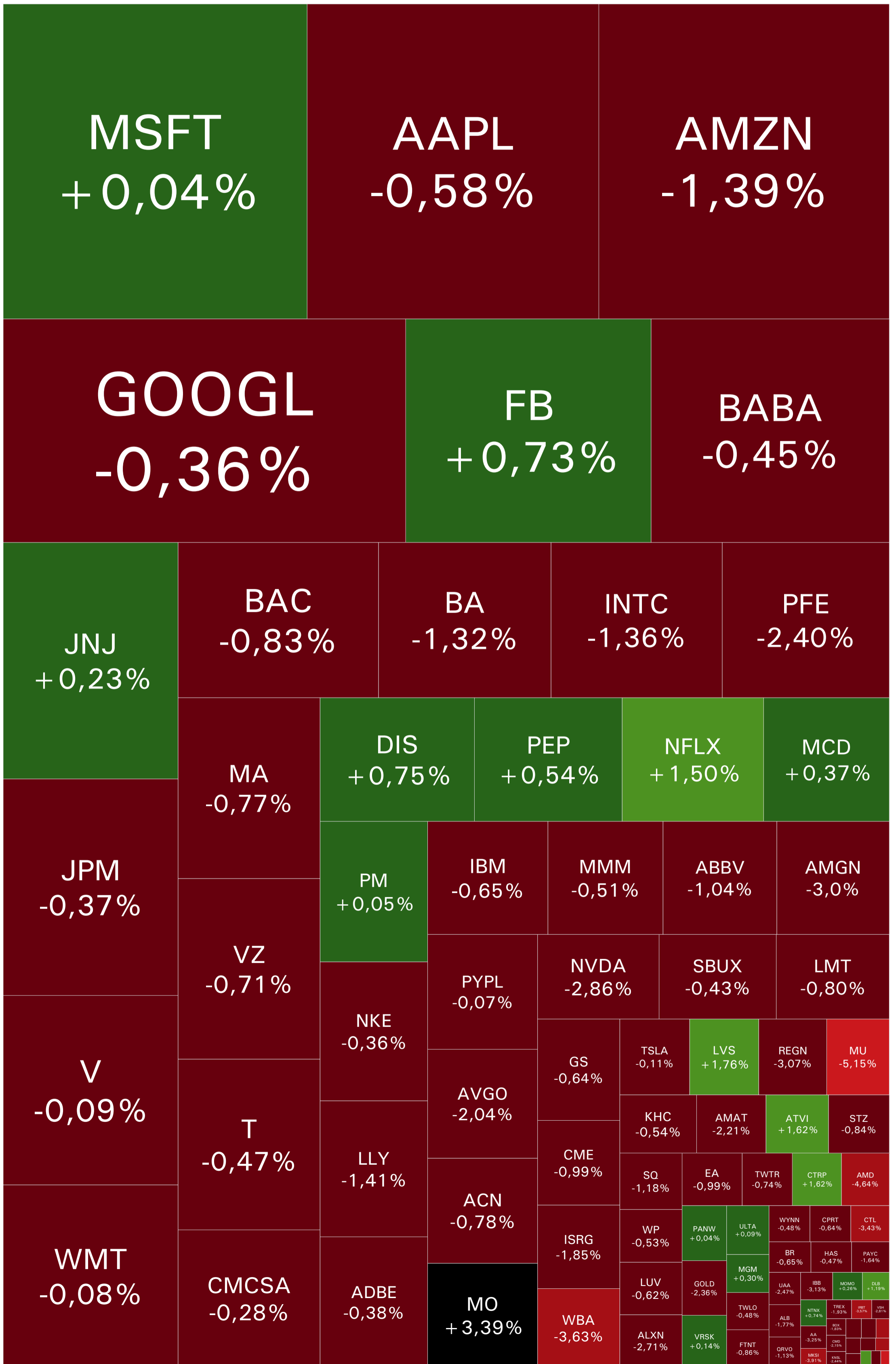
Daily Market Snapshot

Фазы трендов акций: 1 day vs. 1 week



Daily Market Snapshot

Карта рынка за предыдущую торговую сессию



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	45%	43	↘	↘	↘	Cyclical	hold	удерживать есть позитив	ждать	Тестирует локальный канал
AAPL	823	177	1%	61	↘	↘	↘	Cyclical	hold	ждем пробой 176,5	ждать	
ABBV	115	92	18%	38	↘	↘	↘	Speculative Growth	hold	держат до 75,1	ждать	
ACN	104	170	5%	64	↗	↗	↗	Aggressive Growth	hold	Удерживаем	фиксировать	S/L 160
ADBE	125	291	13%	52	↗	↗	↗	Aggressive Growth	hold	по пробую 262	ждать	SL 250
ALB	9	109	27%	53	↗	↗	↘	Cyclical	hold	фиксировать ниже 70	ждать	SL 86
ALXN	29	162	24%	57	↗	↗	↗	Aggressive Growth	hold	-	ждать	S/L 127
AMAT	36	47	25%	47	↘	↘	↗	Cyclical	hold	есть дивергенция, ждем	ждать	SL 36,8
AMD	23	23	3%	45	↘	↘	↗	Cyclical	hold	-	ждать	Тестирует локальный канал
AMGN	114	209	14%	38	↘	↘	↘	Slow Growth	hold	-	ждать	
AMZN	820	2 115	27%	55	↗	↗	↗	Cyclical	hold	по пробую 1721	ждать	S/L 1593
ATVI	33	54	26%	45	↗	↘	↘	Slow Growth	hold	удерживаем	фиксировать	SL на 39,8
AVGO	107	294	8%	49	↗	↗	↗	Cyclical	hold	фиксировать на 271	ждать	SL на 265
BA	240	446	5%	62	↗	↗	↗	Cyclical	hold	удерживаем	фиксировать	SL на 412
BABA	477	205	11%	69	↗	↗	↗	Aggressive Growth	hold	вход по пробую 185	ждать	SL на 179
BAC	279	33	15%	51	↗	↗	↘	Cyclical	hold	вход по пробую 29,7	ждать	SL на 27,9
BOX	3	24	28%	31	↘	↘	↘	Speculative Growth	hold	-	фиксировать	S/L 18,5
BR	11	113	14%	45	↗	↗	↘	Cyclical	hold	интересен	ждать	В канале S/L 98
CMCSA	175	44	15%	60	↗	↗	↗	Classic Growth	hold	вход по пробую 38,8	ждать	В канале S/L 37,8
CMD	3	101	51%	26	↘	↘	↘	Aggressive Growth	hold	удерживать	фиксировать	SL на 70
CME	62	194	11%	39	↘	↘	↗	Cyclical	hold	удерживать	ждать	В нисходящем канале
CPRT	13	62	7%	69	↗	↗	↗	Cyclical	hold	-	ждать	S/L 55,5
CTL	12	15	26%	27	↘	↘	↘	High Yield	sell	слабый отчет, возможное формирование дна	ждать	
CTRP	23	41	-4%	83	↗	↗	↘	Cyclical	hold	интересен	ждать	Интерес
DIS	171	125	9%	61	↗	↗	↗	Classic Growth	hold	-	ждать	В канале роста, S/L 112
DLB	7	75	16%	50	↗	↗	↘	Slow Growth	hold	-	ждать	В канале роста, S/L 63
EA	28	102	7%	49	↗	↗	↘	Classic Growth	hold	по пробую 111 на ограниченный объем	фиксировать	SL на 92,4
FB	492	195	13%	69	↗	↗	↘	Aggressive Growth	hold	удерживаем	фиксировать	SL на 160
FIT	2	7	13%	45	↘	↘	↗	Distressed	hold	-	ждать	S/L 5,5
FTNT	14	86	4%	53	↗	↗	↗	Speculative Growth	hold	-	ждать	SL на 81,7
GOLD	22	14	14%	43	↘	↘	↘	Cyclical	hold	-	ждать	Тестирует канал роста. S/L 11,5
GOOGL	807	1 337	15%	66	↗	↗	↗	Speculative Growth	hold	интересен	фиксировать	SL на 1133
GS	75	230	18%	49	↗	↗	↘	Cyclical	hold	поддержка 169	ждать	SL на 189
HAS	11	97	11%	52	↗	↘	↘	Cyclical	hold	Смотрим	фиксировать	В канале роста, C/I 85
IBB	8	#N/A	-	48	↗	↗	↘	Aggressive Growth	hold	-	ждать	SL на 107
IBM	122	143	4%	56	↗	↗	↗	Slow Growth	hold	Ждем точку входа на 153,9	ждать	-
INTC	238	54	1%	62	↗	↗	↗	Cyclical	hold	на 53 смотреть на пробой	ждать	SL на 51,5
IRBT	3	110	-12%	68	↗	↗	↗	Cyclical	hold	-	фиксировать	SL на 118
ISRG	61	566	6%	50	↗	↗	↗	Speculative Growth	hold	-	ждать	Тестирует канал, S/L 522
JNJ	370	145	4%	69	↗	↘	↘	Slow Growth	hold	Следим	ждать	SL на 135
JPM	340	116	11%	49	↗	↗	↗	Cyclical	hold	ждем 103 как минимум	ждать	Вышел из канала, S/L 100
KHC	40	38	17%	21	↗	↘	↘	Slow Growth	sell	S/L 30	ждать	
KNSL	3	#N/A	-	49	↗	↗	↘	Cyclical	hold	-	ждать	SL на 63
KRE	1	73	-	68	↗	↗	↗	Aggressive Growth	hold	удерживаем	ждать	S/L 53,6
LC	1	4	50%	36	↘	↘	↘	Distressed	hold	ждем пробоя вверх	ждать	ждем 3,43 для спекулятивного входа
LLY	131	124	-2%	63	↗	↗	↗	Classic Growth	hold	-	ждать	SL на 121
LMT	86	340	12%	55	↗	↗	↗	Cyclical	hold	удерживаем, но возможна коррекция	фиксировать	SL на 297
LUV	29	62	18%	42	↘	↘	↘	Cyclical	hold	-	ждать	SL на 52
LVS	47	66	10%	56	↗	↗	↘	High Yield	hold	-	ждать	SL на 57
MA	230	238	6%	66	↗	↗	↗	Cyclical	hold	пробой 225	ждать	SL на 214
MCD	139	199	9%	54	↗	↘	↘	Cyclical	hold	-	ждать	SL на 176
MGM	14	34	27%	42	↘	↘	↘	Cyclical	hold	следим	фиксировать	SL на 26,88
MKSI	4	102	26%	47	↘	↘	↘	Aggressive Growth	hold	удерживаем	ждать	SL на 77
MMM	117	204	1%	47	↗	↗	↘	Cyclical	hold	-	фиксировать	SL на 202
MO	102	57	5%	75	↗	↗	↘	High Yield	hold	изучаем	ждать	SL на 50
MOMO	7	39	11%	65	↗	↗	↘	Speculative Growth	hold	изучаем	ждать	SL на 30
MSFT	857	126	13%	62	↗	↗	↗	Classic Growth	hold	-	ждать	
MU	43	47	24%	41	↘	↘	↘	Cyclical	hold	-	фиксировать	SL на 37
NFLX	157	393	9%	58	↗	↗	↗	Aggressive Growth	hold	ждем пробоя 380	фиксировать	SL на 347
NKE	134	88	3%	58	↗	↗	↗	Cyclical	hold	удерживаем	ждать	
NTNX	6	48	41%	17	↘	↘	↘	Speculative Growth	sell	S/L 32	фиксировать	S/L 32
NVDA	92	177	16%	48	↗	↗	↘	Cyclical	hold	-	ждать	В канале роста, S/L 139
PANW	22	281	20%	57	↗	↗	↗	Speculative Growth	hold	держат	ждать	S/L 217
PAYC	10	174	-1%	59	↗	↗	↗	Aggressive Growth	hold	-	ждать	S/L 163
PEP	164	119	2%	64	↗	↗	↗	Slow Growth	hold	-	ждать	S/L 113
PFE	232	46	9%	44	↗	↘	↘	Slow Growth	hold	-	фиксировать	S/L 41
PM	135	89	2%	73	↗	↗	↘	High Yield	hold	-	ждать	S/L 83
PYPL	113	102	5%	59	↗	↗	↗	Cyclical	hold	-	ждать	Тестирует канал, S/L 93
QRVO	8	71	3%	61	↗	↗	↘	Cyclical	hold	-	ждать	В канале роста, скоро будет тест S/L 67.
REGN	46	426	1%	52	↗	↗	↗	Aggressive Growth	hold	-	ждать	Вышел из канала, S/L 406
RUN	2	19	24%	57	↗	↗	↗	Distressed	hold	-	ждать	Вышел из канала, S/L 14,5
SBUX	89	70	-2%	64	↗	↗	↗	Cyclical	hold	-	ждать	В канале роста, S/L 68
SGMS	3	34	26%	57	↗	↗	↘	Cyclical	hold	-	ждать	Вышел из канала, S/L 24,5
SKYY	2	#N/A	-	64	↗	↗	↗	Aggressive Growth	hold	-	ждать	Вышел из канала, S/L 55
SQ	32	82	9%	52	↗	↗	↗	Speculative Growth	hold	-	ждать	S/L 69
SSD	3	67	12%	51	↗	↗	↗	Cyclical	hold	-	ждать	S/L 58
STMP	2	120	33%	25	↘	↘	↘	Aggressive Growth	sell	фиксировать на 80	фиксировать	
STZ	32	208	26%	43	↘	↘	↘	Classic Growth	hold	-	ждать	Тестирует канал, S/L 160
T	217	35	16%	41	↗	↘	↘	High Yield	hold	покупать на 32 как защитную бумагу	ждать	Вышел из канала, S/L 29
TREX	4	80	10%	47	↗	↗	↗	Cyclical	hold	-	ждать	Вышел из канала, S/L 70
TRVG	2	6	21%	38	↗	↘	↘	Cyclical	sell	фиксировать на 4,7	фиксировать	S/L 4,7
TSLA	48	326	18%	36	↘	↘	↘	Cyclical	hold	-	ждать	S/L 245
TWLO	14	125	9%	53	↗	↗	↗	Speculative Growth	hold	-	ждать	S/L 104
TWTR	24	33	8%	46	-	-	↘	Speculative Growth	hold	-	фиксировать	Треугольник, S/L 28
UAA	9	21	-4%	53	↗	↘	↘	Cyclical	hold	-	ждать	Тестирует канал, S/L 21
ULTA	19	318	2%	67	↗	↗	↗	Cyclical	hold	-	ждать	S/L 288
V	297	162	10%	65	↗	↗	↗	Cyclical	hold	удерживаем	ждать	S/L 143
VRSK	21	127	1%	70	↗	↗	↗	Cyclical	hold	удерживаем	ждать	Дивер, S/L 123
VSH	3	25	21%	44	↘	↘	↗	Cyclical	hold	удерживаем	фиксировать	S/L 20
VZ	230	59	7%	48	↗	↘	↘	High Yield	hold	точка входа на 58,5	ждать	S/L 53
WBA	58	75	23%	21	↘	↘	↘	Aggressive Growth	hold	-	фиксировать	S/L 59
WMT	285	109	11%	52	↗	↗	↗	Slow Growth	hold	-	ждать	S/L 95
WP	30	109	15%	67	↗	↗	↗	Cyclical	hold	точка входа на 97,5	ждать	S/L 90,6
WYNN	13	139	12%	49	↘	↘	↘	Cyclical	hold	-	фиксировать	S/L 115
XLRN	2	62	40%	52	↗	↗	↘	Distressed	hold	-	ждать	S/L 42