

US Daily: голосование по Brexit, возможна волатильность

Индекс продолжил рост и закрепился выше 2780, однако VIX подошел к глобальной поддержке...



Во вторник. Отчет по февральскому индексу потребительских цен, которой так же показывает уровень потребительской инфляции, был лучше ожидаемого. Данные составили 1,5% вместо ожидаемых 2,2%, что увеличивает вероятность того что ФРС и дальше будет придерживаться своей мягкой денежно-кредитной политики. На этом фоне индекс демонстрирует рост закрывшись выше уровня 2890.

Сегодня. В 8:30 AM выйдут данные по товарам длительного пользования и данные по заказам на основные товары, не относящихся к обороне. Участники рынка часто рассматривают данные отчеты как показатель отражающий дальнейшие расходы на бизнес. На этом фоне фьючерс продолжает низковолатильное движение и тестирует уровень 2790. Британский парламент с преимуществом в 149 голосов проголосовал против сделки премьера Мэй по выходу Великобритании из ЕС. Сегодня парламент проведет голосование за выход из ЕС без сделки. Если парламент проголосует за сделку, то уже в четверг будет очередное голосование относительно переноса срока выхода из ЕС, который на данный момент назначен на 29 марта.

Межрынок и индикаторы. Индикаторы JNK/HYG продолжают показывать рост аппетита к риску. VIX (-3,9%) снизился до уровня \$13,6, под этим уровнем проходит глобальная поддержка, которая может стать фактором в росте волатильности. Фьючерс по золоту, на фоне опасений по Brexit и ослабления доллара, продолжает восходящее движение (+0,2%), при этом психологический уровень в \$1300 уже пробит. Ближайшее сопротивление на фибо-уровне в районе \$1311. Фьючерс на нефть марки WTI продолжает торговаться в боковике, уровень сопротивления \$59,4, уровень поддержки \$55,5. В целом межрыночные индикаторы пока указывают на «бычий» сценарий.

Сектора. Большинство секторов закрылись в плюсе. Лучше рынка были сектора здравоохранения (+0,73%) и сектор коммунальных услуг (+0,7%). По сектору коммунальных услуг мы наблюдаем медвежью дивергенцию. На фоне давления со стороны ВА, хуже рынка был индустриальный сектор (-0,8%). Из отдельных компаний стоит отметить HPE (-3,7%), по которой инвестдом UBS урезал прогнозы прибыли на 2019 год и снизил свою целевую цену с \$17 до \$13.

Что ждем? Рост с начала недели выводит фьючерс на S&P 500 к уровню 2817 - это предыдущий максимум и если он будет пробит откроется цель в 2869 (+1,8%).

Однако если индексу не удастся пробить уровень 2800 в ближайшее время, то ключевым уровнем поддержки будет 2764.

Действия. Формировать новые среднесрочные портфельные позиции согласно списку 'buy' в таблице среднесрочных идей.

Защита. В случае пробоя 2764 на объеме выше среднего готовимся открывать позиции в инверсных ETF TVIX, SQQQ, SDS.

Среднесрочно | BUY LIST*:

AAPL, ADBE, AMZN, BABA, BAC, CMCSA, FB, GOOGL, ISRG, LMT, LVS, MSFT, NFLX, NKE, PANW

Среднесрочно | SELL LIST:

Локально | BUY LIST:

Локально | FIX LIST:

AA, ACN, ALB, ATVI, BOX, CMD, EA, MGM, MU, NTNX, SGMS, STMP

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

Ключевые темы и новости по рынку:

- (=) Ожидается, что компании с более чем половиной продаж, произведенных за рубежом, в первом квартале 2019 года сократят прибыли на 11,2%, сообщает FactSet.
- (+) Согласно данным отчета CoreLogic Loan Performance Insights, процентная доля ипотечных кредитов в США, находящихся на определенной стадии просроченной задолженности, снизилась до 4,1% в декабре 2018 года, что на 1,2 процентных пункта меньше, чем годом ранее.
- (=) TSLA увольняет около 150 человек из своей глобальной команды по подбору персонала в попытке сократить расходы.
- (-) Times of India сообщает, что правительство Индии предупреждает TWTR о том, что ее руководителям могут грозить годы тюремного заключения, если ей не удастся удалить «нежелательный и подстрекательский контент».
- (=) KHC хочет продать свой бренд Blackstone (производит творог, масло и сметану). Blackstone's, чья выручка составляет около \$400 млн и прибыль \$50 млн до вычета процентов, налогов, износа и амортизации, может оцениваться в \$400 миллионов долларов.
- (+) GS планирует открыть особую группу, один из своих самых прибыльных бизнесов, для внешних инвесторов. До сих пор группа инвестировала собственные средства банка в такие предприятия, как азиатская недвижимость, африканские стартапы и непростые ритейлеры США.
- (=) Бюджет президента Трампа на 2020 год включает в себя целый ряд инициатив, направленных на снижение цен на лекарства.
- (+) Аналитик Гарри Кертис и его команда из Nomura Instinet видят потенциал для роста MGM после недавнего падения цены. Рейтинг buy и целевую цену в \$36 (потенциал роста +34%).
- (=) MO, PM, VTI. Новой главой FDA назначен Норман Шарплесс. Учитывая его опыт, инвесторы ожидают, что он будет критически следить за употреблением табака и электронных сигарет, особенно среди молодежи.
- (+) PYPL представляет услугу, которая позволяет клиентам быстрее переводить деньги в свой банк и ожидает, что он будет доступен для американских предприятий "в ближайшие недели", а международная экспансия видится в «ближайшем будущем».
- (=) Cambia Health Solutions и Blue Cross из Северной Каролины объединят свои управления в единую структуру, которая сохранит название Cambia. Новое объединение будет охватывать более 6 миллионов человек и приносит доход в размере около \$16 млрд.
- (=) FB разрабатывает собственную цифровую валюту, известную как Facebook Coin, которая будет привязана к доллару США и позволит пользователям переводить деньги через приложение для обмена сообщениями, принадлежащее Facebook и WhatsApp.
- (-) FFIV (-7,7%), на фоне приобретения компании Nginx за \$670 млн и понижения рекомендации от JP Morgan с «выше рынка» до «нейтрального».

Daily Market Snapshot

Среднесрочный сценарий: Тестирование 2812 и выход на 2867

imanalin опубликовал(а) на TradingView.com, Март 13, 2019 14:27:36 +06
SP:SPX, 1D 2791.52 ▲ +8.22 (+0.3%) O:2787.34 H:2798.32 L:2786.73 C:2791.52



Создано при помощи TradingView

Локальный сценарий: закрепление за 2800 и тестирование 2812

imanalin опубликовал(а) на TradingView.com, Март 13, 2019 14:29:58 +06
FX:SPX500, 240 2792.2 ▼ -1.5 (-0.06%) O:2787.3 H:2792.3 L:2786.7 C:2792.2



Создано при помощи TradingView

Daily Market Snapshot

Фазы трендов акций: 1 day vs. 1 week



Daily Market Snapshot

Карта рынка за предыдущую торговую сессию



