

US Daily: американский рынок на новом максимуме

Рынок дошел до максимума 2817 на фоне сильных макро данных, ждем 2843 и 2869 если закрепимся



В среду. Британские законодатели отвергли идею оставить Европейский Союз без сделки по Brexit, сегодня пройдет важное голосование по вопросу о том, следует ли продлить официальную дату выхода. Вышел ряд важных макро данных: Затраты на строительство в январе: +1,3% против ожидаемых +0,3%; Товары длительного пользования в январе: +0,4% против ожидаемых -0,6%, что показывает увеличение спроса и рост новых заказов у отечественных производителей. Благодаря позитивным данным индекс преодолел психологическую отметку в 2800 пунктов и смог закрыться на уровне сопротивления 2810.

Сегодня. В 18:30 по времени Алматы, выйдут ряд важных экономических данных. Заявки на пособие по безработице и цены на импорт/экспорт. Цены на импорт/экспорт указывают на инфляционные тенденции в международных товарах. Заявки на пособие по безработице указывают на изменение условий рынка труда. Тенденция к увеличению заявок предполагает ухудшение рынка труда.

На этом фоне фьючерс продолжает низковолатильное движение и торгуется выше уровня 2812, однако при этом демонстрирую медвежью дивергенцию на H4.

Важные отчеты на сегодня: До открытия рынка Dollar General (DG), Broadcom (AVGO), DocuSign (DOCU). После закрытия рынка будет отчитываться Oracle (ORCL), Adobe (ADBE) и Ulta (ULTA).

Межрынок и индикаторы. Межрыночные индикаторы показывают немного смешанную картину – в то время как волатильность возможно готова показать временный всплеск на фоне того как фьючерс тестирует максимум остальные индикаторы смотрятся по бычьей. VIX (-2,6%) снизился до уровня \$13,4. В ходе торгов VIX тестировал свою глобальную поддержку в районе \$13,3, при этом есть признаки бычьих дивергенций на малых тайм-фреймах (H1 и ниже). Фьючерс по золоту, на фоне снижения напряженности по Brexit скорректировался (-0,4%). Фьючерс на нефть марки WTI показал рост, пробив локальный уровень сопротивления в \$57,5. В целом индикаторы добавляют уверенности в бычий сценарий, но VIX вносит интригу в возможность пробить уровень по индексу сегодня.

Сектора. Все закрылись в плюсе. Лучше рынка были сектора здравоохранения (+1,1%) и энергетический сектор (+1%). Акции BA (+0,5%) находятся под давлением продавцов. При этом уровень \$370 удержан благодаря аномально высоким объемами со стороны инвесторов.

Что ждем? Рост индекса и пробой 2810 на фоне позитивных макро данных, открывает потенциал до уровней 2843 – 2869 пунктов. Однако, близость VIX к поддержке и короткая дивергенция по фьючерсу перед открытием может вызвать волатильность сегодня. Не исключен сценарий некоторого флэта под уровнем 2817 если сегодня не удастся закрепиться выше.

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, 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:

(=) Президент Трамп заявил в среду, что не торопится заключать торговый договор с Китаем, и настаивает на том, чтобы любая сделка включала защиту интеллектуальной собственности, которая является основным камнем преткновения между двумя сторонами в течение месяцев переговоров.

(=) Бывший экономический советник Белого дома Гэри Кон выступил в радиоинтервью с бывшими коллегами Питером Наварро и министром торговли Уилбуром Россом. Бывший руководитель GS раскритиковал Питера Наварро за вовлечение страны в неверно направленную тарифную битву.

(=) Трамп, выполнив одно из своих самых противоречивых предвыборных обещаний, подписал 8 марта две декларации, которые вводят тарифы на импортируемую сталь и алюминий, но освобождают Канаду и Мексику от налогов.

(-) В среду Федеральное авиационное управление США издало чрезвычайный приказ о выводе из эксплуатации самолетов Boeing 737 Max 8.

(+) Новые солнечные установки в США вырастут на 14% в этом году до 12,1 ГВт благодаря сниженным ценам на оборудование, которые помогли оживить несколько отложенных проектов. Потенциально тикеры FSLR, CSIQ, JKS, ENPH, SPWR, SEDG, VSLR, RUN, DQ.

(=) AAPL приобрела стартап машинного обучения Laserlike, который может усилить усилия технического гиганта в области ИИ. Laserlike создала приложение, которое использовало AI для персонализации новостной ленты пользователя.

(-) Некоторые из продуктов FB испытывают частичные перебои в работе, так как пользователи по всему миру сообщают о проблемах при входе и размещении на сайте, а также в Instagram и WhatsApp.

(-) Суд в Калифорнии постановил JNJ выплатить \$29 млн женщине, которая утверждала, что асбест в продуктах компании на основе талька вызвал ее рак.

(=) IBM и Министерство юстиции США договариваются о временном соглашении относительно приобретения Red Hat.

(+) Citi рассматривает день инвестора NVDA 19 марта как потенциальный катализатор, который «поможет улучшить показатели роста» после нескольких месяцев слабости.

(=) 38 компаний собираются участвовать в аукционе 5G на частоте 24 ГГц, включая AT & T, VZ, TMUS, USM и Windstream (WINMQ).

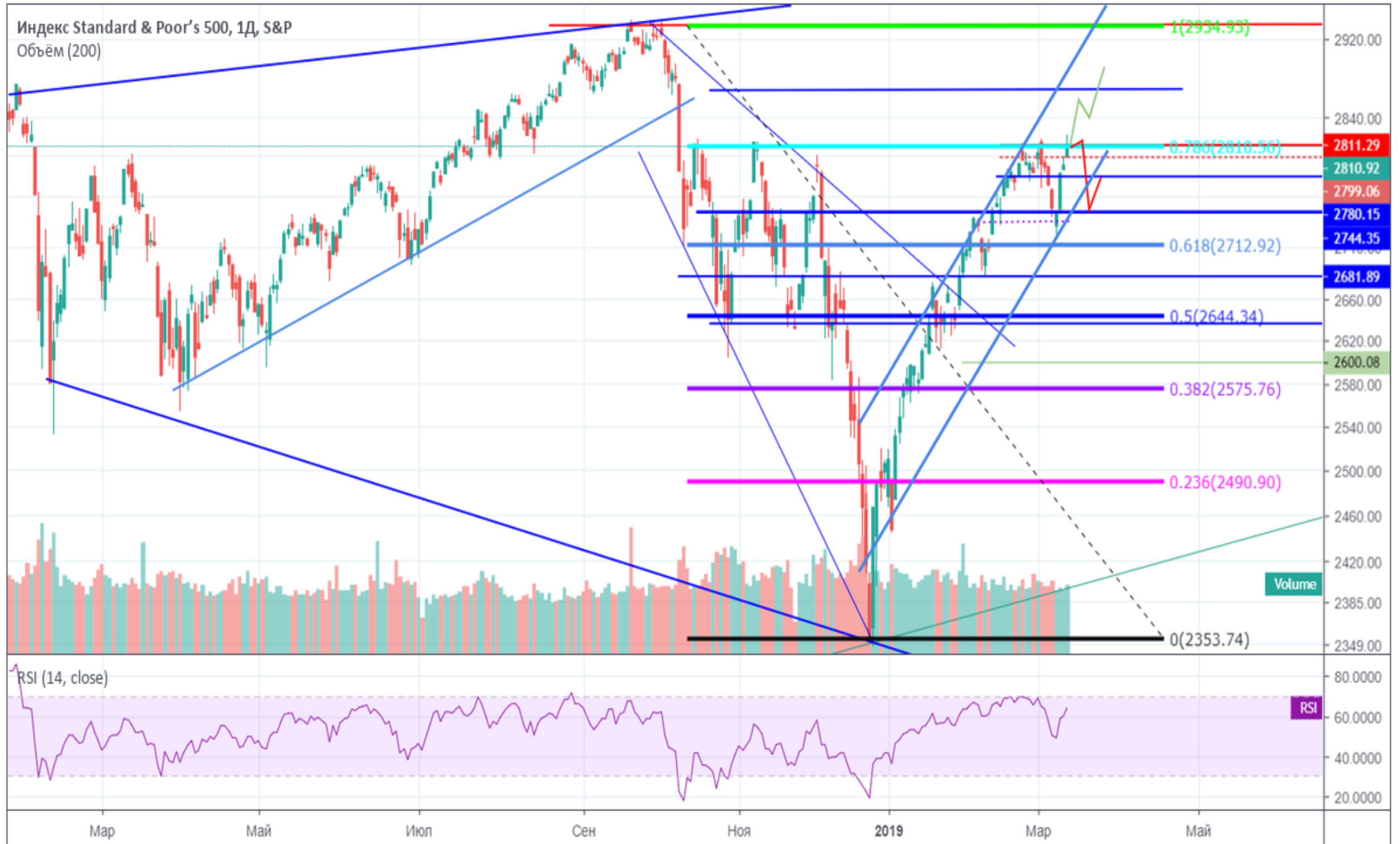
(-) APPL. Согласно данным Китайской академии информационных и коммуникационных технологий, поставки мобильных телефонов в Китае в феврале составили 14,5 млн, что на 20% ниже, чем в предыдущем году.

(+) YEXT запускает четыре интеграции с облаком ADBE Experience Cloud, чтобы помочь предприятиям использовать сохраненные в Yext данные бренда для веб-сайтов, мобильных приложений, электронной почты и IoT.

Daily Market Snapshot

Среднесрочный сценарий: закрепление за 2847 и тестирование 2867

imanalin опубликовал(а) на TradingView.com, Март 14, 2019 13:35:45 +06
 SP:SPX, 1D 2810.92 ▲ +19.40 (+0.69%) O:2799.78 H:2821.24 L:2799.78 C:2810.92



Создано при помощи TradingView

Локальный сценарий: закрепление за 2812 и возможный рост волатильности

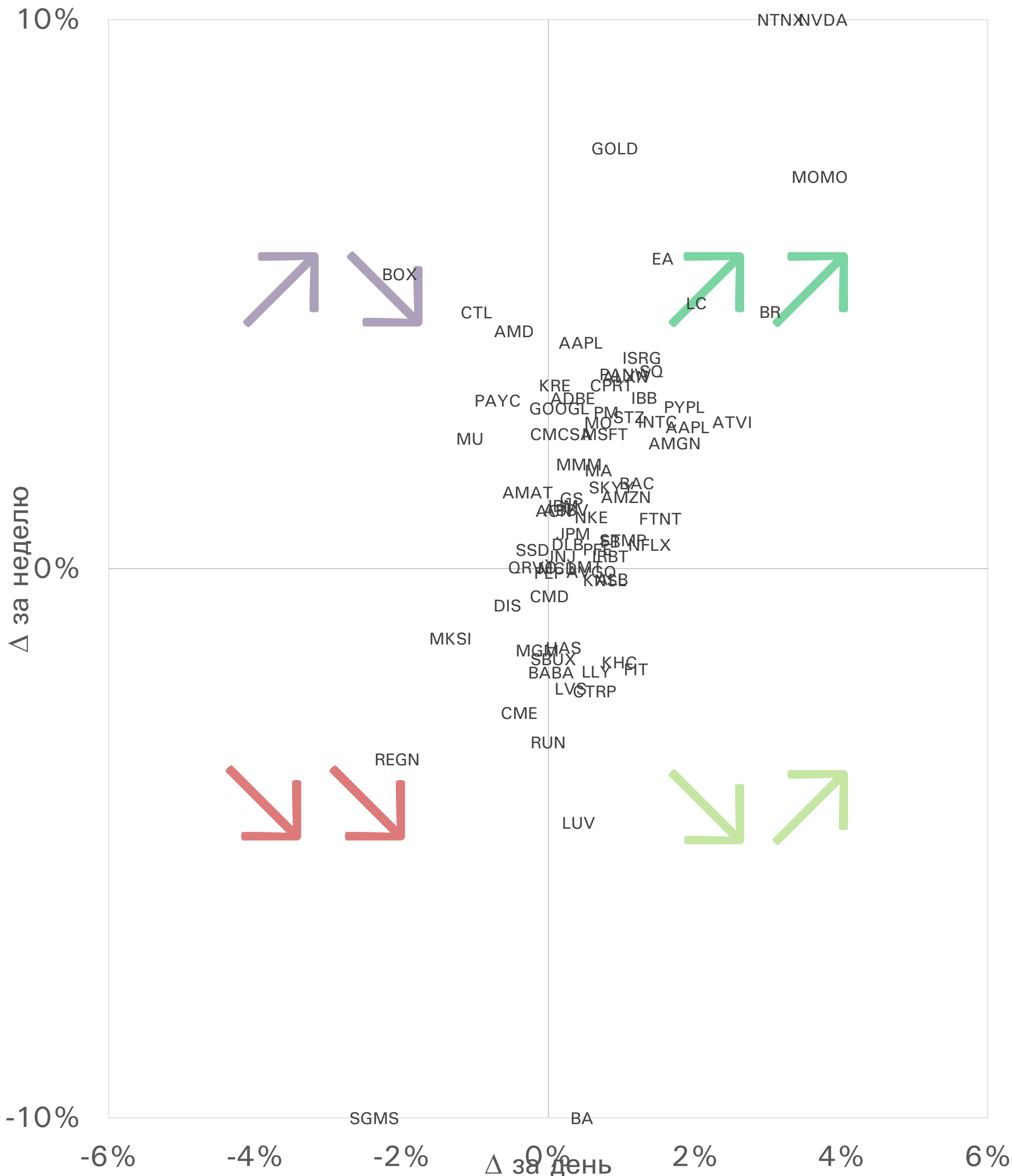
imanalin опубликовал(а) на TradingView.com, Март 14, 2019 13:33:55 +06
 FX:SPX500, 240 2811.3 ▼ -4.3 (-0.15%) O:2810.5 H:2812.6 L:2810.1 C:2811.3



Создано при помощи TradingView

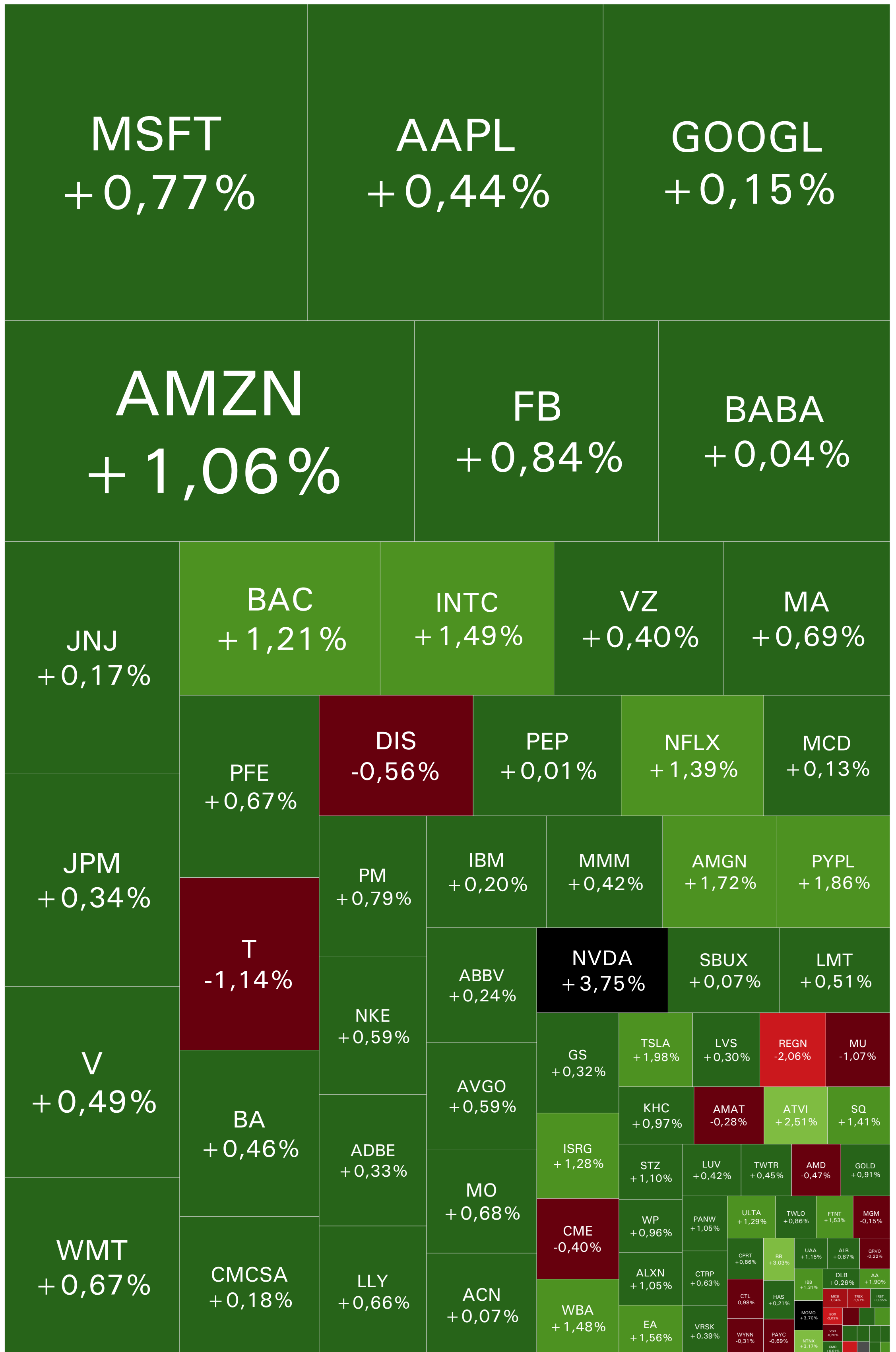
Daily Market Snapshot

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	41%	51	↗	↗	↘	Cyclical	hold	удерживать есть позитив	фиксировать	пробил локальный канал, SL 25
AAPL	857	178	-2%	70	↗	↗	↗	Cyclical	buy	Покупаем в портфель	ждать	
ABBV	116	92	16%	45	↘	↘	↘	Speculative Growth	hold	держат до 75,1	ждать	
ACN	105	170	4%	67	↗	↗	↗	Aggressive Growth	hold	удерживаем	фиксировать	SL 160
ADBE	129	291	10%	64	↗	↗	↗	Aggressive Growth	buy	покупать на 270	ждать	SL 250
ALB	9	109	27%	53	↘	↗	↘	Cyclical	hold	фиксировать ниже 70	фиксировать	SL 80
ALXN	30	162	19%	63	↗	↗	↗	Aggressive Growth	hold	-	ждать	SL 127
AMAT	37	47	23%	51	↘	↘	↘	Cyclical	hold	есть дивергенция, ждем	ждать	SL 36,8
AMD	24	23	-1%	54	↗	↗	↗	Cyclical	hold	-	ждать	тестирует локальный канал
AMGN	117	209	11%	49	↗	↗	↘	Slow Growth	hold	-	ждать	
AMZN	831	2 115	25%	58	↗	↗	↗	Cyclical	buy	-	ждать	SL 1593
ATVI	33	54	23%	52	↘	↘	↘	Slow Growth	hold	удерживаем	фиксировать	SL на 39,8
AVGO	107	294	8%	50	↘	↘	↗	Cyclical	hold	-	ждать	SL на 265
BA	213	440	17%	32	↘	↘	↗	Cyclical	hold	-	ждать	SL на 412
BABA	468	206	14%	59	↗	↗	↘	Aggressive Growth	buy	покупать	ждать	SL на 179
BAC	282	33	13%	58	↗	↗	↘	Cyclical	buy	вход по пробую 29,7	ждать	SL на 27,9
BOX	3	24	20%	41	↘	↘	↗	Speculative Growth	hold	-	фиксировать	SL 18,5
BR	12	113	10%	62	↗	↗	↘	Cyclical	hold	интересен	ждать	в канале SL 98
CMCSA	179	45	12%	67	↗	↗	↗	Classic Growth	buy	вход по пробую 39,8	ждать	в канале SL 37,8
CMD	3	101	51%	29	↘	↘	↘	Aggressive Growth	hold	удерживать	фиксировать	SL на 70
CME	61	194	14%	32	↘	↘	↗	Cyclical	hold	удерживать	ждать	SL на 170
CPRT	14	62	3%	76	↗	↗	↗	Cyclical	hold	-	ждать	SL 55,5
CTL	13	14	20%	36	↘	↘	↘	High Yield	hold	слабый отчет, возможное формирование дна	ждать	
CTRP	23	41	-1%	71	↘	↘	↘	Cyclical	hold	интересен	ждать	интересен
DIS	170	125	9%	55	↗	↗	↗	Classic Growth	hold	-	ждать	В канале роста, SL 112
DLB	7	75	16%	52	↗	↘	↘	Slow Growth	hold	-	ждать	В канале роста, SL 63
EA	30	102	2%	57	↘	↘	↘	Classic Growth	hold	по пробую 111 на ограниченный объем	фиксировать	SL на 92,4
FB	495	196	13%	67	↗	↗	↘	Aggressive Growth	buy	покупать	ждать	SL на 160
FIT	1	7	15%	45	↘	↘	↗	Distressed	hold	-	ждать	SL 5,5
FTNT	14	86	3%	55	↗	↗	↗	Speculative Growth	hold	-	ждать	SL на 81,7
GOLD	23	14	7%	58	↗	↘	↘	Cyclical	hold	-	ждать	тестирует канал роста. SL 11,5
GOOGL	831	1 338	12%	71	↗	↗	↗	Speculative Growth	buy	покупать	ждать	SL на 1133
GS	76	230	17%	55	↗	↗	↗	Cyclical	hold	поддержка 169	ждать	SL на 189
HAS	11	97	12%	47	↘	↘	↘	Cyclical	hold	-	ждать	в канале роста, SL 85
IBB	8	#N/A	-	57	↗	↗	↘	Aggressive Growth	hold	-	ждать	SL на 107
IBM	123	143	3%	60	↗	↗	↘	Slow Growth	hold	ждем точку входа на 153,9	ждать	-
INTC	245	54	-1%	69	↗	↗	↗	Cyclical	hold	на 53 смотреть на пробой	ждать	SL на 51,5
IRBT	3	110	-12%	66	↗	↗	↗	Cyclical	hold	-	ждать	SL на 118
ISRG	64	566	2%	61	↗	↗	↗	Speculative Growth	buy	-	ждать	Тестирует канал, SL 522
JNJ	371	145	4%	67	↗	↗	↗	Slow Growth	hold	следим	ждать	SL на 135
JPM	342	116	11%	53	↗	↗	↘	Cyclical	hold	ждем 103 как минимум	ждать	вышел из канала, SL 100
KHC	39	38	19%	23	↘	↘	↘	Slow Growth	hold	-	ждать	SL 30
KNSL	3	#N/A	-	50	↘	↘	↘	Cyclical	hold	-	ждать	SL на 63
KRE	1	73	-	75	↗	↗	↗	Aggressive Growth	hold	удерживаем	ждать	SL 53,6
LC	1	4	43%	47	↘	↘	↘	Distressed	hold	ждем пробоя вверх	ждать	ждем 3,43 для спекулятивного входа
LLY	129	125	1%	54	↘	↗	↗	Classic Growth	hold	-	ждать	SL на 121
LMT	86	341	12%	54	↗	↗	↘	Cyclical	hold	удерживаем, но возможна коррекция	ждать	SL на 297
LUV	28	63	24%	33	↘	↘	↘	Cyclical	hold	-	ждать	SL на 52
LVS	46	66	12%	47	↘	↘	↘	High Yield	buy	по пробую 62,4	ждать	SL на 57
MA	234	239	5%	69	↗	↗	↗	Cyclical	hold	пробой 225	ждать	SL на 214
MCD	139	199	9%	54	↗	↘	↘	Cyclical	hold	-	ждать	SL на 176
MGM	14	34	29%	39	↘	↘	↘	Cyclical	hold	-	фиксировать	SL на 26,88
MKSI	4	102	28%	46	↘	↘	↘	Aggressive Growth	hold	удерживаем	ждать	SL на 77
MMM	119	204	-1%	55	↗	↗	↘	Cyclical	hold	-	ждать	SL на 202
MO	105	57	2%	78	↗	↗	↘	High Yield	hold	изучаем	ждать	SL на 50
MOMO	8	44	15%	68	↗	↗	↗	Speculative Growth	hold	изучаем	ждать	SL на 30
MSFT	878	126	10%	68	↗	↗	↗	Classic Growth	buy	по пробую 116	ждать	
MU	44	47	22%	46	↘	↘	↘	Cyclical	hold	-	фиксировать	SL на 37
NFLX	158	392	9%	57	↗	↗	↗	Aggressive Growth	buy	по пробую 380	ждать	SL на 347
NKE	135	87	2%	60	↗	↗	↗	Cyclical	buy	по пробую 86	ждать	
NTNX	7	48	25%	36	↘	↘	↘	Speculative Growth	hold	S/L 32	фиксировать	SL 32
NVDA	102	176	4%	66	↗	↗	↘	Cyclical	hold	следить за уровнями 163-176	ждать	в канале роста, SL 139
PANW	23	281	16%	64	↗	↗	↗	Speculative Growth	buy	покупать	ждать	SL 217
PAYC	11	174	-4%	64	↗	↗	↗	Aggressive Growth	hold	-	ждать	SL 163
PEP	164	119	2%	61	↘	↗	↗	Slow Growth	hold	-	ждать	SL 113
PFE	233	46	8%	48	↗	↘	↘	Slow Growth	hold	-	ждать	зафиксирован по SL
PM	139	90	0%	77	↗	↗	↘	High Yield	hold	-	ждать	SL 83
PYPL	117	102	2%	68	↗	↗	↗	Cyclical	hold	-	ждать	вышел из канала, SL 92,5
QRVO	8	71	3%	59	↗	↗	↘	Cyclical	hold	-	ждать	в канале роста, скоро будет тест SL 67.
REGN	45	426	4%	45	↘	↘	↗	Aggressive Growth	hold	-	ждать	вышел из канала, SL 406
RUN	2	19	28%	49	↘	↘	↗	Distressed	hold	-	ждать	вышел из канала, SL 14,5
SBUX	87	70	0%	53	↘	↘	↗	Cyclical	hold	-	ждать	в канале роста, SL 68
SGMS	2	34	52%	32	↘	↘	↘	Cyclical	hold	-	фиксировать	вышел из канала, SL 23,5
SKYY	2	#N/A	-	67	↗	↗	↗	Aggressive Growth	hold	-	ждать	вышел из канала, SL 55
SQ	33	82	5%	58	↗	↗	↗	Speculative Growth	hold	-	ждать	SL 69
SSD	3	67	11%	52	↗	↗	↗	Cyclical	hold	-	ждать	SL 58
STMP	2	120	32%	27	↘	↘	↘	Aggressive Growth	hold	фиксировать на 80	фиксировать	
STZ	32	208	22%	53	↘	↘	↘	Classic Growth	hold	по пробую 180	ждать	тестирует канал, SL 160
T	221	35	14%	49	↗	↗	↘	High Yield	buy	покупать на 32 как защитную бумагу	ждать	Вышел из канала, SL 29
TREX	4	80	12%	43	↘	↘	↗	Cyclical	hold	-	ждать	Вышел из канала, SL 70
TRVG	2	6	16%	44	↘	↘	↘	Cyclical	hold	фиксировать на 4,7	фиксировать	SL 4,7
TSLA	50	324	12%	45	↘	↘	↘	Cyclical	hold	-	ждать	SL 245
TWLO	16	126	-1%	67	↗	↗	↗	Speculative Growth	hold	-	ждать	SL 104
TWTR	24	33	6%	51	↗	↘	↘	Speculative Growth	hold	-	фиксировать	треугольник, SL 28
UAA	9	21	-6%	56	↗	↗	↗	Cyclical	hold	-	ждать	тестирует канал, SL 21
ULTA	19	326	3%	66	↗	↗	↗	Cyclical	hold	-	ждать	SL 288
V	306	162	6%	73	↗	↗	↗	Cyclical	buy	по пробую 151	ждать	SL 143
VRSK	21	128	-1%	74	↗	↗	↗	Cyclical	hold	удерживаем	ждать	дивер, SL 123
VSH	3	25	22%	44	↘	↘	↗	Cyclical	hold	удерживаем	фиксировать	SL 20
VZ	238	59	3%	63	↗	↗	↗	High Yield	buy	как защитную бумагу для портфеля	ждать	SL 53
WBA	58	74	20%	31	↘	↘	↘	Aggressive Growth	hold	-	фиксировать	SL 59
WMT	288	109	10%	56	↗	↗	↗	Slow Growth	hold	-	ждать	SL 95
WP	31	109	10%	73	↗	↗	↗	Cyclical	hold	точка входа на 97,5	ждать	SL 90,6
WYNN	13	139	19%	38	↘	↘	↘	Cyclical	hold	-	фиксировать	SL 115
XLRN	2	62	33%	59	↗	↗	↗	Distressed	hold	-	ждать	SL 42