

US Daily: Как ФРС испугал рынок, ключевой уровень 2912

Заявление главы ФРС оказало давление на рынки США, впереди пятничный отчет занятости...



В среду. Индекс S&P (-0,8%) показал самое большое снижение почти за шесть недель. Другие индексы США, Dow Jones и Nasdaq также испытали давление. Ключевым моментом стало заявление главы ФРС об отсутствии каких либо ожиданий в отношении снижения процентных ставок в США. При этом глава ФРС подчеркнул что не видит убедительных аргументов в пользу изменения ставок в любом направлении. Выводы из послания главы ФРС следующие (1) недавняя низкая инфляция, вероятно, является «временной». (2) ФРС не будет изменять ставки в ближайшее время. Последний раунд переговоров завершился в среду в Пекине, министр финансов США Стивен Мнучин назвал встречи «продуктивными» в твиттере. CNBC в свою очередь сообщила, что США и Китай могут объявить о торговой сделке уже в следующую пятницу, ссылаясь на источники, которые она не назвала.

Сегодня. Фьючерс на S&P после сильной коррекции тестировал защитный уровень 2912. Что важно уровень в моменте устоял, что говорит нам по крайней мере о замедлении коррекционного движения. В скором времени фьючерс будет тестировать нижнюю границу канала от начала апреля. При успешном отскоке фьючерс вернется в данный канал роста. Следующим важным прогнозом по ставкам в США является пятничный ежемесячный отчет по занятости в США. Согласно прогнозам, в апреле рабочие места в несельскохозяйственном секторе вырастут примерно на 190 000. Уровень безработицы составит 3,8%, а среднечасовой рост доходов составит 3,3%.

Межрынок и индикаторы. Межрыночные индикаторы указывают на появление сценария дальнейшего роста волатильности при уменьшении аппетита к риску. VIX вышел из коррекционного канала от 26 декабря и теперь тестирует уровень 14,5 в случае пробоя которого вверх мы можем увидеть рост до \$17,6 - 12% рост с текущих уровней. Фьючерсы на нефть тестируют нижнюю границу восходящего канала роста от 28 марта. Золото продолжает коррекционное движение и тестирует уровень Фибоначчи 1272 (50%). Индикаторы аппетита NYG/JNK вышли из канала роста от 8 марта.

Сектора закрылись в минусе. Хуже рынка был сектор энергоносителей XLB (-1,8%). Индустриальный сектор XLI тестирует нижнюю границу канала от 29 марта. Технологический сектор XLK отрабатывает медвежью дивергенцию. Большинство компаний из индекса S&P скорректировались. Исключением были AAPL (+4,9%) и NFLX (+2,2%).

Что ждем? Фьючерс на S&P показал сильное коррекционное движение, но удерживается выше уровня 2912. Важно, для продолжения бычьего сценария вернуться в канал роста от 3 апреля. В случае пробоя 2912 вниз, ключевым уровнем поддержки будет 2900 (горизонтальная поддержка). Уход ниже 2900 поставит под сомнение бычий сценарий индекса.

Действия. Докупаем основные портфельные позиции согласно списку buy на 1/2 от лимитов. Для новых позиций и портфелей возможна частичная аллокация (25-30%) в облигациях с целью дальнейшей закупки в случае эскалации текущей коррекции рынка акций.

Защита. При пробое 2893 на хорошем объеме открывать позиции в инверсных ETF TVIX, SQQQ, SDS.

Среднесрочно | BUY LIST*:

AAPL, ADBE, AMZN, BA, BABA, BAC, CPRT, DIS, FB, GS, JPM, MA, MSFT

Среднесрочно | SELL LIST:

Локально | BUY LIST: FTNT, JPM, LMT, MMM, NFLX

Локально | FIX LIST:

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

Ключевые темы и новости по рынку:

- (=) FB и FTC ведут переговоры о возможном урегулировании, которое создаст новые практики и законы в области конфиденциальности, а также ожидаемый штраф в несколько миллиардов долларов.
- (=) FAA заявляет, что оно обязало BA принять новое программное обеспечение и детали управления полетом для 787 Dreamliner для устранения небезопасных условий эксплуатации определенных продуктов на самолете.
- (+) LYFT нанимает своего первого руководителя машинного обучения и искусственного интеллекта. Новый сотрудник сосредоточится на совершенствовании технологий, соответствующих водителям и гонщикам, и на поиске новых способов применения машинного обучения к платформе Lyft.
- (+) Финансовые акции (XLF), которые первоначально понизились после решения ФРС о том, чтобы держать ставки стабильными, в целом восстановились, из-за комментариев председателя ФРС, отбрасывающих спекуляции о возможном снижении ставок.
- (+) Согласно документам, поданным в Калифорнии, TSLA планирует запустить программу страхования для своих водителей через отношения с дочерней государственной страховой компанией Markel Corporation.
- (=) Отчет AMD был смешанным GAAP EPS of \$0.01, выручка в размере \$1,27 млрд (-23,0% г/г) выше ожиданий на \$14.63M.
- (-) После отчетности AMD аналитик Jefferies Марк Липасис отошел от позитивного мнения по компании. Причина - AMD не может конкурировать с INTC «на постоянной основе из-за разницы в масштабах и ресурсах».
- (=) AMZN говорит, что до полной автоматизации одного заказа потребуется как минимум десятилетие.
- (+) DIS. Мстители: Эндшпиль стал самым кассовым иностранным фильмом в Китае. Совокупный валовой доход по Китаю составит \$463 млн.
- (=) CMCSA закрыла сделку по приобретению Deep Blue Communications, специалиста по коммерческим сетям Wi-Fi.
- (+) ACN сообщает, что завершила приобретение компании. Droga5. Droga5 расширяет возможности ACN как агентства, способного разрабатывать, создавать и обслуживать клиентов, которые развивают бренды и бизнес.
- (-) Longbow Research понижает MCD с Buy до Neutral.
- (+) TTWO выросло на 2,6% после повышения инвестбанка Cowen. В то же время Стивенс назвал TTWO «лучшей идеей» вместо EA, а фирма видит в Red Dead Online положительный катализатор.
- (+) PM заявляет, что в 2019 году ожидается многообещающий старт. «Позитивный импульс для наших портфелей продуктов с горючими табачными изделиями и бездымной пищей привел к увеличению общего объема и росту доли в первом квартале», - отмечает компания.

Daily Market Snapshot

Среднесрочный сценарий: Возврат к росту и закрепление за 2960

imanalin опубликовал(а) на TradingView.com, Май 02, 2019 16:32:01 +06
TVC:SPX, 1D 2923.7 ▼ -22.1 (-0.75%) O:2952.3 H:2954.1 L:2923.4 C:2923.7



Создано при помощи TradingView

Локальный сценарий: остаться в канале роста и тест 2940

imanalin опубликовал(а) на TradingView.com, Май 02, 2019 16:35:45 +06
FX:SPX500, 240 2927.2 ▲ +12.4 (+0.43%) O:2927.3 H:2930.0 L:2926.0 C:2927.2



Создано при помощи TradingView

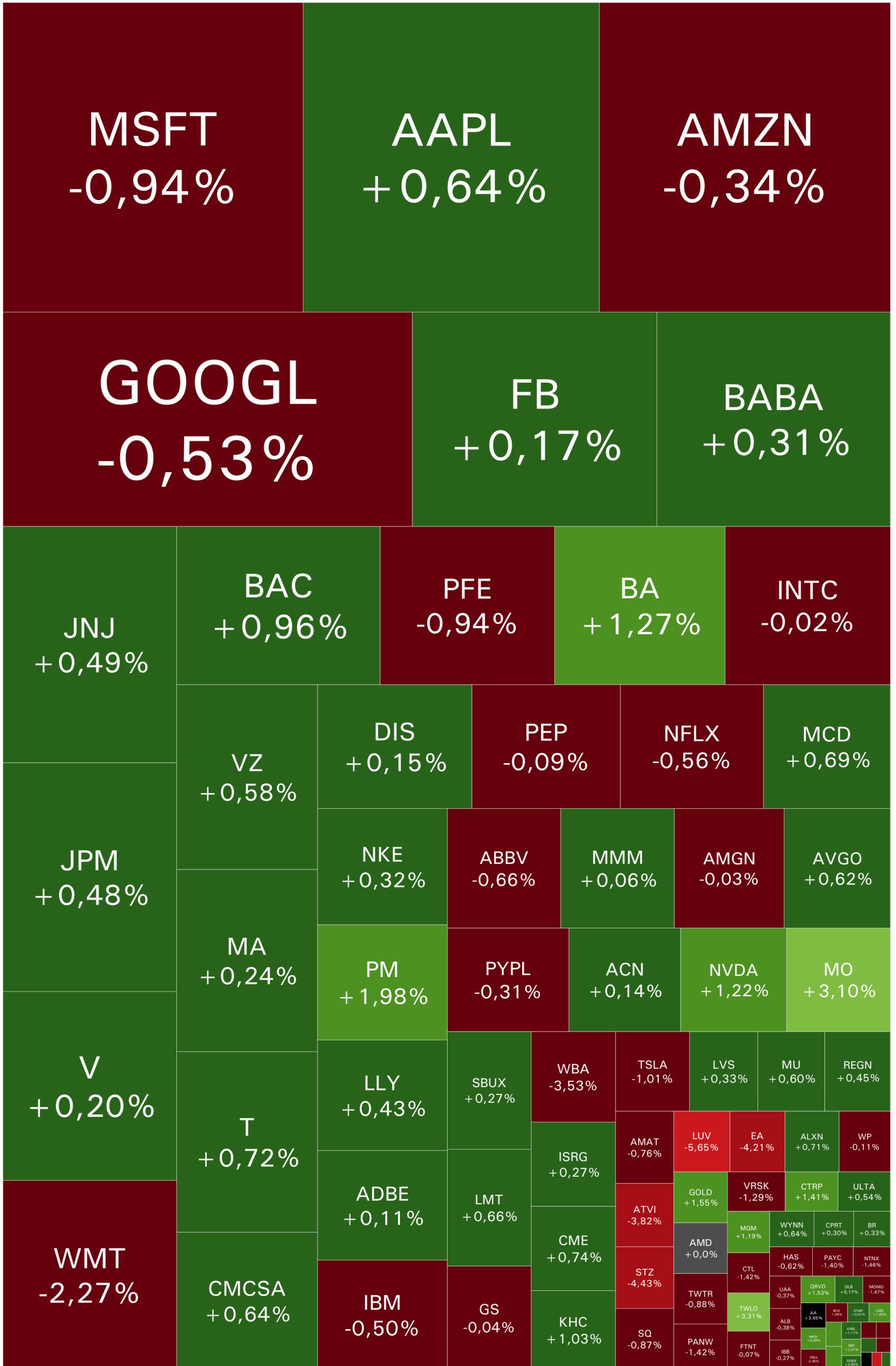
Daily Market Snapshot

Фазы трендов акций: 1 day vs. 1 week



Daily Market Snapshot

Карта рынка за предыдущую торговую сессию



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	35	35%	35	↘	↘	↘	Cyclical	hold	удерживать есть позитив	ждать	Ушел ниже уровня Фибоначчи 29,5
AAPL	969	214	2%	71	↗	↗	↗	Cyclical	buy	Покупаем в портфель	ждать	
ABBV	117	92	16%	43	↘	↘	↘	Speculative Growth	hold	держат до 75,1	ждать	Тестирует нижнюю границу каналп
ACN	116	182	0%	68	↗	↗	↗	Aggressive Growth	hold	удерживаем	ждать	Дивер медвежий на H4
ADBE	138	297	5%	64	↗	↗	↗	Aggressive Growth	buy	Покупаем в портфель	ждать	
ALB	8	109	47%	30	↘	↘	↘	Cyclical	hold	фиксировать ниже 70	ждать	Ушел ниже уровня Фибоначчи 86,2
ALXN	30	164	23%	50	↘	↘	↘	Aggressive Growth	hold	-	ждать	Вышел из локального тренда
AMAT	41	48	12%	56	↗	↗	↗	Cyclical	hold		ждать	
AMD	29	27	2%	48	↘	↘	↘	Cyclical	hold		ждать	Тестирует локальный канал роста от 8 марта
AMGN	107	207	18%	33	↘	↘	↘	Slow Growth	hold	-	ждать	
AMZN	941	2 225	16%	64	↗	↗	↗	Cyclical	buy		ждать	
ATVI	37	53	10%	63	↗	↗	↗	Slow Growth	hold	удерживаем	ждать	Вышел из канала от 8 марта
AVGO	126	320	0%	66	↗	↗	↗	Cyclical	hold	По пробую 285	ждать	В канале роста
BA	212	432	15%	47	↘	↘	↘	Cyclical	buy	покупать	ждать	
BABA	489	210	11%	59	↗	↗	↗	Aggressive Growth	buy	покупать	ждать	
BAC	288	33	9%	60	↗	↗	↗	Cyclical	buy	покупать	ждать	
BOX	3	24	19%	53	↘	↘	↘	Speculative Growth	hold		ждать	
BR	14	117	0%	75	↗	↗	↗	Cyclical	hold	интересен	ждать	У верхней границы канала
CMCSA	197	47	8%	74	↗	↗	↗	Classic Growth	hold	вход по пробую 39,8	ждать	
CMD	3	98	42%	57	↗	↘	↘	Aggressive Growth	hold	удерживать	ждать	
CME	63	185	5%	54	↘	↘	↘	Cyclical	hold	удерживать	ждать	
CPRT	15	63	-5%	63	↘	↘	↘	Cyclical	buy	-	ждать	
CTL	12	14	24%	35	↘	↘	↘	High Yield	hold	слабый отчет, возможное формирование дна	ждать	
CTRP	24	43	-1%	52	↘	↘	↘	Cyclical	hold	интересен	ждать	Отскочил от уровня Фибоначчи 46,13
DIS	245	139	2%	73	↗	↗	↗	Classic Growth	buy	Покупать	ждать	
DLB	7	77	19%	51	↗	↗	↗	Slow Growth	hold		ждать	
EA	28	104	10%	46	↘	↘	↘	Classic Growth	hold	по пробую 111 на ограниченный объем	ждать	
FB	551	220	14%	73	↗	↗	↗	Aggressive Growth	buy	-	ждать	Медвежий дивер на H4
FIT	1	7	27%	37	↘	↘	↘	Distressed	hold	-	ждать	Тестирует горизонтальную поддержку 5,65
FTNT	16	88	-4%	58	↘	↘	↘	Speculative Growth	hold	-	покупать	Вернулся в канал роста
GOLD	22	14	15%	37	↘	↘	↘	Cyclical	hold	-	ждать	Тестирует локальный канал роста от 1 марта
GOOGL	813	1 333	14%	39	↘	↘	↘	Speculative Growth	hold	покупать	ждать	
GS	78	229	12%	55	↗	↗	↗	Cyclical	buy	поддержка 169	ждать	
HAS	13	106	4%	75	↘	↘	↘	Cyclical	hold		ждать	Отскочил от уровня Фибоначчи уровень 85,2
IBB	8	#N/A N/	-	39	↘	↘	↘	Aggressive Growth	hold	-	ждать	
IBM	125	149	6%	50	↘	↘	↘	Slow Growth	hold	ждем точку входа на 153,9	ждать	Тестирует уровень Фибоначчи 144
INTC	227	55	8%	30	↘	↘	↘	Cyclical	hold		ждать	
IRBT	3	112	9%	32	↘	↘	↘	Cyclical	hold		ждать	Пробил коррекционный канал
ISRG	57	563	13%	32	↘	↘	↘	Speculative Growth	hold	-	ждать	Пробил уровень Фибоначчи 576
JNJ	377	148	4%	67	↗	↗	↗	Slow Growth	hold	следим	ждать	Тестирует уровень Фибоначчи 135
JPM	374	118	2%	70	↗	↗	↗	Cyclical	buy	ждем 103 как минимум	покупать	
KHC	40	37	12%	45	↗	↘	↘	Slow Growth	hold		ждать	
KNSL	2	#N/A N/	-	55	↗	↗	↗	Cyclical	hold	-	ждать	Вышел из локального канала роста от 27 декабря, с
KRE	2	73	-	72	↗	↗	↗	Aggressive Growth	hold	удерживаем	ждать	-
LC	1	4	37%	47	↘	↘	↘	Distressed	hold	ждем пробоя вверх	ждать	Медвежий дивер на H4
LLY	122	126	7%	40	↘	↘	↘	Classic Growth	hold	-	ждать	Горизонтальная поддержка 123
LMT	94	367	11%	71	↗	↗	↗	Cyclical	hold		покупать	По пробую 312
LUV	29	59	10%	59	↗	↘	↘	Cyclical	hold		ждать	
LVS	52	72	6%	64	↗	↗	↗	High Yield	hold	по пробую 62,4	ждать	Медвежий дивер на H4
MA	254	273	10%	67	↗	↗	↗	Cyclical	buy	пробой 225	ждать	
MCD	148	213	10%	57	↗	↗	↗	Cyclical	hold	-	ждать	
MGM	14	34	30%	39	↘	↘	↘	Cyclical	hold		ждать	По пробую 28
MKSI	5	110	24%	34	↘	↘	↘	Aggressive Growth	hold	удерживаем	ждать	
MMM	107	190	2%	23	↘	↘	↘	Cyclical	hold	-	покупать	В канале роста от 8 марта
MO	100	59	10%	44	↘	↘	↘	High Yield	hold	изучаем	ждать	
MOMO	7	44	24%	43	↘	↘	↘	Speculative Growth	hold	изучаем	ждать	
MSFT	980	144	13%	69	↗	↗	↗	Classic Growth	buy	по пробую 116	ждать	
MU	46	48	15%	49	↘	↘	↘	Cyclical	hold	-	ждать	Возле уровня Фибоначчи 42,4
NFLX	166	395	4%	58	↗	↗	↗	Aggressive Growth	hold	по пробую 380	ждать	S/L 339
NKE	135	92	8%	47	↗	↗	↗	Cyclical	hold	по пробую 86	ждать	
NTNX	8	47	10%	60	↗	↘	↘	Speculative Growth	hold	S/L 32	ждать	Пробила вверх уровень Фибоначчи 39,6
NVDA	110	182	1%	47	↘	↘	↘	Cyclical	hold	следить за уровнями 163-176	ждать	
PANW	23	284	15%	56	↗	↗	↗	Speculative Growth	hold	покупать	ждать	
PAYC	12	208	3%	68	↗	↗	↗	Aggressive Growth	hold		ждать	
PEP	178	128	1%	68	↗	↗	↗	Slow Growth	hold	-	ждать	
PFE	226	46	12%	48	↘	↘	↘	Slow Growth	hold	-	ждать	
PM	133	93	8%	50	↘	↘	↘	High Yield	hold		ждать	
PYPL	130	116	5%	66	↗	↗	↗	Cyclical	hold	-	ждать	
QRVO	9	72	-5%	54	↗	↗	↗	Cyclical	hold		ждать	
REGN	37	425	25%	32	↘	↘	↘	Aggressive Growth	hold		ждать	В коррекционном канале
RUN	2	20	31%	45	↘	↘	↘	Distressed	hold		ждать	
SBUX	94	77	-1%	68	↗	↗	↗	Cyclical	hold	-	ждать	В канале роста с начала года
SGMS	2	33	45%	55	↗	↘	↘	Cyclical	hold		ждать	
SKYY	2	#N/A N/	-	64	↗	↗	↗	Aggressive Growth	hold		ждать	
SQ	31	82	11%	50	↘	↘	↘	Speculative Growth	hold		ждать	Тест уровня Фибоначчи 75
SSD	3	66	3%	63	↗	↗	↗	Cyclical	hold		ждать	
STMP	1	115	36%	48	↗	↘	↘	Aggressive Growth	hold	фиксировать на 80	ждать	
STZ	41	221	4%	82	↗	↗	↗	Classic Growth	hold	-	ждать	
T	225	34	12%	42	--	↘	↘	High Yield	buy	покупать на 32 как защитную бумагу	ждать	
TREX	4	75	14%	36	↘	↘	↘	Cyclical	hold	-	ждать	
TRVG	2	5	20%	52	↘	↘	--	Cyclical	hold	фиксировать на 4,7	ждать	
TSLA	41	302	29%	31	↘	↘	↘	Cyclical	hold	-	ждать	
TWLO	16	149	16%	51	↘	↘	↘	Speculative Growth	hold	-	ждать	
TWTR	30	39	-2%	71	--	↗	↗	Speculative Growth	hold	-	ждать	Тестирует канал роста от 8 марта
UA	9	21	-3%	50	↘	↘	↘	Cyclical	hold	-	ждать	
ULTA	20	359	7%	41	↘	↘	↘	Cyclical	hold		ждать	Боковик
V	325	180	10%	67	↗	↗	↗	Cyclical	buy	по пробую 151	ждать	Тестирует нижнюю границу канала от начала года
VRSK	23	141	1%	68	↗	↗	↗	Cyclical	hold	удерживаем	ждать	
VSH	3	25	28%	45	↘	↘	↘	Cyclical	hold	удерживаем	ждать	
VZ	234	60	6%	40	↘	↘	↘	High Yield	hold	как защитную бумагу для портфеля	ждать	Горизонтальное сопротивление \$58
WBA	49	60	13%	35	↘	↘	↘	Aggressive Growth	hold		ждать	
WMT	291	109	8%	52	↗	↗	↗	Slow Growth	hold	-	ждать	Тестирует уровень Фибоначчи 101
WP	38	116	-1%	69	↗	↗	↗	Cyclical	hold	точка входа на 97,5	ждать	Боковик
WYNN	16	149	2%	62	↗	↘	↘	Cyclical	buy	-	ждать	
XLRN	2	60	50%	38	↘	↘	↘	Distressed	hold	-	ждать	Ушел ниже уровня Фибоначчи 43,46