

Daily Report

marzo 14

2018

Per contatti scrivere a
info@moneyriskanalysis.com Oppure telefonare
al 3456069728

A cura di
MoneyRiskAnalysis

TRUMP: fuori un altro



Ieri, nel momento in cui hanno preso a scendere i mercati (fatto anomalo di questi tempi) qualcuno mi ha chiesto il perché. A quel punto ho semplicemente risposto che una delle motivazioni principali era da ricercare nel siluramento di Tillerson. “Non credo, sia quello, visto che la news è uscita 50 minuti fa”, la contro replica. Purtroppo il mercato, è talmente drogato dai perma-bullish, che anche delle notizie bomba vengono snobbate anche di fronte all’evidenza.

Tillerson era una delle poche colombe rimaste, all’interno di un’Amministrazione decisamente hawkish.

Il fatto che Trump abbia preso questa decisione e per lo più via Twitter, nominando Mike Pompeo come nuovo Segretario di Stato la dice lunga su come stia **cambiando in negativo la politica estera degli Usa** e di conseguenza la situazione geopolitica.

Mike Pompeo, ex capo della Cia ed ex militare è oggi considerato un falco in politica estera in quanto professa la linea dura contro la Corea del Nord e l’Iran, mentre ha sempre sminuito il Russiagate.

Ma come, proprio adesso che Trump e Kim Jong-un stavano per far pace, gli Usa licenziano l’unico politico in grado di portare avanti un dialogo costruttivo?

Secondo gli esperti la Corea del Nord, negli anni, ha alternato fasi negoziali a repentini atteggiamenti belligeranti. L’arma atomica e la capacità di colpire il territorio Usa rimangono per Kim uno strumento di deterrenza in grado di garantire la sopravvivenza del regime e una chiave di legittimazione interna.

La Corea del Nord ha promesso la denuclearizzazione nonostante che tra fine Marzo e Aprile la Corea del Sud e gli Usa daranno luogo ad esercitazioni militari di routine.

Questo atteggiamento, pacifista di Kim, in realtà, è solo un temporeggiare per progredire negli armamenti nucleari. Tre o quattro mesi di dialogo possono significare davvero tanto in termini di progressi scientifici nucleari per la Nord Corea. Del resto, se attraverso il dialogo si riuscisse ad ottenere qualche alleggerimento in termini di sanzioni, sarebbe ancora meglio per Ciccio-Pasticcio. Per un dialogo Kim-Trump sono favorevoli Cina e Sud Korea, mentre il Giappone è contrario. In questo contesto, gli Usa si trovano in una posizione molto delicata, in quanto niente è scontato, soprattutto che i sudcoreani (che si sentono comunque sempre coreani e oltretutto fortemente penalizzati dai dazi) stiano dalla parte di Trump.

ANALISI SETTORE



Bearish-engulfing a ridosso del massimo toccato a inizio Febbraio. Rimane fra i settori più forti. Supporto di breve importante a 452. Sotto questo livello attendiamo target a 442 e 426.

Resistenza 466.

La direzionalità sta diminuendo, mentre gli indicatori presentano ancora una situazione positiva.

Non è certamente il settore dal quale attendersi un'inversione di tendenza nell'immediato.

Il bancario, contrariamente al finanziario, sembra più predisposto ad un'inversione ribassista.

ANALISI INDICE



Il Dax è veramente debole, se confrontato con l'Eurostoxx e Ftsemib. I motivi sono da ricercare nei provvedimenti presi da Trump in tema di dazi, anche se a dire il vero gli altri europei non sono immuni. Basti pensare che l'Italia ha lo stesso peso della Cina relativo alla quota di alluminio esportata negli Usa. Da un punto di vista grafico il Dax ritorna sotto la media di brevissimo, anche se il vero supporto è posto sempre a 12000 e successivo 11800 e 11500. Mercato fortemente condizionato dalle scadenze tecniche delle tre streghe. Non ci troviamo ancora in una fase pesante.



Come ormai sappiamo Qualcomm è stata considerata troppo strategica da Trump. La stessa cosa non si può dire per Apple, con la quale sono aperte numerose questioni. E' molto probabile che Qualcomm sia fortemente tutelata riguardo ai brevetti sfruttati da Apple. Nel frattempo il mercato, rimane deluso dallo stop presidenziale sull'offerta Broadcom. Tecnicamente Qualcomm muove al di sopra della media a 200. Nel frattempo il titolo in questi 4 mesi ha già distribuito 2 punti percentuali di dividendo.....sostenibile.

ANALISI QUANTITATIVA

ANALISI DI PIVOT

E' una semplice elaborazione matematica sulla base dell'escursione del giorno precedente di una variabile, attraverso la quale vengono calcolate delle estensioni ben precise, partendo da un punto cosiddetto Pivot.

Come leggere la tabella: il Pivot è il punto di equilibrio per il giorno in essere. Una quotazione sotto il pivot rappresenta debolezza e buone probabilità che venga raggiunto il supporto 1, sotto il quale attendiamo supporto 2 e così via. Sono livelli sui quali generalmente avvengono reazioni contrarie prima di essere intaccati definitivamente, ma che servono soprattutto a capire quali siano i punti di intervento più significativi. Per un'operatività intraday, infatti, è molto importante stabilire dei punti ben precisi sui quali farsi trovare pronti per agire in caso di take-profit o stop.

Per fare un esempio: se la tendenza di un determinato asset presenta una tendenza di fondo rialzista (per questo suggeriamo di osservare l'indicatore MRA nella sezione indici, se inferiore o superiore a 1, relativo all'asset specifico), è preferibile attendere un ritorno sopra il pivot prima di aprire una posizione long con target sui livelli successivi o viceversa. Al contrario una permanenza sotto il livello di pivot dovrà quanto meno rappresentare un motivo di diffidenza, nel caso vogliate seguire la tendenza di fondo rialzista. Piuttosto sarà più conveniente agire sul target inferiore, o viceversa nel caso di short.

	sup3	sup2	sup1	pivot	res1	res2	res3
futures							
fib	22248	22414	22543	22709	22838	23004	23133
dax	11681	11898	12026	12243	12372	12589	12717
eurostoxx	3275	3323	3351	3399	3427	3475	3503
btp future	135,35	135,61	135,81	136,07	136,27	136,53	136,73
bund	156,86	157,02	157,30	157,46	157,74	157,90	158,18

CLASSIFICA INDICI SECONDO INDICATORE MRA				CLASSIFICA SETTORI SECONDO INDICATORE MRA			
LYXOR COMMOD CRB EX-ENERGY UCITS ETF AC	1,03500	16,666(c)	-0,66%	ESTX BASIC RESOURC.PR.EUR	1,02000	263,83(c)	-0,37%
XTRACKERS MSCI RUSSIA CAP SWAP UCITS ET	1,03100	23,715(c)	-1,21%	ESTX FIN.SERVICES PR.EUR	1,02000	459,94(c)	-0,85%
NASDAQ Composite Index	1,03000	7.511,01(c)	-1,02%	ESTX FOOD-BEVERAGE PR.EUR	1,01000	598,63(c)	-1,15%
LYXOR BRAZIL (IBOVESPA) UCITS ETF - ACC	1,02700	19,012(c)	-0,96%	ESTX OIL + GAS PR.EUR	1,01000	310,17(c)	+0,22%
LYXOR SAFR FTSE JSE TOP40 UCITS ETF ACC	1,02400	38,795(c)	-1,23%	ESTX TECHNOLOGY PR.EUR	1,01000	508,32(c)	-1,32%
LYXOR EMTS HI R MW GOV DR UCITS ETF ACC	1,02000	139,99(c)	+0,03%	ESTX IND.GOODS-SER.PR.EUR	1	820,18(c)	-0,77%
Euro Bund Full0618 Future	1,02000	157,59(c)	+0,20%	ESTX REAL EST.PR.EUR	1	234,41(c)	-0,61%
ISHARES RUSSELL 2000 ETF	1,01000	158,46(c)	-0,46%	ESTX SEL.DIV.30 PR.EUR	1	2.050,22(c)	-0,84%
S&P500 Index	1,01000	2.765,31(c)	-0,64%	ESTX UTILITY PR.EUR	1	272,22(c)	-0,07%
DJ30 Industrial Avg Index	1,01000	25.178,61(c)	-0,62%	ESTX CHEMICAL PR.EUR	1	1.077,65(c)	-1,55%
Long-Term Euro BTP Full0618 Future	1,01000	136,02(c)	+0,02%	ESTX TR. + LS PR.EUR	0,99000	224,36(c)	-0,42%
ETFs WTI CRUDE OIL	1,00800	7,032(c)	-1,58%	ESTX MEDIA PR.EUR	0,99000	217,18(c)	-1,37%
ISHARES MSCI EM UCITS ETF DIST	1,00500	38,130(c)	-1,00%	ESTX TELECOMMUNIC.PR.EUR	0,99000	294,80(c)	-1,41%
ISHARES MSCI WORLD UCITS ETF USD DIST	1,00500	36,920(c)	-1,02%	ESTX CONSTR.-MATR.PR.EUR	0,99000	436,86(c)	-0,56%
ISHARES MSCI WORLD EUR HDG UCITS ETF AC	1,00500	51,120(c)	-0,53%	ESTX RETAIL PR.EUR	0,98000	464,28(c)	-0,65%
LYXOR AUSTRAL S&P/ASX 200 UCITS ETF DIS	1,00400	39,710(c)	-1,55%	ESTX AUTOM.+PARTS PR.EUR	0,98000	591,21(c)	-1,06%
ISHARES MSCI KOREA UCITS ETF USD DIST	1,00300	41,930(c)	-0,07%	ESTX HEALTH CARE PR.EUR	0,98000	784,20(c)	-1,38%
ISHARES HIGH YLD CORP UCITS ETF DIST	1	107,13(c)	-0,14%	ESTX INSURANCE PR.EUR	0,98000	264,62(c)	-1,37%
CAC40 Index	1	5.242,79(c)	-0,64%	STX EU EN.15 PR.EUR	0,97000	1.678,07(c)	-0,98%
BEL20 Index	1	3.970,47(c)	-0,80%	ESTX BANKS PR.EUR	0,97000	130,27(c)	-0,60%
AEX25 Index	1	532,52(c)	-1,10%				
LYXOR COMMODITIES CRB TR UCITS ETF ACC	0,99700	14,444(c)	-0,91%				
ISHARES CHINA LARGE CAP UCITS ETF DIST	0,99000	112,72(c)	-1,49%				
STOXX600 Price Eur Index	0,99000	375,49(c)	-0,98%				
ETFs GOLD	0,99000	12,642(c)	-0,08%				
FTSE MIB40 Index	0,99000	22.690,98(c)	-0,32%				
LYXOR MSCI CANADA UCITS ETF - DIST	0,99000	57,63(c)	-1,06%				
ESTOXX50 Price Eur Index	0,99000	3.397,35(c)	-0,94%				
PSI20 Index	0,99000	5.425,62(c)	-0,23%				
FTSE100 Index	0,99000	7.138,78(c)	-1,05%				
SMI20 Index	0,99000	8.970,74(c)	+0,44%				
LYXOR TURKEY UCITS ETF - ACC	0,98900	43,065(c)	-1,60%				
XTRACKERS MSCI INDONESIA SWAP UCITS ETF	0,98300	13,078(c)	-2,08%				
NIKKEI225 Index	0,98000	21.968,10(c)	+0,66%				
DAX30 Perf Index	0,98000	12.221,03(c)	-1,59%				
IBEX35 Index	0,97000	9.691,70(c)	-0,37%				
LYXOR MSCI INDIA UCITS ETF - ACC	0,96500	15,436(c)	-0,23%				

I 10 TITOLI EUROPEI MIGLIORI PER INDICATORE MRA				I 10 TITOLI EUROPEI PEGGIORI PER INDICATORE MRA			
YOOX NET-A-PORTER GROUP	1,07000	37,73(c)	+0,11%	ALTICE	0,85200	7,960(c)	+1,02%
MONCLER	1,06000	29,25(c)	-0,68%	THYSENKRUPP AG O.N.	0,90200	21,380(c)	-0,70%
FINCOBANK	1,06000	10,110(c)	-1,84%	LEONARDO	0,90800	9,154(c)	-1,12%
AIRBUS	1,06000	95,66(c)	-0,22%	B. SABADELL	0,91270	1,6715(c)	-0,21%
DEUTSCHE BOERSE NA O.N.	1,04000	109,55(c)	-0,90%	DIA	0,92000	3,702(c)	-2,53%
ASML HOLDING	1,04000	169,55(c)	-1,37%	BBVA	0,92600	6,670(c)	-0,06%
PERNOD RICARD	1,04000	134,65(c)	-0,26%	ING GROEP N.V.	0,92800	14,180(c)	-1,20%
POSTE ITALIANE	1,03500	7,260(c)	-2,16%	RECORDATI ORD	0,93000	29,30(c)	-1,21%
STMICROELECTRONICS	1,03200	19,455(c)	-2,58%	INDITEX	0,93000	24,26(c)	-0,21%
STMICROELECTRONICS	1,03100	19,460(c)	-2,70%	ATOS	0,93000	111,45(c)	-1,94%

I 10 TITOLI USA MIGLIORI PER INDICATORE MRA				I 10 TITOLI USA PEGGIORI PER INDICATORE MRA			
TWITTER INC.	1,19000	34,11(c)	-3,92%	ALLERGAN PLC	0,91000	163,19(c)	+3,02%
NETFLIX INC.	1,15000	315,88(c)	-1,69%	GENERAL ELECTRIC CO.	0,91000	14,43(c)	-4,44%
AMAZON.COM INC.	1,11000	1.588,18(c)	-0,64%	BIOGEN INC.	0,92000	283,24(c)	+1,19%
ADOBE SYSTEMS INC.	1,08000	219,76(c)	-0,53%	THE KRAFT HEINZ CO.	0,92000	67,37(c)	-0,49%
BOEING COMPANY THE	1,08000	338,67(c)	-1,60%	CVS HEALTH CORP.	0,92000	68,25(c)	-1,10%
INTEL CORP.	1,07000	51,78(c)	+0,50%	CELGENE CORP.	0,93000	91,56(c)	-0,78%
SALESFORCE.COM INC	1,07000	126,73(c)	-0,04%	UNITED PARCEL SERVICE INC.	0,94000	109,33(c)	+0,39%
MASTERCARD INC.	1,06000	181,01(c)	-0,84%	OCCIDENTAL PETROLEUM	0,94000	64,20(c)	+0,49%
BANK OF AMERICA	1,05000	32,36(c)	-1,46%	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	0,95000	55,94(c)	-1,18%
MICROSOFT CORP.	1,05000	94,41(c)	-2,44%	EXXON MOBIL CORP.	0,95000	74,53(c)	-0,94%

CKASSIFCA GOLDMINE PER INDICATORE MRA				CLASSIFICA ITALIA PER INDICATORE MRA			
HARMONY GOLD MINING CO.	1,08000	2,20(c)	-2,22%	YOOX NET-A-PORTER GROUP	1,07000	+0,11%	37,73(c)
BUENAVENTURA MINING CO.	1,04000	15,08(c)	-2,84%	FINECOBANK	1,06000	-1,84%	10,110(c)
NEWMONT MINING CORP.	1	38,22(c)	+0,63%	MONCLER	1,06000	-0,68%	29,25(c)
NEWCREST MINING LIMITED	0,98400	20,200(c)	-1,94%	POSTE ITALIANE	1,03500	-2,16%	7,260(c)
VISTA GOLD CORP	0,98300	0,762(c)	+1,60%	STMICROELECTRONICS	1,03200	-2,58%	19,455(c)
GOLD FIELDS LTD.	0,98000	3,85(c)	-1,79%	TENARIS	1,03000	-0,71%	14,730(c)
WHEATON PRECIOUS METALS ...	0,98000	19,88(c)	-0,25%	FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES	1,02900	+0,03%	17,202(c)
GOLDCORP INC.	0,98000	13,33(c)	+0,23%	FERRARI	1,02000	-1,18%	100,10(c)
FRANCO-NEVADA CORP.	0,97000	69,32(c)	+0,92%	MEDIOBANCA	1,01600	-0,10%	9,862(c)
YAMANA GOLD INC.	0,97000	2,62(c)	+0,38%	BPER BANCA	1,01100	+1,86%	4,699(c)
MCEWEN MINING INC.	0,96000	2,05(c)	+0,49%	LUXOTTICA GROUP	1,01000	-0,93%	51,14(c)
ANGLOGOLD ASHANTI	0,96000	9,37(c)	-2,70%	EXOR	1,01000	-1,05%	60,32(c)
HECLA MINING COMPANY	0,95000	4,04(c)	+2,80%	TELECOM ITALIA	1,00860	-2,37%	0,8008(c)
KINROSS GOLD CORP.	0,93000	3,59(c)	+0,00%	ATLANTIA	1	-1,51%	27,31(c)
AGNICO EAGLE MINES	0,92000	39,51(c)	+0,13%	MEDIASET S.P.A	0,99700	-4,15%	3,145(c)
NEW GOLD INC.	0,91000	2,45(c)	+0,41%	BANCO BPM	0,99540	+2,32%	3,0190(c)
BARRICK GOLD CORP.	0,89000	12,18(c)	+0,41%	ENEL	0,99100	+0,77%	4,870(c)
ELDORADO GOLD CORP.	0,86000	1,08(c)	-2,70%	CNH INDUSTRIAL	0,99100	-2,17%	10,800(c)
				AZA	0,99060	+1,41%	1,4795(c)
				TERNA	0,98900	+0,72%	4,636(c)
				INTESA SANPAOLO	0,98760	-0,28%	3,0430(c)
				SALVATORE FERRAGAMO	0,98500	+0,55%	21,850(c)
				CAMPARI	0,98400	-0,73%	6,095(c)
				SNAM	0,98300	+0,86%	3,743(c)
				UNICREDIT	0,98300	-0,41%	16,840(c)
				GENERALI ASS	0,98200	+0,23%	15,485(c)
				AZIMUT	0,98100	-1,41%	17,780(c)
				PRYSMIAN	0,98000	-1,59%	26,57(c)
				ENI	0,97900	+0,60%	13,800(c)
				UNIPOLSAI	0,97670	+0,20%	1,9600(c)
				UNIPOL	0,97300	+2,89%	4,097(c)
				ITALGAS	0,96800	+2,25%	4,763(c)
				SAIPEM	0,96100	-1,16%	3,398(c)
				BANCA GENERALI	0,96000	-0,22%	27,30(c)
				UBI BANCA	0,95900	+1,11%	3,838(c)
				BUZZI UNICEM	0,95800	-1,18%	20,920(c)
				BREMBO	0,94000	+0,39%	12,84(c)
				RECORDATI ORD	0,93000	-1,21%	29,30(c)
				LEONARDO	0,90800	-1,12%	9,154(c)

Direzionalità indici

Questo indicatore è essenziale al fine di individuare quali siano gli indici oggetto di potenziale movimento sostenibile al ribasso o al rialzo.

>40	Ipertrend	FTSE100 Index	43,0900
		DAX30 Perf Index	42,3300
		IBEX35 Index	41,5900
		LYXOR MSCI CANADA UCITS ETF - DIST	41,2800
		AEX25 Index	38,8300
		ESTOXX50 Price Eur Index	38,2700
		SMI20 Index	37,1800
		LYXOR EMTS HI R MW GOV DR UCITS ETF ACC	35,8300
		DJ30 Industrial Avg Index	33,6600
		STOXX600 Price Eur Index	30,7400
>26<40	Trend definito	S&P500 Index	30,6400
		NIKKEI225 Index	28,0700
		LYXOR MSCI INDIA UCITS ETF - ACC	27,8450
		ISHARES RUSSELL 2000 ETF	27,4700
		ISHARES MSCI WORLD EUR HDG UCITS ETF AC	27,2040
		CAC40 Index	26,9500
		BEL20 Index	26,8100
		FTSE MIB40 Index	26,7700
		XTRACKERS MSCI INDONESIA SWAP UCITS ETF	26,3020
>16<26	Trend normale	NASDAQ Composite Index	23,8600
		ISHARES MSCI WORLD UCITS ETF USD DIST	22,7690
		PSI20 Index	22,3000
		LYXOR AUSTRAL S&P/ASX 200 UCITS ETF DIS	21,7670
		Euro Bund Full0318 Future	21,6500
		XTRACKERS MSCI RUSSIA CAP SWAP UCITS ET	21,5810
		LYXOR SAFR FTSE JSE TOP40 UCITS ETF ACC	21,4110
		LYXOR TURKEY UCITS ETF - ACC	20,2130
		ISHARES CHINA LARGE CAP UCITS ETF DIST	19,1400
		ISHARES MSCI EM UCITS ETF DIST	18,7780
<16	Assenza trend	ISHARES MSCI KOREA UCITS ETF USD DIST	17,2800
		ETFS WTI CRUDE OIL	16,5550
		Long-Term Euro BTP Full0318 Future	15,8100
		LYXOR BRAZIL (IBOVESPA) UCITS ETF - ACC	15,6980
		LYXOR COMMODITIES CRB TR UCITS ETF ACC	14,5250
		LYXOR COMMOD CRB EX-ENERGY UCITS ETF AC	13,6890
		ISHARES HIGH YLD CORP UCITS ETF DIST	13,5600
		ETFS GOLD	11,8650

Glossario

<http://www.moneyriskanalysis.com/it/glossario.php>

General Disclaimer

Le informazioni contenute nel presente documento internet sono frutto di una accurata selezione di fonti da noi considerate attendibili. Non se ne garantisce l'accuratezza o la completezza e nulla, in questo documento, e' stato realizzato per fornire questa garanzia.

MoneyRiskAnalysis non si assume alcuna responsabilita' per i danni derivanti dall'uso d'informazioni contenute in questo documento.

Ne' questo documento, ne' il suo contenuto, ne' una sua copia possono essere modificati in qualsiasi modo, trasmessi o distribuiti senza citare la fonte ovvero MoneyRiskAnalysis.

I componenti del team di MoneyRiskAnalysis possono avere in corso acquisti, vendite o possono detenere posizioni di lungo o breve periodo sul mercato e/o avere interessi collegati ai valori mobiliari menzionati. Quanto espresso circa tali valori mobiliari riveste esclusivamente carattere informativo e non ha carattere di offerta, invito ad offrire o di messaggio promozionale finalizzato all'acquisto, alla vendita o alla sottoscrizione dei predetti valori mobiliari.

MoneyRiskAnalysis non si assume alcun tipo di responsabilita' in relazione alle informazioni fornite da altre fonti alle quali ci si possa collegare attraverso il presente documento. Qualsiasi raccomandazione o opinione espressa su tali altre fonti sono di esclusiva responsabilita' dei titolari di tali fonti e non costituiscono nella maniera piu' assoluta raccomandazioni o opinioni di MoneyRiskAnalysis. L'eventuale possibilita' di collegarsi ad altre fonti non rappresenta pertanto una raccomandazione o un'approvazione da parte di MoneyRiskAnalysis a quanto contenuto in tali fonti.

L'analisi dei dati e le informazioni contenute in questo documento sono preparate a solo scopo informativo, e non rappresentano un'offerta o sollecitazione di un'offerta a comprare o vendere quote di Fondi di Investimento o di qualsiasi altro strumento finanziario, o a sottoscrivere Contratti di Gestione di qualunque societa'. Questo documento non fornisce nessuna indicazione o consulenza o necessaria a prendere alcuna decisione di investimento.

La performance del passato non e' indicativa di uguali rendimenti nel futuro.

Copyright Money Risk Analysis © Riproduzione riservata