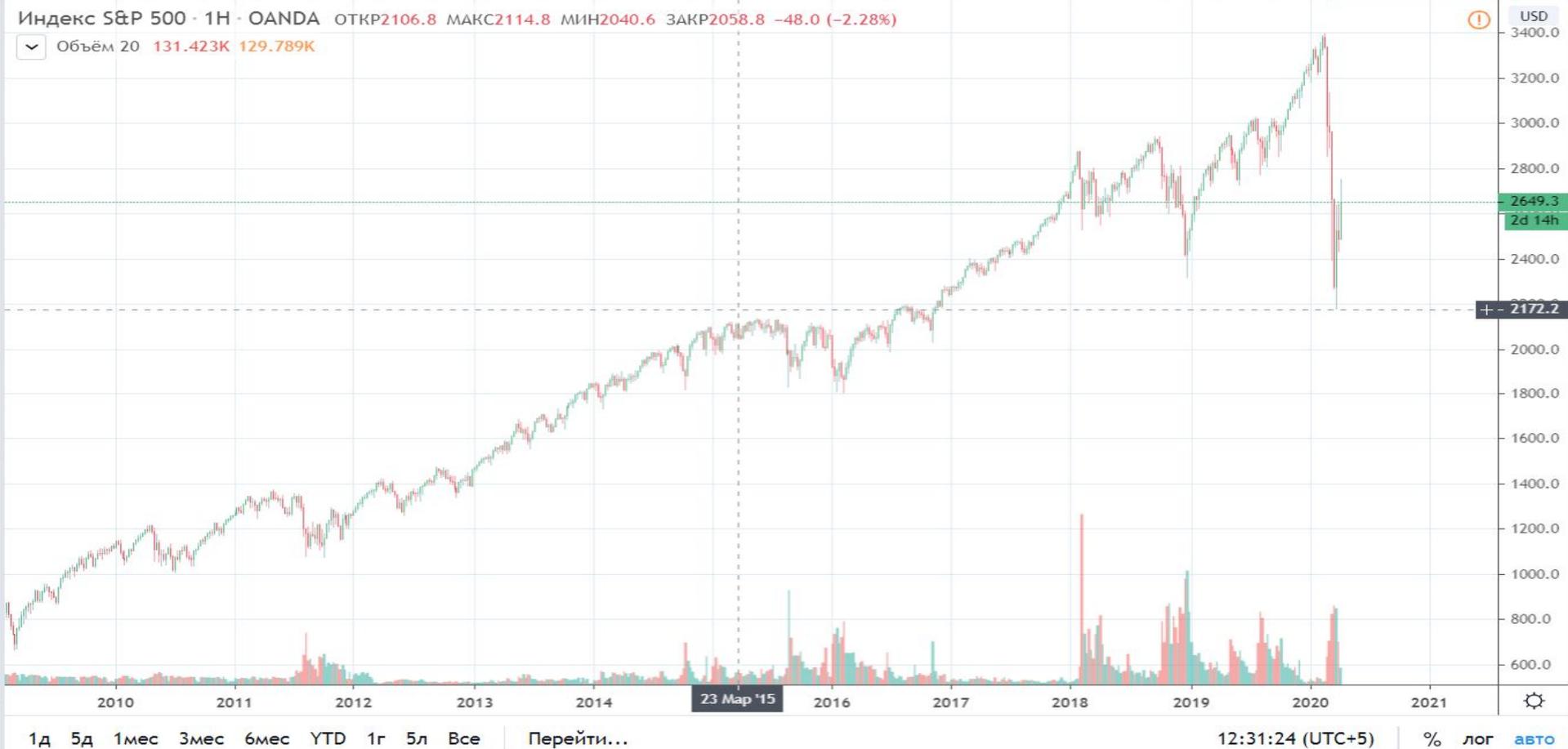


Влияние основных факторов на динамику индекса (S&P)

Индекс S&P 500

S&P 500 ([рус. Эс энд Пи 500](#)) — [фондовый индекс](#), в корзину которого включено 505 избранных торгуемых на [фондовых биржах США публичных компаний](#), имеющих наибольшую [капитализацию](#).

при составлении списка авторы пытаются наиболее полно представить различные отрасли американской экономики



1. Количество покупателей относительно



http://shortsqueeze.com/historical_short_interest_data.php

БЛОК НОВОСТЕЙ

- a) Число открытых вакансий на рынке труда в США (United States JOLTS Job Opening
- b) Запасы сырой нефти в США
- c) ВВП (м/м)
- d) ВВП (г/г)
- e) Число первичных заявок на получение пособий по безработице
- f) Индекс цен производителей
- g) Базовый индекс розничных продаж (м/м)
- h) Объем розничных продаж (м/м)
- i) Число выданных разрешений на строительство
- j) Индекс производственной активности

<https://ru.investing.com/economic-calendar/>

Сделки инсайдеров

| Latest Cluster Buys | | | | | | | | | | | | | | | | |
|---------------------|---------------------|------------|--------|---|------------------------------------|-----|--------------|---------|------------|------------|-------|---------------|----|----|----|----|
| X | Filing Date | Trade Date | Ticker | Company | Industry | Ins | Trade Type | Price | Qty | Owned | ΔOwn | Value | 1d | 1w | 1m | 6m |
| 8 M | 2020-04-08 16:47:16 | 2020-04-06 | HCAP | Harvest Capital Credit Corp | Closed-End Funds | 2 | P - Purchase | \$4.27 | +80,844 | 883,321 | +10% | +\$345,596 | | | | |
| 26 M | 2020-04-08 16:15:23 | 2020-04-06 | NREF | Nexpoint Real Estate Finance, Inc. | Real Estate Investment Trusts | 6 | P - Purchase | \$17.51 | +535,609 | 536,804 | >999% | +\$9,378,599 | | | | |
| 10 | 2020-04-08 14:37:33 | 2020-03-20 | EDI | Stone Harbor Emerging Markets Total Income Fund | Closed-End Funds | 5 | P - Purchase | \$5.54 | +171,058 | 301,145 | +131% | +\$947,691 | | | | |
| 17 M | 2020-04-07 17:44:28 | 2020-04-03 | ICMB | Investcorp Credit Management Bdc, Inc. | Closed-End Funds | 2 | P - Purchase | \$8.35 | +214,732 | 556,867 | +63% | +\$1,793,725 | | | | |
| 9 DM | 2020-04-07 17:23:16 | 2020-03-30 | MGM | Mgm Resorts International | Hotels & Motels | 5 | P - Purchase | \$11.53 | +2,293,341 | 24,807,144 | +10% | +\$26,445,895 | | | | |
| 2 | 2020-04-07 17:11:35 | 2020-03-31 | ED | Consolidated Edison Inc | Electric & Other Services Combined | 2 | P - Purchase | \$82.00 | +201 | 14,835 | +1% | +\$16,481 | | | | |
| 5 | 2020-04-07 17:04:24 | 2020-04-06 | LYB | Lyondellbasell Industries N.V. | Industrial Organic Chemicals | 4 | P - Purchase | \$59.26 | +14,295 | 441,378 | +3% | +\$847,087 | | | | |
| 10 DM | 2020-04-07 16:47:29 | 2020-04-03 | LQDT | Liquidity Services Inc | Business Services | 4 | P - Purchase | \$4.12 | +652,057 | 6,802,340 | +11% | +\$2,684,554 | | | | |
| 4 D | 2020-04-07 16:16:12 | 2020-04-03 | NXRT | Nexpoint Residential Trust, Inc. | Real Estate Investment Trusts | 2 | P - Purchase | \$30.58 | +243,116 | 7,111,010 | +4% | +\$7,433,390 | | | | |
| 2 D | 2020-04-07 16:03:12 | 2020-04-03 | SAIC | Science Applications International Corp | Computer Integrated Systems Design | 2 | P - Purchase | \$70.71 | +15,800 | 104,730 | +18% | +\$1,117,294 | | | | |

| Top Officer Purchases of the Week | | | | | | | | | | | | | | | | |
|-----------------------------------|---------------------|------------|--------|---|-----------------------|---------------------|--------------|---------|----------|-----------|-------|--------------|----|----|----|----|
| X | Filing Date | Trade Date | Ticker | Company | Insider Name | Insider Title | Trade Type | Price | Qty | Owned | ΔOwn | Value | 1d | 1w | 1m | 6m |
| | 2020-04-08 07:51:44 | 2020-03-30 | TMRR | Temir Corp. | Chan Kong Hoi | Pres, 10% | P - Purchase | \$14.10 | +410,560 | 629,350 | +188% | +\$5,788,896 | | | | |
| | 2020-04-07 16:16:12 | 2020-04-03 | NXRT | Nexpoint Residential Trust, Inc. | Dondero James D | Pres | P - Purchase | \$21.81 | +94,500 | 2,504,263 | +4% | +\$2,061,045 | | | | |
| D | 2020-04-07 16:03:12 | 2020-04-03 | SAIC | Science Applications International Corp | Keene Nazzic S | CEO | P - Purchase | \$70.75 | +14,300 | 102,331 | +16% | +\$1,011,769 | | | | |
| DM | 2020-04-07 16:47:29 | 2020-04-03 | LQDT | Liquidity Services Inc | Angrick William P III | COB, CEO, 10% | P - Purchase | \$4.23 | +114,382 | 5,898,122 | +2% | +\$484,309 | | | | |
| M | 2020-04-08 16:15:23 | 2020-04-06 | NREF | Nexpoint Real Estate Finance, Inc. | Dondero James D | Pres | P - Purchase | \$8.88 | +44,179 | 254,772 | +21% | +\$392,301 | | | | |
| | 2020-04-07 17:04:24 | 2020-04-06 | LYB | Lyondellbasell Industries N.V. | Patel Bhavesh V. | CEO | P - Purchase | \$49.35 | +4,654 | 372,764 | +1% | +\$229,675 | | | | |
| | 2020-04-07 18:40:24 | 2020-04-06 | APA | Apache Corp | Lannie P Anthony | Exec. Vice Pres, GC | P - Purchase | \$5.69 | +32,942 | 155,335 | +27% | +\$187,572 | | | | |
| M | 2020-04-06 17:41:29 | 2020-04-02 | GIII | G III Apparel Group Ltd /de/ | Goldfarb Morris | CEO, 10% | P - Purchase | \$5.63 | +30,749 | 3,923,675 | +1% | +\$172,970 | | | | |
| M | 2020-04-06 16:18:21 | 2020-04-02 | NREF | Nexpoint Real Estate Finance, Inc. | Dondero James D | Pres | P - Purchase | \$8.55 | +19,413 | 210,593 | +10% | +\$165,988 | | | | |
| A | 2020-04-06 14:58:07 | 2020-04-03 | EDI | Stone Harbor Emerging Markets Total Income Fund | Oliver David A | EVP | P - Purchase | \$5.94 | +19,239 | 19,239 | New | +\$114,280 | | | | |

<http://www.openinsider.com/>

Торговая стратегия на основе рыночных данных

1. Высчитывается сумма среднего количество продавцов по каждой акции входящей в индекс S&P500 (в процентах).
 $(100 - \text{shorts}) = \text{long}$
2. Копируем дату выхода новости.
Сопоставляем прогнозируемое значение с фактическим и пересчитываем разницу в процентах.
3. С сайта <http://www.openinsider.com/> извлекаем информацию по последним сделкам по всем акциям входящим в индекс S&P 500 и высчитываем разницу в процентах.