

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.