

Премаркет. Ежедневный обзор от 11.05.2017

Прогноз на день

Внешний фон на утро четверга располагает в популкам. Нефтяные котировки после вчерашнего ралли продолжают расти на 0,5%. Brent поднялась выше \$50 за баррель. Азиатские площадки торгуются на положительной территории.

Локальный рынок акций откроет торговую сессию ростом индекса ММВБ.

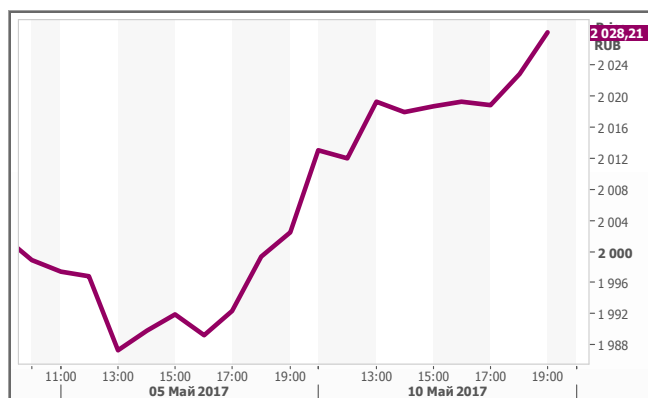
ММК представит финансовую отчетность по МСФО за 1 кв. 2017 г.

Мировые фондовые индексы

| Наименование индикатора | Цена закрытия | Изменение (%) | | |
|-------------------------|---------------|---------------|--------|--------|
| | | День | Месяц | Год |
| ММВБ | 2028,21 | 1,29 | 2,89 | 7,58 |
| PTC | 1111,64 | 2,39 | 2,53 | 23,91 |
| S&P500 | 2399,63 | 0,11 | 1,80 | 15,12 |
| DJIA | 20943,11 | -0,16 | 1,38 | 16,82 |
| NASDAQ | 6129,14 | 0,14 | 4,22 | 27,43 |
| VIX | 10,21 | 2,51 | -27,33 | -25,09 |
| DAX | 12757,46 | 0,07 | 4,56 | 27,00 |
| Nikkei | 19900,09 | 0,29 | 5,86 | 20,13 |
| Shanghai Com. | 3052,79 | -0,90 | -6,63 | 7,77 |
| BOVESPA | 67349,73 | 1,62 | 4,18 | 26,91 |

Источник: Bloomberg

График индекса ММВБ (60 мин.)



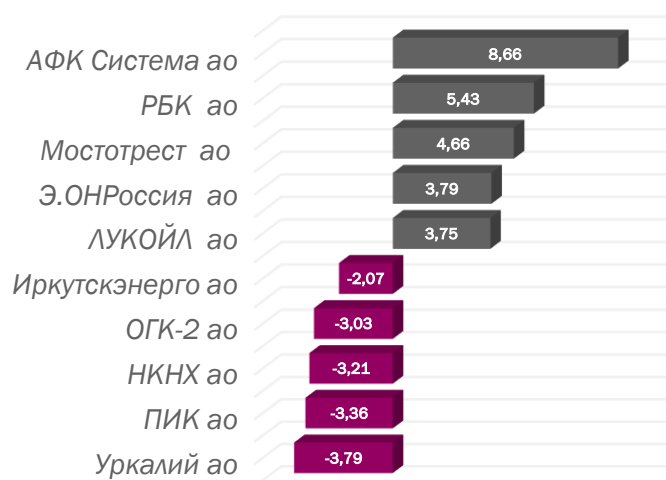
Источник: Reuters

Индикаторы валютного рынка

| Наименование индикатора | Цена закрытия | Изменение (%) | | |
|-------------------------|---------------|---------------|-------|--------|
| | | День | Месяц | Год |
| Индекс домара | 99,67 | 0,01 | -1,34 | 5,70 |
| USD/RUB | 57,44 | -0,86 | 0,47 | -13,38 |
| EUR/RUB | 62,48 | -1,94 | 3,19 | -17,09 |
| EUR/USD | 1,09 | -0,06 | 2,57 | -4,43 |
| GBP/USD | 1,29 | 0,02 | 4,21 | -10,41 |
| JPY/USD | 114,29 | 0,27 | 3,02 | 4,59 |
| CNY/USD | 6,90 | -0,04 | -0,04 | 5,92 |

Источник: Bloomberg

Лидеры роста/падения, % за день



Источник: Reuters

Индикаторы товарных рынков

| Наименование индикатора | Цена закрытия | Изменение (%) | | |
|-----------------------------|---------------|---------------|--------|--------|
| | | День | Месяц | Год |
| Нефть Brent (\$/бар) | 50,22 | 3,06 | -10,29 | 10,33 |
| Нефть WTI (\$/бар) | 47,33 | 3,16 | -10,83 | 5,98 |
| Золото (\$/унц) | 1219,10 | -0,17 | -2,84 | -3,69 |
| Серебро (\$/унц) | 16,20 | 0,04 | -9,78 | -5,36 |
| Платина (\$/унц) | 911,80 | 0,68 | -3,00 | -13,46 |
| Никель (\$/тонн) | 9071,50 | -1,06 | -10,57 | 2,90 |
| Медь (\$/тонн) | 5500,50 | -0,21 | -4,29 | 17,53 |
| Алюминий (\$/тонн) | 1859,25 | -0,27 | -3,10 | 17,90 |
| Натуральный газ | 3,29 | 2,01 | 1,67 | 52,55 |
| Уголь (\$/тонн) | - | 0,00 | -35,60 | 102,73 |

Источник: Bloomberg

Российские фондовые индексы в среду на фоне ралли нефтяных котировок показали активный рост. Рублевый индекс увеличился на 1,29%, до 2028,21 п. РТС прибавил 2,39%, завершив торги на отметке 1111,64 п.

В лидерах роста акции АФК Системы (+8,66%), по обороту эти бумаги также в числе первых. Акции пользовались спросом вчера у инвесторов после того, как на прошлой неделе капитализация Системы уменьшилась почти на треть на фоне предъявленного иска Роснефтью. Вчера же эта история получила продолжение. Иск к Системе на 106,6 млрд руб. московский суд не принял, но не успел рынок отреагировать на новость, как появилась информация о том, что иск был подан в 2 суда: в Москве и Уфе. Так что волатильность в бумагах сохранится, что повышает их привлекательность для спекулятивных сделок.

Позитивную динамику продемонстрировали вчера и акции Юнипро (+3,79%) (экс-Э.ОНРоссия). Менеджмент компании анонсировал выплату 7 млрд. руб. акционерам по итогам IV кв. 2016 – I кв. 2017 гг.: это эквивалентно 0,11 руб. на акцию (текущая дивидендная доходность 4,4%). За II-III кв. 2017 г. компания может заплатить еще 5 млрд. руб.

Локальный валютный рынок пережил майские праздники без особых потрясений. На вчерашних торгах рубль заметно укреплялся относительно доллара США и европейской валюты. Во-первых, наблюдался рост нефтяных котировок, которые прибавили 3% в связи с сокращением запасов нефти в США. Во-вторых, индекс доллара после достижения очередного локального максимума прекратил рост. Пара USDRUB снизилась до уровня 57,44 руб., при этом риск дальнейшего ослабления национальной валюты пока что сохраняется. Фактор кэрри-трейда, который на протяжении последних месяцев поддерживал спрос на валюту, постепенно будет терять свою силу, а зависимость от динамики нефтяных котировок, наоборот, увеличится. Отмечу, что не так давно и президент РФ Владимир Путин

высказался против укрепления рубля, но пока что действий от монетарных властей не последовало. Что касается евро, то вчера валюта перешла к коррекции после активного роста на фоне победы проевропейского кандидата Эммануэля Макрона на президентских выборах. Инвесторы фиксируют прибыль, реализуя принцип «покупай на слухах, продавай на фактах».

Цены на нефть ускорили свой рост на вчерашних торгах после выхода позитивных данных по запасам нефти в США. Нефть марки Brent вновь преодолела отметку в \$50 за баррель, а ее цена увеличилась на 3,06%, последний раз такой скачок цен наблюдался в декабре 2016 г., когда ОПЕК заключила соглашение о сокращении добычи нефти. В этот раз отчет EIA зафиксировал самое существенное снижение запасов в текущем году: -5,2 млн баррелей, прогноз: -1,8 млн. Такую динамику связывают с неблагоприятными погодными условиями в Мексиканском заливе, что ограничивает импорт. Что касается добычи, то на прошлой неделе она выросла на 21 тыс. баррелей, до 9,314 млн баррелей в сутки, при этом темпы ее роста постепенно сокращаются, а если тренд на снижение запасов продолжится, то для рынка это будет весомыми аргументом в пользу роста цен на нефть.

Источник: КИТ Финанс Брокер

Календарь событий

Макроэкономические события

| Время | Событие | Период | Ед. изм. | Регион | Прежнее | Прогноз |
|----------------|---|--------|------------|--------|---------|---------|
| Среда 10 мая | | | | | | |
| 17:30 | Запасы нефти по версии EIA | неделя | млн. барр. | US | -0,93 | -1,78 |
| Четверг 11 мая | | | | | | |
| 14:00 | Ключевая ставка Банка Англии | | | | | |
| 15:30 | Индекс цен производителей г/г | апрель | апрель | US | 2,30 | 2,20 |
| 15:30 | Первичные обращения за пособиями по безработице | неделя | тыс. | US | 238,00 | 245,00 |
| Пятница 12 мая | | | | | | |
| 09:00 | Индекс потребительских цен г/г | апрель | % | GE | 1,60 | 2,00 |
| 09:00 | ВВП первая оценка г/г | 1 кв. | % | GE | 0,40 | 0,60 |
| 12:00 | Промышленное производство г/г | март | % | US | 1,20 | 2,30 |
| 15:30 | Индекс потребительских цен г/г | апрель | % | US | 2,40 | 2,30 |
| 16:00 | Торговый баланс | март | млрд долл. | RU | 10,17 | 11,90 |

Календарь событий

Корпоративные события российского рынка акций

| Компания | Корпоративное событие |
|---------------------------|---|
| Среда 10 мая | |
| Сбербанк | Публикация финансовой отчетности по РСБУ за январь-апрель 2017 года |
| Юнипро | Публикация финансовых результатов по МСФО за 1 квартал 2017 года |
| Алроса | Публикация результатов продаж в апреле |
| Четверг 11 мая | |
| ММК | Публикация финансовых результатов по МСФО за 1 квартал 2017 года |
| VimpelCom | Публикация финансовых результатов по МСФО за 1 квартал 2017 года |
| Пятница 12 мая | |
| Русал | Публикация финансовых результатов по МСФО за 1 квартал 2017 года |
| Мосбиржа | Последний день для приобретения акций под дивиденды |
| Вторник 16 мая | |
| ТГК-1 | Публикация финансовых результатов по МСФО за 1 квартал 2017 года |
| Мосэнерго | Публикация финансовых результатов по МСФО за 1 квартал 2017 года |
| Среда 17 мая | |
| Черкизово | Публикация финансовых результатов по МСФО за 1 квартал 2017 года |
| ТМК | Публикация финансовых результатов по МСФО за 1 квартал 2017 года |
| Четверг 18 мая | |
| Русагро | Заседание совета директоров (специальные дивиденды) |
| Мосбиржа | Публикация финансовых результатов по МСФО за 1 квартал 2017 года |
| Пятница 19 мая | |
| Русагро | Публикация финансовых результатов по МСФО за 1 квартал 2017 года |
| Ростелеком | Публикация финансовых результатов по МСФО за 1 квартал 2017 года |
| Мечел | Публикация финансовых результатов по МСФО за 4 квартал 2016 года |
| ВТБ | Публикация финансовых результатов по МСФО за 1 квартал 2017 года |
| Среда 24 мая | |
| Сбербанк | Публикация финансовых результатов по МСФО за 1 квартал 2017 года |
| Пятница 26 мая | |
| Банк Санкт-Петербург | Публикация финансовых результатов по МСФО за 1 квартал 2017 года |
| Алроса | Публикация финансовых результатов по МСФО за 1 квартал 2017 года |
| ФосАгро | Публикация финансовых результатов по МСФО за 1 квартал 2017 года |
| Понедельник 29 мая | |
| ОГК-2 | Публикация финансовых результатов по МСФО за 1 квартал 2017 года |

Контакты

8 800 700 00 55

8 (812) 611 00 00

8 (495) 981 06 06

Санкт-Петербург, ул. Марата, 69-71

Бизнес-центр «Ренессанс Плаза»

Москва, Последний пер., 11, стр.1

Бизнес-центр «ЯН-РОН»

retail-saleskf@brokerkf.ru

www.brokerkf.ru

КИТ Финанс (АО).

Лицензии профессионального участника рынка ценных бумаг ФСФР России выданы на осуществление:

- дилерской деятельности № 040-06539-010000 от 14.10.2003,
- брокерской деятельности № 040-06525-100000 от 14.10.2003,
- деятельности по управлению ценными бумагами № 040-13670-001000 от 26.04.2012,
- депозитарной деятельности № 040-06467-000100 от 03.10.2003.

Без ограничения срока действия.

Настоящий обзор подготовлен исключительно в информационных целях.

Ни полностью, ни в какой-либо части не представляет собой предложение по покупке, продаже или совершению каких-либо сделок или инвестиций в отношении указанных в настоящем обзоре ценных бумаг и не является рекомендацией по принятию каких-либо инвестиционных решений.

Информация, использованная при подготовке настоящего обзора, получена из предположительно достоверных источников, однако проверка использованных данных не проводилась и КИТ Финанс (АО) не дает никаких гарантий корректности, содержащейся в настоящем обзоре информации. КИТ Финанс (АО) не обязан обновлять или каким-либо образом актуализировать настоящий обзор, однако КИТ Финанс (АО) имеет право по своему усмотрению, без какого-либо уведомления изменять и/или дополнять настоящий обзор и содержащиеся в нем рекомендации. Настоящий обзор не может быть воспроизведен, опубликован или распространен ни полностью, ни в какой-либо части, на него нельзя делать ссылки или проводить из него цитаты без предварительного письменного разрешения КИТ Финанс (АО). КИТ Финанс (АО) не несет ответственности за любые неблагоприятные последствия, в том числе убытки, причиненные в результате использования информации, содержащейся в настоящем обзоре, или в результате инвестиционных решений, принятых на основании данной информации.

Компания не несет ответственности за результаты инвестиционных решений, принятых Клиентом на основе настоящего обзора, аналитических материалов, рекомендаций, программного обеспечения, каких-либо файлов и/или иной информации, полученной Клиентом от Компании. Решение о совершении соответствующей сделки принимает только Клиент. Размер инвестированного капитала Клиента может увеличиваться или уменьшаться. Результаты инвестирования в прошлом не определяют доходы в будущем.

За совершение сделок с ценными бумагами взимается комиссионное вознаграждение в соответствии с тарифами КИТ Финанс (АО). Возможны комиссии третьих лиц.