

# Премаркет. Ежедневный обзор от 13.09.2016

## Прогноз на день

На утро вторника на внешних площадках складываются смешанные настроения. Нефтяные котировки после роста в понедельник находятся в отрицательной зоне. Азиатские рынки демонстрируют разнонаправленную динамику.

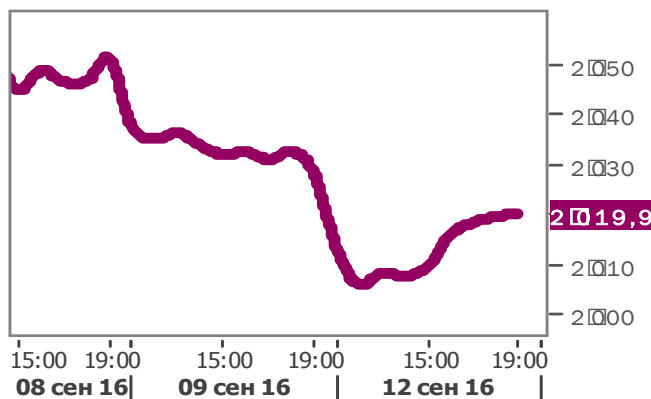
Открытие российского рынка акций ожидаем на нейтральной территории.

## Мировые фондовые индексы

| Наименование индикатора | Цена закрытия | Изменение (%) |       |        |
|-------------------------|---------------|---------------|-------|--------|
|                         |               | День          | Месяц | Год    |
| <b>ММВБ</b>             | 2019,90       | -0,41         | 2,68  | 17,57  |
| <b>PTC</b>              | 983,78        | -0,41         | 3,06  | 23,11  |
| <b>S&amp;P500</b>       | 2159,04       | 1,47          | -1,15 | 10,10  |
| <b>DJIA</b>             | 18325,07      | 1,32          | -1,35 | 11,51  |
| <b>NASDAQ</b>           | 5211,89       | 1,68          | -0,40 | 8,08   |
| <b>VIX</b>              | 15,16         | -13,37        | 31,26 | -34,66 |
| <b>DAX</b>              | 10431,77      | -1,34         | -2,63 | 3,04   |
| <b>Nikkei</b>           | 16672,92      | -1,73         | -1,46 | -8,71  |
| <b>Shanghai Com.</b>    | 3021,98       | -1,85         | -0,94 | -5,57  |
| <b>BOVESPA</b>          | 58586,11      | 1,01          | 0,49  | 26,26  |

Источник: Bloomberg

## График индекса ММВБ (60 мин.)



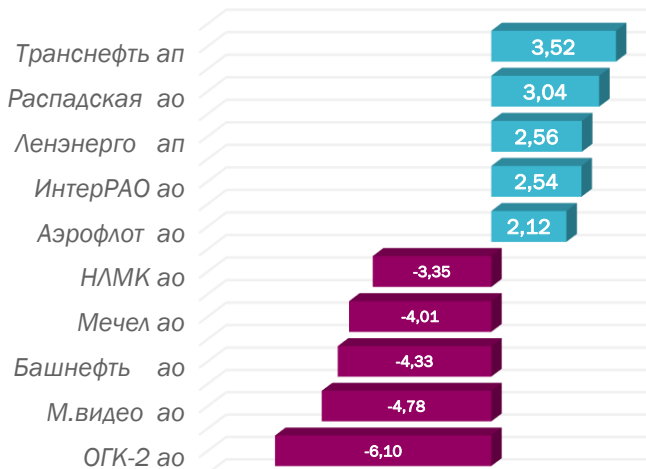
Источник: Reuters

## Индикаторы валютного рынка

| Наименование индикатора | Цена закрытия | Изменение (%) |       |        |
|-------------------------|---------------|---------------|-------|--------|
|                         |               | День          | Месяц | Год    |
| <b>Индекс долара</b>    | 95,10         | -0,25         | -0,66 | -0,10  |
| <b>USD/RUB</b>          | 64,59         | -0,36         | -0,25 | -4,91  |
| <b>EUR/RUB</b>          | 72,55         | -0,35         | 0,40  | -5,78  |
| <b>EUR/USD</b>          | 1,12          | 0,02          | 0,65  | -0,95  |
| <b>GBP/USD</b>          | 1,33          | 0,52          | 3,23  | -13,54 |
| <b>JPY/USD</b>          | 101,86        | -0,81         | 0,56  | -15,53 |
| <b>CNY/USD</b>          | 6,68          | -0,11         | 0,59  | 4,81   |

Источник: Bloomberg

## Лидеры роста/падения, % за день



Источник: Reuters

## Индикаторы товарных рынков

| Наименование индикатора     | Цена закрытия | Изменение (%) |       |        |
|-----------------------------|---------------|---------------|-------|--------|
|                             |               | День          | Месяц | Год    |
| <b>Нефть Brent (\$/бар)</b> | 48,32         | 0,65          | 2,87  | 0,37   |
| <b>Нефть WTI (\$/бар)</b>   | 46,29         | 0,89          | 4,05  | 3,72   |
| <b>Золото (\$/унц)</b>      | 1327,82       | 0,00          | -0,61 | 19,84  |
| <b>Серебро (\$/унц)</b>     | 19,11         | 0,32          | -3,05 | 30,77  |
| <b>Платина (\$/унц)</b>     | 1055,80       | -0,62         | -6,01 | 8,85   |
| <b>Никель (\$/тонн)</b>     | 10033,25      | -2,83         | -2,36 | -3,00  |
| <b>Медь (\$/тонн)</b>       | 4648,00       | 0,32          | -2,37 | -13,45 |
| <b>Алюминий (\$/тонн)</b>   | 1549,75       | -0,69         | -5,96 | -8,38  |
| <b>Натуральный газ</b>      | 2,92          | 4,22          | 12,72 | 8,24   |
| <b>Уголь (\$/тонн)</b>      | 40,00         | 0,00          | 1,27  | -5,88  |

Источник: Bloomberg

## ФРС США: словесные интервенции в действии

Российский рынок акций начал текущую неделю снижением, реагируя на волну распродаж на глобальном рынке, начавшуюся еще в прошлую пятницу. Негативный внешний фон, сформированный благодаря «ястребиным» высказываниям представителей ФРС США относительно повышения процентной ставки на ближайших заседаниях регулятора, а также коррекция на рынке нефти увеличивают рыночные индикаторы на отрицательную территорию. В моменте рублевый индекс ММВБ достигал уровня 2004,43 пункта. Между тем, к закрытию торгов рынку удалось сократить потери, в первую очередь, благодаря выходу нефтяных котировок в плюс. Потери индекса ММВБ составили -0,41%, индикатор достиг отметки 2019,90 пунктов, РТС, в свою очередь, также потерял 0,41%, снизившись до 983,78 пунктов.

Если говорить об отдельных историях, то в лидерах роста отметились акции Транснефти (+3,52%), Распадской (+3,04%), и Аэрофлота (+2,12%). ОГК-2 (-6,10%), Мечел ао (-4,01%) и Башнефть (-4,33%) в лидерах падения по итогу торгов в понедельник. Рост капитализации Распадской наблюдается уже шестую сессию подряд, за этот период цена акций взлетела более чем на 20%. Рост бумаг обеспечен существенным увеличением цен на уголь. Ралли на рынке угля, вызванное сокращением добычи в Китае и ограничением рабочих дней на шахтах страны, наблюдается уже с июля, с начала года цены на уголь выросли в 2 раза.

Что касается перспектив локального рынка акций, то основной тон торгам задают настроения на внешних площадках, в частности риторика монетарных властей США перед заседанием регулятора (21 сентября). До заседания ФРС остается чуть больше недели, а выступления представителей регулятора и их высказывания по поводу момента повышения ставки будоражат рынки.

В частности, словесные интервенции и намеки относительно того, что процентные ставки могут быть повышены уже на ближайшем заседании привели к масштабным распродажам на рынке акций США на прошлой неделе.

В понедельник, уже после закрытия торгов на Московской Бирже, выступила член совета управляющих ФРС США Лаэл Брейнард, которая традиционно придерживается «голубиной» риторики. В случае если ее тон сменился бы на «ястребиный», то можно было ожидать и продолжения коррекции на американском рынке акций. Однако, ситуация на рынке развернулась в пользу «быков» после «мягких» комментариев Лаэл Брейнарда.

Нефтяным котировкам во второй половине дня понедельника удалось выйти на положительную территорию после существенного снижения в пятницу. Марка Brent к 18:35 мск торговалась возле отметки \$48,3 за баррель (+0,77%). Положительная динамика на рынке «черного золота» значительно понизила градус напряжения на рынках, а также поддержала российский рубль. При условии отсутствия новых шоков, цены на нефть сегодня продемонстрируют «боковик», консолидируясь возле текущих уровней.

Пара USDRUB с расчетами «завтра» на валютной секции Московской Бирже к 18:45 вчера оценивалась в 64,71 руб., европейская валюта – 72,73 руб. Ранее доллар против рубля поднимался до 65,30 руб. Ожидаем, что сегодня движение рубля продолжится в диапазоне 64,50-65,35. В среду ждем данных по запасам нефти в США по версии EIA, которые традиционно оказывают влияния на динамику цен на нефть, а, следовательно, придают импульс рублю.

Источник: КИТ Финанс Брокер

## Календарь событий

### Макроэкономические события

| Время                                 | Событие   | Период  | Ед. изм.    | Регион | Прежнее      | Прогноз     |
|---------------------------------------|---|---------|-------------|--------|--------------|-------------|
| <b>Понедельник 12 сентября</b>        |   |         |             |        |              |             |
| Ежемесячный отчет ОПЕК                |   |         |             |        |              |             |
| 15:00                                 | Президент ФРБ Атланты Дэннис Локхарт выступит с речью                               |         |             |        |              |             |
| 20:00                                 | Управляющий ФРС Лаэл Брейнард выступит с речью                                      |         |             |        |              |             |
| 21:00                                 | Публикация месячного отчета EIA Drilling Productivity Report                        |         |             |        |              |             |
| <b>Вторник 13 сентября</b>            |   |         |             |        |              |             |
| 05:00                                 | Объем промышленного про-ва г/г  | август  | %           | CH     | 6,0          | 6,1         |
| 05:00                                 | Розничные продажи г/г   | август  | %           | CH     | 10,20        | 10,30       |
| 09:00                                 | ИПЦ Германии г/г (м/м)  | август  | %           | GE     | 0,40 (0,0)   | 0,40 (0,0)  |
| 11:30                                 | ИПЦ г/г (м/м)   | август  | %           | GB     | 0,60 (-0,10) | 0,70 (0,40) |
| 12:00                                 | Индекс экономической настроений ZEW   | август  |             | GE     | 0,5          | 2,5         |
| 21:00                                 | Отчет об исполнении федерального бюджета США  | август  | млрд. долл. | US     | -113,0       | -108,0      |
| <b>Среда 14 сентября</b>              |   |         |             |        |              |             |
| 07:30                                 | Объем промышленного про-ва м/м  | июль    | %           | JP     | 2,30         | -           |
| 12:00                                 | Объем промышленного про-ва м/м  | июль    | %           | EU     | 0,6          | -0,9        |
| 12:00                                 | Объем промышленного про-ва г/г  | июль    | %           | EU     | 0,4          | -0,7        |
| 17:30                                 | Запасы нефти в США (EIA)  | неделя  | Млн.        | US     | -14,51       | -           |
| <b>Четверг 15 сентября</b>            |   |         |             |        |              |             |
| Заседание Банка Англии (14:00 мск)    |   |         |             |        |              |             |
| Заседание Банка Швейцарии (10:30 мск) |   |         |             |        |              |             |
| 12:00                                 | ИПЦ г/г   | август  | %           | EU     | 0,2          | 0,2         |
| 15:30                                 | Индекс цен производителей г/г   | август  | %           | US     | -0,2         | 0,1         |
| 15:30                                 | Число первичных заявок на пособие по безработице                                    | неделя  | Тыс.        | US     | 259,00       | 265,00      |
| 16:15                                 | Объем промышленного про-ва м/м  | август  | %           | US     | 0,7          | -0,3        |
| <b>Пятница 16 сентября</b>            |   |         |             |        |              |             |
| Саммит ЕС по поводу Brexit'a          |   |         |             |        |              |             |
| 13:30                                 | Заседание ЦБ РФ, решение по ключевой ставке и публикация обновленного макропрогноза |         |             |        |              |             |
| 15:30                                 | ИПЦ м/м (г/г)   | август  | %           | US     | -/(0,80)     | 0,10/(1,0)  |
| 20:00                                 | Количество буровых установок в США (Baker Hughes)                                   | неделя. | ед.         | US     | 508          | -           |

## Календарь событий

### Корпоративные события российского рынка акций

| Компания                | Корпоративное событие   |
|-------------------------|---|
| Понедельник 12 сентября |   |
| ФСК ЕЭС                 | Заседание совета директоров                                       |
| Норникель               | Заседание совета директоров                                       |
| НМТП                    | Последний день для приобретение акций под дивиденды ( 0,467 руб.) |
| Вторник 13 сентября     |   |
| Среда 14 сентября       |   |
| НМТП                    | Закрытие реестра акционеров для получения дивидендов (0,467 руб.) |
| Транснефть              | Заседание совета директоров                                       |
| Северсталь              | Последний день для приобретение акций под дивиденды (19,66 руб.)  |
| Четверг 15 сентября     |   |
| Интер РАО               | Заседание совета директоров                                       |
| МТС                     | Заседание совета директоров                                       |
| Пятница 16 сентября     |   |
| Мегафон                 | Внеочередное общее собрание акционеров                            |
| Северсталь              | Закрытие реестра под выплату дивидендов за 1 полугодие 2016 г.    |

## 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](mailto:retail-saleskf@brokerkf.ru)  
[www.brokerkf.ru](http://www.brokerkf.ru)

КИТ Финанс (ООО).

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

- дилерской деятельности № 078-06539-010000 от 14.10.2003,
- брокерской деятельности № 078-06525-100000 от 14.10.2003,
- деятельности по управлению ценными бумагами № 178-13670-001000 от 26.04.2012,
- депозитарной деятельности № 178-06467-000100 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 (ООО) не дает никаких гарантий корректности, содержащейся в настоящем обзоре информации. КИТ Финанс (ООО) не обязан обновлять или каким-либо образом актуализировать настоящий обзор, однако КИТ Финанс (ООО) 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 (ООО). КИТ Финанс (ООО) 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.