Премаркет. Ежедневный обзор от 31.10.2016

Прогноз на день

Внешний фон перед открытием торгов на российском рынке акций складывается не в пользу покупателей. Открытие индекса ММВБ ожидаем на отрицательной территории.

На текущей неделе ожидается публикация большого объема макроэкономических данных, а также запланированы заседания Банка Японии, Англии и ФРС США.

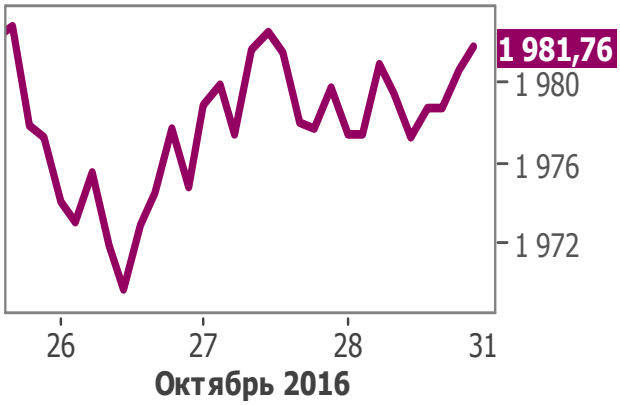
Из сегодняшних корпоративных событий отметим отчетность НЛМК, Мегафона и ТГК-1. Рекомендуем обратить внимание на акции Газпрома.

Мировые фондовые индексы

Наименование индикатора	Цена закрытия	Изменение (%)		
		День	Месяц	Год
ММВБ	1981,76	0,10	0,05	15,79
РТС	992,23	-0,04	1,73	17,35
S&P500	2126,41	-0,31	-2,07	2,26
DJIA	18161,19	-0,05	-0,97	2,82
NASDAQ	5190,10	-0,50	-2,42	2,70
VIX	16,19	5,40	30,67	7,43
DAX	10696,19	-0,19	2,47	-1,42
Nikkei	17446,41	0,63	5,96	-8,58
Shanghai Com.	3104,27	-0,26	3,90	-8,23
BOVESPA	64307,63	0,09	8,34	40,20

Источник: Bloomberg

График индекса ММВБ (60 мин.)



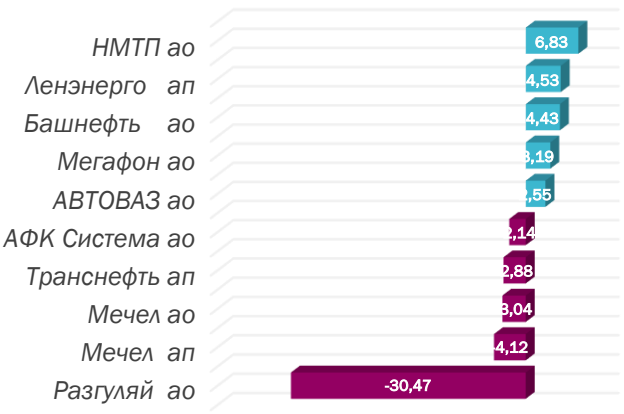
Источник: Reuters

Индикаторы валютного рынка

Наименование индикатора	Цена закрытия	Изменение (%)		
		День	Месяц	Год
Индекс домара	98,35	-0,55	3,06	1,45
USD/RUB	63,02	0,51	-0,03	-1,47
EUR/RUB	69,23	1,24	-2,05	-1,61
EUR/USD	1,10	0,67	-2,08	-0,21
GBP/USD	1,22	0,23	-6,36	-20,99
JPY/USD	104,73	-0,53	4,01	-13,17
CNY/USD	6,77	-0,15	1,55	7,25

Источник: Bloomberg

Лидеры роста/падения, % за день



Источник: Reuters

Индикаторы товарных рынков

Наименование индикатора	Цена закрытия	Изменение (%)		
		День	Месяц	Год
Нефть Brent ($/бар)	49,71	-1,51	2,09	0,30
Нефть WTI ($/бар)	48,70	-2,05	3,51	4,53
Золото ($/унц)	1275,47	0,56	-3,49	11,68
Серебро ($/унц)	17,76	0,73	-7,47	14,20
Платина ($/унц)	980,50	1,68	-4,78	-0,53
Никель ($/тонн)	10395,25	0,66	-2,62	2,64
Медь ($/тонн)	4843,00	1,11	0,52	-5,26
Алюминий ($/тонн)	1718,75	1,25	3,51	13,47
Натуральный газ	3,11	12,34	5,18	33,78
Уголь ($/тонн)	256,90	1,78	24,47	230,63

Источник: Bloomberg

Пятничные торги на глобальных площадках завершились с преобладанием пессимистичных настроений среди участников торгов. Американские фондовые индексы снизились на 0,3-0,5%, европейские индексы продемонстрировали околонулевую динамику. Аналогичное движение наблюдалось и на локальном рынке акций. Нефтяные котировки потеряли более 2% и завершили неделю в минусе впервые с начала сентября.

Рынок РФ в пятницу завершил торги разнонаправленным движением основных индикаторов. Индекс ММВБ прибавил +0,10%, РТС в свою очередь снизился на 0,04%. За прошедшую неделю рынок вырос на 1,2% по индексу ММВБ, в долларовом выражении рост составил лишь 0,6%.

В лидерах роста в пятницу отметились акции НМТП (+6,83%), Башнефти (+4,43%), Мегафона (+3,19%) и Россетей (+3,02%). В аутсайдерах: бумаги Группы «Разгуляй» (-30%), а также Мечела («префы» -4,12%, обыкновенные -3,04%) и Транснефти ап (-2,88%). По итогу недели рост обыкновенных акций Башнефти составил 12,34%, что связано в первую очередь с новостью о подачи Роснефти заявки в ФАС на приобретение 100% Башнефти.

Акции Россетей в пятницу продолжили свой рост на фоне публикации сильных финансовых показателей за 9 мес. по РСБУ в прошлый четверг. Существенный рост доходов компании повышает вероятность увеличения дивидендных выплат, в частности по «префам» Россетей, что, безусловно, положительным образом отразится на стоимости акций компании.

В пятницу МЭР внесло на рассмотрение программу приватизации, рассчитанную на 2017-2019 гг. Программа подразумевает приватизацию ряда крупнейших госкомпаний (Совкомфлот, банк ВТБ, НМТП, Транснефть, РЖД, Ростелеком, Алроса и др.). Поступления в бюджет от реализации данного проекта оцениваются в 200-300 млрд. руб в год. Конкретные сроки и детали сделок будут определяться правительством с учетом конъюнктуры рынка, а также при помощи ведущих инвестиционных консультантов.

увеличением риска признания компании банкротом после того, как урегулировать требования основного кредитора не удалось во внесудебном порядке. В свою очередь, банкротство компании означает распродажу активов по бросовым ценам и последующую ликвидацию.

Итогами заседания совета директоров Лукойла в пятницу стали утверждение нового положения о дивидендной политики и рекомендация выплатить акционерам промежуточные дивиденды за 9 мес. в размере 75 руб. на 1 акцию, что превышает размер дивидендов на аналогичный период 2015 г. на 15%. Текущая дивидендная доходность составляет 2,4%. Закрытие реестра на получение дивидендов пройдет 23 декабря, с учетом режима торгов «Т+2» последний день для приобретения акций – 21 декабря. Новая дивидендная политика подразумевает выплату акционерам не менее 25% консолидированной прибыли по МСФО. Кроме того, компания намерена ежегодно увеличивать размер дивидендов на 1 акцию не менее чем на уровень инфляции рубля.

ЦБ РФ ожидаемо не изменил размер ключевой ставки, оставив ее на уровне 10%, по итогам заседания, прошедшего в пятницу. В условиях неустойчивого снижения инфляционных ожиданий регулятор подтвердил свои намерения сохранить текущий уровень ставок до конца года, к вопросу смягчения ЦБ планирует вернуться не раньше 1-2 квартала 2017 г. Напомним, что до конца года остается лишь одно заседание регулятора (16 декабря), которое будет сопровождаться публикацией Доклада о денежно-кредитной политике (ДКП) и пресс-конференцией главы Банка России.

На динамику локального рынка на текущей неделе окажет влияние заседание ФРС США, итоги которого станут известны в среду, 2 ноября, а также публикация макроэкономических данных, под влиянием которых будут формироваться настроения на глобальном рынке.

Источник: КИТ Финанс Брокер

Календарь событий

Макроэкономические события

Время	Событие	Период	Ед. изм.	Регион	Прежнее	Прогноз
Понедельник 31 октября						
Заседание Банка Японии						
10:00	Розничные продажи г/г (м/м)	сентябрь	%	GE	3,80 (-0,30)	1,50 (0,20)
13:00	Индекс потребительских цен г/г	3 кв.	%	EU	0,40	0,50
13:00	ВВП г/г (кв/кв)	3 кв.	%	EU	1,60 (0,30)	1,60 (0,30)
15:30	Ценовой индекс потребительских расходов г/г (м/м)	сентябрь	%	US	1,00 (0,10)	- (-)
Вторник 1 ноября						
04:00	Индекс деловой активности в промышленности	октябрь	-	CH	50,40	50,40
04:00	Индекс деловой активности в сфере услуг	октябрь	-	CH	53,70	-
04:45	Индекс деловой активности в промышленности Caixin	октябрь	-	CH	50,10	50,20
09:00	Индекс деловой активности в промышленности	октябрь	-	RU	51,10	-
12:30	Индекс деловой активности в промышленности	октябрь	-	GB	55,40	54,50
17:00	Индекс деловой активности в промышленности ISM	октябрь	-	US	51,50	51,50
23:30	Запасы нефти по данным Американского Института нефти (API)	неделя	млн. барр.	US	4,80	-
Среда 2 ноября						
11:55	Уровень безработицы	октябрь	%	GE	6,10	6,10
11:55	Индекс деловой активности в промышленности	октябрь	-	GE	54,30	55,10
12:00	Индекс деловой активности в промышленности	октябрь	-	EU	52,60	53,30
15:15	Число созданных рабочих мест в частном секторе ADR	октябрь	тыс.	US	154,00	163,00
17:30	Запасы нефти по данным EIA	неделя	млн. барр.	US	-0,55	-
21:00	Итоги заседания ФРС США. Размер процентной ставки	ноябрь	%	US	0,38	0,38
Четверг 3 ноября						
Заседание Банка Англии						
08:00	Индекс деловой активности в сфере услкг	октябрь	-	RU	53,00	-
15:30	Первичные обращения за пособиями по безработице	неделя	тыс.	US	258	-
16:00	Индекс потребительских цен г/г	октябрь	%	RU	6,40	-
17:00	Индекс деловой активности в сфере услуг ISM	октябрь	-	US	57,10	56,00
Пятница 4 ноября						
11:55	Индекс деловой активности в сфере услуг	октябрь	-	GE	50,90	54,10
12:00	Индекс деловой активности в сфере услуг	октябрь	-	EU	52,20	53,50
15:30	Количество, созданных рабочих мест вне с/х секторе (non-farm payrolls)	октябрь	тыс.	US	156,00	170,00
20:00	Количество буровых установок по данным Baker Hughes	неделя	ед.	US	557	-

Календарь событий

Корпоративные события российского рынка акций

Компания	Корпоративное событие
Понедельник 31 октября	
НЛМК	Публикация финансовых показателей по МСФО за 9 месяцев 2016 г.
Мегафон	Публикация финансовых показателей по МСФО за 9 месяцев 2016 г.
ТГК-1	Публикация операционных результатов за 9 месяцев 2016 г.
Вторник 1 ноября	
Энел Россия	Публикация финансовых результатов по МСФО за 9 месяцев 2016 г.
Среда 2 ноября	
Московская Биржа	Публикация данных по обороту торгов
ТГК-1	Публикация финансовых результатов по РСБУ за 9 месяцев 2016 г.
Четверг 3 ноября	
Энел Россия	Публикация финансовых результатов по РСБУ за 9 месяцев 2016 г.
VimpelCom	Публикация финансовых результатов по МСФО за 9 месяцев 2016 г.
Пятница 4 ноября	
Аэрофлот	Публикация финансовых результатов по РСБУ за 9 месяцев 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
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.