Премаркет. Ежедневный обзор от 02.11.2016

Прогноз на день

Сегодня традиционно ждем данных по запасам нефти в США по версии Управления энергетической информации (EIA). Консенсус - прогноз указывает на рост запасов на 1 млн. баррелей в сутки.

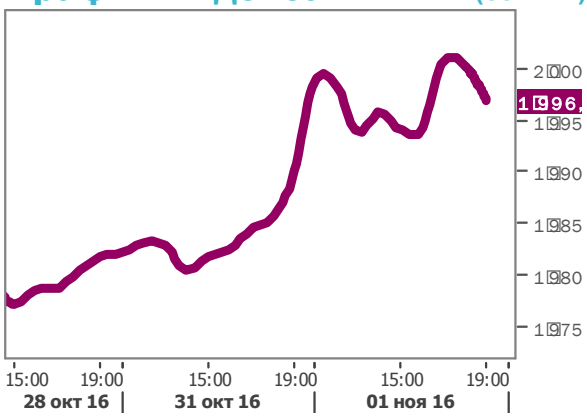
Особого внимания инвесторов в акции заслуживают итоги 2-х дневного заседания ФРС США. Изменения денежно-кредитной политики в этот раз рынок не ждет, все внимание на риторику регулятора.

Мировые фондовые индексы

Наименование индикатора	Цена закрытия	Изменение (%)		
		День	Месяц	Год
ММВБ	1996,87	0,36	0,95	15,04
РТС	996,63	0,80	0,58	16,73
S&P500	2111,72	-0,68	-2,61	0,36
DJIA	18037,10	-0,58	-1,48	1,17
NASDAQ	5153,58	-0,69	-2,98	0,52
VIX	18,56	8,79	39,65	31,17
DAX	10526,16	-1,30	0,14	-3,88
Nikkei	17442,40	0,10	6,03	-6,64
Shanghai Com.	3122,44	0,71	3,92	-6,09
BOVESPA	63326,42	-2,46	8,50	38,06

Источник: Bloomberg

График индекса ММВБ (60 мин.)



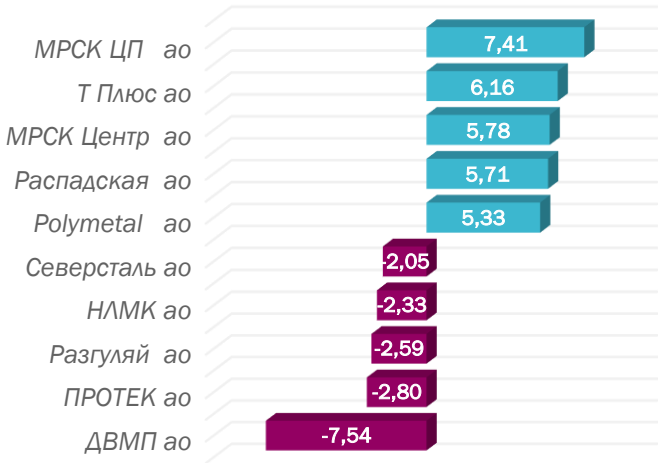
Источник: Reuters

Индикаторы валютного рынка

Наименование индикатора	Цена закрытия	Изменение (%)		
		День	Месяц	Год
Индекс домара	97,70	-0,76	2,34	0,80
USD/RUB	63,32	-0,09	0,82	-0,54
EUR/RUB	70,00	0,54	-0,95	-0,09
EUR/USD	1,11	0,67	-1,65	0,35
GBP/USD	1,22	-0,01	-5,66	-20,58
JPY/USD	104,15	-0,64	2,78	-13,75
CNY/USD	6,76	-0,10	1,44	6,70

Источник: Bloomberg

Лидеры роста/падения, % за день



Источник: Reuters

Индикаторы товарных рынков

Наименование индикатора	Цена закрытия	Изменение (%)		
		День	Месяц	Год
Нефть Brent ($/бар)	48,14	-0,33	-1,88	-1,33
Нефть WTI ($/бар)	46,67	-0,41	-3,25	1,15
Золото ($/унц)	1288,20	0,86	-2,10	13,61
Серебро ($/унц)	18,36	2,53	-4,23	19,05
Платина ($/унц)	992,05	1,03	-3,31	1,52
Никель ($/тонн)	10367,00	-0,68	-1,75	1,67
Медь ($/тонн)	4920,00	1,38	1,13	-4,00
Алюминий ($/тонн)	1734,25	0,01	3,93	13,37
Натуральный газ	2,90	-4,10	-0,14	28,63
Уголь ($/тонн)	258,50	0,31	21,13	237,03

Источник: Bloomberg

Европейские индексы (DAX -1,38%, CAC 40 -0,86%, FTSE 100 -0,53%) наряду с американскими индикаторами (S&P500 -0,68%, NASDAQ -0,69%, DJIA -0,58%) завершили торги во вторник на отрицательной территории. Российскому рынку акций удалось начать месяц более позитивно. Поддержку рынку оказала положительная динамика нефтяных котировок и макроэкономических данных.

В течение вчерашней торговой сессии индекс ММВБ коснулся уровня 2000 пунктов, хотя закрепиться сил пока не хватило. К закрытию торгов значение рублевого индикатора составило 1996,87 пунктов, рост относительно уровня закрытия понедельника составил всего 0,36%.

Промышленный сектор РФ постепенно набирает обороты. Так, индекс PMI, отражающий деловую активность в промышленности, в октябре вырос до рекордного уровня с 2012 года и составил 52,4 пункта. Для сравнения в сентябре показатель находился на уровне 51,1. Рост индекса указывает на улучшения в условиях операционной деятельности компаний. Ложной дегтя в этой бочке меда выступает сохраняющаяся тенденция сокращения рабочих мест, наблюдаемая на протяжении последних 4 месяцев.

Сегодня особого внимания инвесторов заслуживают итоги 2-х дневного заседания ФРС США. Изменения денежно-кредитной политики в этот раз рынок не ждет, все внимание на риторику регулятора, в которой возможно прозвучат намеки относительно вероятности повышения ставки на декабрьском заседании. И в случае таковых американский доллар получит поддержку, что негативным образом может сказаться на ценах на нефть и рубль.

Другой темой, которая по-прежнему держит мировые финансовые рынки в напряжении, являются президентские выборы в США. До дня голосования остается уже меньше недели. Если ранее рынок закладывал в котировки победу Хиллари Клинтон, то в последнее время конкуренция кандидатов, согласно опросам общественного мнения, обострилась. Неопределенность относительно итогов голосования, безусловно, повышает нервозность на рынке. На этом фоне доллар США испытывает краткосрочное давление, а цены на золото наряду с «индексом страха» VIX обновляют месячные максимумы.

Тем временем, индекс деловой активности в производственном секторе США, на который приходится примерно 12% экономики, за прошлый месяц вырос выше прогнозов: 51,9 при ожидаемых 51,6. В сентябре данный показатель составил 51,5.

Цены на нефть во вторник демонстрировали положительную динамику, после того, как накануне страны ОПЕК достигли соглашения по долгосрочной стратегии развития картеля. Рынок расценил данный шаг как указание на возможное достижение сокращения нефти на встрече в конце ноября. С другой стороны, рост нефтяных котировок сдерживается наличием существующего переизбытка нефти на рынке. Согласно данным Рейтерс, ОПЕК в октябре могла добыть рекордный объем нефти (33,82 млн. баррелей), увеличение произошло за счет частичного восстановления производства в Нигерии и Ливии, а также за счет увеличения экспорта в Ираке.

Сегодня традиционно ждем данных по запасам нефти в США по версии Управления энергетической информации (EIA). Консенсус - прогноз указывает на рост запасов на 1 млн. баррелей в сутки.

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 услуг	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.
Магнит	Заседание совета директоров (дивиденды)
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.