Премаркет. Ежедневный обзор от 03.11.2016

Прогноз на день

Длинные выходные накануне такого фактора волатильности, как президентские выборы в США не способствуют покупкам рисковых активов.

Ближе ко второй половине дня продажи российских акций могут усилиться.

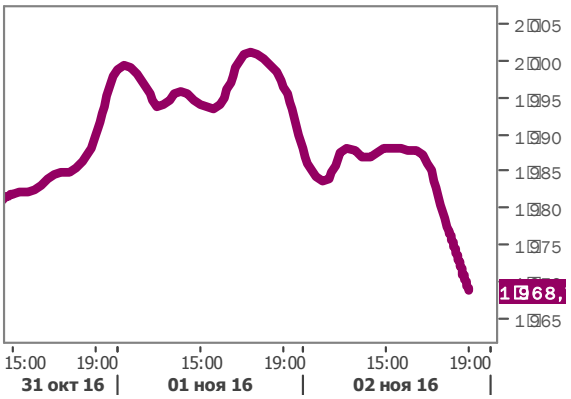
Воспользоваться этим можно, выбирая хорошие акции по хорошей цене: к примеру, нам очень нравятся бумаги ФСК ЕЭС в преддверии публикации отчетности по МСФО за III кв.

Мировые фондовые индексы

Наименование индикатора	Цена закрытия	Изменение (%)		
		День	Месяц	Год
ММВБ	1968,77	-1,41	-0,91	11,63
РТС	973,09	-2,36	-3,15	9,78
S&P500	2097,94	-0,65	-2,93	-0,56
DJIA	17959,64	-0,43	-1,61	0,23
NASDAQ	5105,57	-0,93	-3,68	-0,77
VIX	19,32	4,09	42,37	32,87
DAX	10370,93	-1,47	-1,33	-5,30
Nikkei	17134,68	-1,76	3,23	-8,29
Shanghai Com.	3102,73	-0,63	3,26	-6,45
BOVESPA	63326,42	0,00	6,50	31,78

Источник: Bloomberg

График индекса ММВБ (60 мин.)



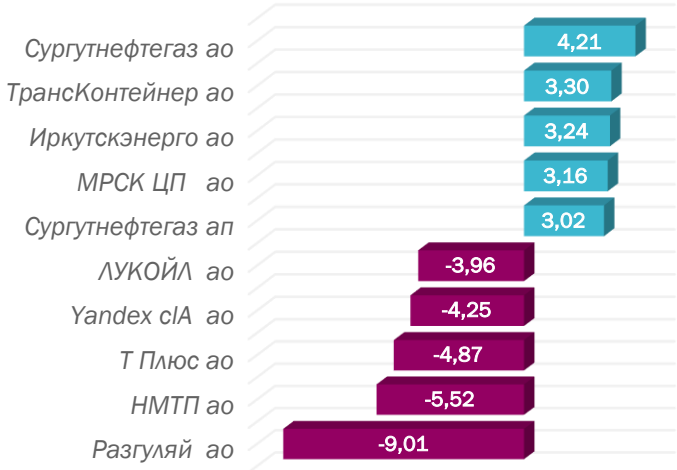
Источник: Reuters

Индикаторы валютного рынка

Наименование индикатора	Цена закрытия	Изменение (%)		
		День	Месяц	Год
Индекс домара	97,40	-0,31	1,78	0,25
USD/RUB	63,52	0,31	1,97	1,42
EUR/RUB	70,48	0,69	1,01	2,64
EUR/USD	1,11	0,38	-1,03	1,21
GBP/USD	1,23	0,50	-4,19	-20,21
JPY/USD	103,31	-0,81	1,63	-14,67
CNY/USD	6,75	-0,14	1,22	6,51

Источник: Bloomberg

Лидеры роста/падения, % за день



Источник: Reuters

Индикаторы товарных рынков

Наименование индикатора	Цена закрытия	Изменение (%)		
		День	Месяц	Год
Нефть Brent ($/бар)	46,86	-2,66	-7,92	-7,28
Нефть WTI ($/бар)	45,34	-2,85	-7,11	-5,34
Золото ($/унц)	1296,81	0,67	-1,13	16,02
Серебро ($/унц)	18,48	0,65	-1,78	20,93
Платина ($/унц)	990,55	-0,15	-1,63	2,89
Никель ($/тонн)	10279,00	-0,85	-0,42	3,10
Медь ($/тонн)	4920,00	0,00	2,10	-4,00
Алюминий ($/тонн)	1724,00	-0,59	3,09	12,04
Натуральный газ	2,79	-3,79	-4,48	23,92
Уголь ($/тонн)	265,50	2,71	24,41	246,61

Источник: Bloomberg

Нефтяные котировки в среду резко обвалились после публикации данных о запасах в США. По оценке EIA запасы нефти за неделю выросли на 14,4 млн. барр., это в 14 раз (!) больше прогнозов. В моменте котировки Brent были ниже $46,5 за барр., WTI – ниже $45,0 за барр.

Конечно же, столь существенное снижение нефти не могло не сказаться на российской валюте и акциях. Валютные пары USD/RUB и EUR/RUB в четверг утром торгуются вблизи локальных максимумов – 63,5 и 70,5 соответственно. Динамика валют в свою очередь способствовала покупкам наиболее «долларозависимых» акций – Сургутнефтегаза и производителей удобрений – Акрона и Фосагро, хотя в перспективе ближайших месяцев эти бумаги по-прежнему малоинтересны.

Другая обращающая на себя внимание тенденция последних дней – рост цен драгоценных металлов (золото за среду +0,7%, серебро +0,6%). Благодаря этому продолжился отскок акций Полиметалла, прибавивших за день 1,2%. Эти бумаги следует подержать в портфеле как минимум до следующей недели.

Индекс ММВБ накануне подешевел на 1,4%, РТС потерял 2,4%. Слабо торговались бумаги Сбербанка (-2,4%) и особенно Лукойла (-4,0%). Рынок явно негативно отреагировал на опубликованную в прессе информацию касательно возможности участия Лукойла в приватизации Роснефти.

ФРС США ожидаемо сохранила ключевую ставку в диапазоне 0,25-0,50%. Американский рынок акций отреагировал на это снижением в пределах 0,6%. С процентными ставками все относительно понятно, поэтому инвесторов в американские акции больше волнует исход президентских выборов, до которых осталось меньше недели. На этом фоне «индекс страха» - VIX вырос накануне еще на 4,1%, за последние семь сессий индикатор подорожал на 48,4%.

Азиатские индексы в четверг утром демонстрируют разнонаправленную динамику, но биржи материкового Китая растут: Shanghai Comp. прибавляет 1,1%. Нефтяные котировки тоже отскакивают – Brent в плюсе на 1,2%. Благодаря этому торги на Московской Бирже начнутся с небольшим повышением, в пределах 0,5% по индексу ММВБ.

Давление на акции Лукойла сохранится, время для покупок этих бумаг пока не пришло. Да и длинные выходные накануне такого фактора волатильности, как президентские выборы в США не способствуют покупкам рисковых активов. Поэтому ближе ко второй половине дня продажи российских акций могут усилиться. Воспользоваться этим можно, выбирая хорошие акции по хорошей цене: к примеру, нам очень нравятся бумаги ФСК ЕЭС в преддверии публикации отчетности по МСФО за III кв.

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						
11:30	ВВП , первая оценка г/г (кв/кв)	3 кв.	%	GB	2,20 (0,60)	2,10 (0,30)
15:30	Первичные обращения за пособиями по безработице	неделя	тыс.	US	260	-
15:30	Заказы на товары длительного пользования	сентябрь	%	US	-0,90	1,00
Пятница 4 ноября						

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.