Премаркет. Ежедневный обзор от 20.01.2017

Прогноз на день

На утро пятницы на внешних площадках складывается умеренно позитивный фон. Американский рынок готовится к инаугурации Дональда Трампа. Нефтяные котировки умеренно растут, марка Brent оценивается в $54,28 за баррель. Открытие локального рынка акций ожидаем на нейтральной территории.

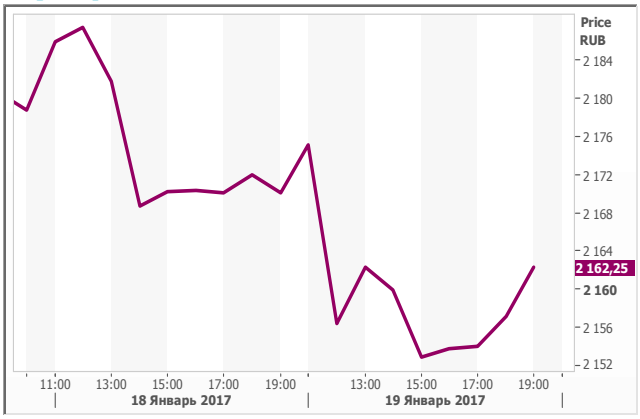
Из корпоративных новостей отметим операционные результаты Северстали.

Мировые фондовые индексы

Наименование индикатора	Цена закрытия	Изменение (%)		
		День	Месяц	Год
ММВБ	2162,25	-0,36	-2,88	32,62
РТС	1136,62	-1,31	-0,52	80,87
S&P500	2263,69	-0,36	-0,31	21,75
DJIA	19732,40	-0,37	-1,21	25,15
NASDAQ	5540,08	-0,28	1,02	23,89
VIX	12,78	2,40	11,62	-53,68
DAX	11596,89	-0,02	1,15	23,48
Nikkei	19072,25	0,94	-2,17	16,18
Shanghai Com.	3101,30	-0,38	-0,05	4,19
BOVESPA	63950,86	-0,31	11,06	69,88

Источник: Bloomberg

График индекса ММВБ (60 мин.)



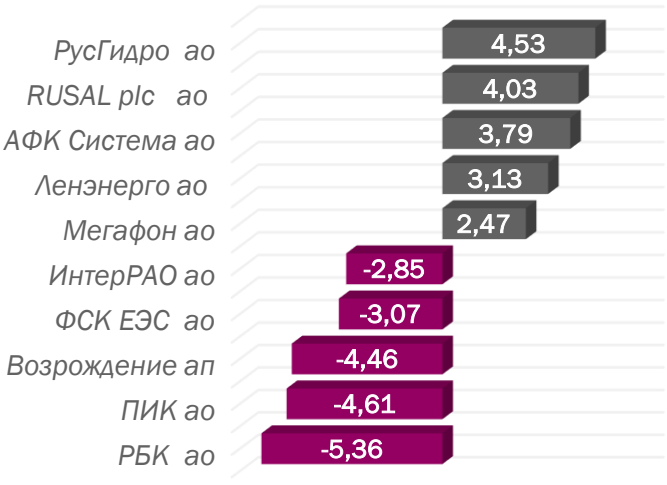
Источник: Reuters

Индикаторы валютного рынка

Наименование индикатора	Цена закрытия	Изменение (%)		
		День	Месяц	Год
Индекс домара	101,15	0,22	-2,07	2,08
USD/RUB	59,72	0,27	-2,83	-26,63
EUR/RUB	63,70	0,64	-0,23	-28,14
EUR/USD	1,07	0,32	2,65	-2,08
GBP/USD	1,23	0,65	-0,19	-13,02
JPY/USD	114,86	0,19	-2,55	-1,78
CNY/USD	6,88	0,11	-0,90	4,53

Источник: Bloomberg

Лидеры роста/падения, % за день



Источник: Reuters

Индикаторы товарных рынков

Наименование индикатора	Цена закрытия	Изменение (%)		
		День	Месяц	Год
Нефть Brent ($/бар)	54,16	0,45	-2,15	94,26
Нефть WTI ($/бар)	51,37	0,57	-1,65	93,48
Золото ($/унц)	1204,85	0,05	6,40	9,44
Серебро ($/унц)	17,02	-0,23	5,72	20,26
Платина ($/унц)	959,38	-0,43	4,00	16,86
Никель ($/тонн)	9888,50	-2,48	-9,32	14,16
Медь ($/тонн)	5739,50	-0,51	4,32	31,67
Алюминий ($/тонн)	1824,00	-0,38	6,12	21,84
Натуральный газ	3,37	2,00	3,22	59,02
Уголь ($/тонн)	172,60	-1,88	-32,60	125,03

Источник: Bloomberg

Индекс ММВБ вчера закрылся ниже 2 170 п. Рублевый индикатор снизился на 0,36%, до 2 162,25 п. РТС потерял 1,31% и достиг 1 136,62 п. Текущую неделю рынок провел в «красной» зоне, потеряв за этот период 1,5% по индексу ММВБ. Вчерашним ньюсмейкером стал вице-премьер Игорь Шувалов, заставивший участников торгов поволноваться. Его заявления относительно размера дивидендных выплат госкомпаниями оказали давление на рынок. Так, И. Шувалов заявил: «Мы сейчас обсуждаем проект решения правительства по дивидендам госкомпаний. Я поддерживаю позицию министра экономического развития Максима Орешкина, который говорит, что не нужно принимать решения, которые изобилуют исключениями». «Каждую компанию будем анализировать индивидуально, чтобы определить, кто может заплатить более высокие, чем в прошлом году, дивиденды». Напомним, что на прошлой неделе проект распоряжения о продлении требования к российским госкомпаниям возвращать 50% прибыли в виде дивидендов был возвращен на доработку в министерство финансов.

Негативно на заявления Шувалова отреагировали акции Роснефти (-1,61%), а также Газпрома (-1,31%), в моменте бумаги дешевели до 148,23 руб. На текущем уровне Газпром становится интересен к спекулятивным покупкам.

В лидерах снижения также отметились ФСК ЕЭС (-3,06%), Интер РАО (-2,85%) и ДИКСИ (-2,77%). Лучше рынка выглядели акции РусГидро (+4,53%), RUSAL plc (+4,03%), а также АФК Система (+3,79%).

Не оставил без внимание Игорь Шувалов и валютный рынок. В первой половине торгов национальная валюта отреагировала падением на заявления первого вице-премьера РФ о возможности покупки валюты с целью пополнения резервов. На этих заявлениях рубль снизился против доллара США до отметки 60,27 руб., против европейской валюты – до 64,24 руб. Позже шок от словесных интервенций был нивелирован, что позволило рублю вернуться к своим привычным уровням на текущей неделе. Слова г-на Шувалова - это не более чем вербальная интервенция. И ранее высокопоставленные чиновники анонсировали возможный выход ЦБ на рынок в целях покупки валютной ликвидности, при этом реакция рынка была или нулевой, или совсем короткой. Так что когда-нибудь ЦБ на рынок выйдет, вопрос в том – какой уровень для ЦБ будет «красной тряпкой»? 60 руб. за доллар при текущей цене на нефть – сомнительно, бюджет и так получает сверхдоходы за счет 20%-ного превышения фактической цены барреля нефти в рублях над заложенной ценой при планировании. Иными словами, нынешний курс рубля при нынешней цене нефти для бюджета вполне комфортен, как и любой другой уровень, предполагающий премию к заложенным в бюджете бенчмарком – цене нефти в рублях около 2700 руб./баррель.

Источник: КИТ Финанс Брокер

Календарь событий

Макроэкономические события

Время	Событие	Период	Ед. изм.	Регион	Прежнее	Прогноз
Понедельник 16 января						
Американские торговые площадки (NYSE, NASDAQ) закрыты по случаю Национального выходного – «День Мартина Лютера Кинга. Торги на CME (фьючерсы на нефть и индексы) проводятся до 21:00 мск.						
13:00	Торговый баланс	Ноябрь	Млрд. евро	EU	20,10	22,00
16:00	Торговый баланс	Ноябрь	Млрд. долл.	RU	6,60	7,20
Вторник 17 января						
12:00	Индекс потребительских цен г/г	Декабрь	%	GB	1,20	1,40
13:00	Индекс экономических ожиданий ZEW	январь	-	GE	13,80	16,50
Среда 18 января						
Публикация месячного отчета ОПЕК по рынку нефти						
10:00	Индекс потребительских цен г/г	Декабрь	%	GE	0,80	1,70
13:00	Индекс потребительских цен г/г	Декабрь	%	EU	0,60	1,10
16:30	Индекс потребительских цен г/г	Декабрь	%	US	1,70	-
17:15	Промышленное производство	Декабрь	%	US	-0,40	0,40
22:00	Публикация «Бежевой книги»					
Четверг 19 января						
Публикация месячного отчета МЭА по рынку нефти						
15:45	Размер процентной ставки ЕЦБ					
16:30	Первичные обращения за пособиями по безработице	неделя	Тыс.	US	247,00	-
19:00	Запасы нефти EIA	Неделя	Барр.	US	4,10	-
Пятница 20 января						
Избранный президент США Д.Трамп вступает в должность						
Встреча комитета нефтедобывающих стран в Вене (20-21 января)						
05:00	ВВП кв/кв	4кв.	%	CH	1,80	1,70
05:00	ВВП г/г	4кв.	%	CH	6,70	6,70
05:00	Промышленное производство г/г	4кв.	%	CH	6,20	6,10
05:00	Количество буровых установок по данным Baker Hughes	Неделя	Ед.	US	522	-

Календарь событий

Корпоративные события российского рынка акций

Компания	Корпоративное событие
Понедельник 16 января	
Газпром	Заседание совета директоров
КАМАЗ	Заседание совета директоров
ТМК	Заседание совета директоров
Вторник 17 января	
ЛСР	Публикация операционных результатов компании за 4 кв. 2016 г.
Среда 18 января	
НЛМК	Публикация операционных результатов компании за 4 кв. 2016 г.
Четверг 19 января	
АЛРОСА	Публикация операционных результатов компании за 4 кв. 2016 г.
ДИКСИ	Публикация операционных результатов компании за 4 кв. 2016 г.
Пятница 20 января	
ЕВРАЗ	Публикация операционных результатов компании за 4 кв. 2016 г.
Северсталь	Публикация операционных результатов компании за 4 кв. 2016 г.

Корпоративные события американского рынка акций

Компания	Корпоративное событие	Прогноз EPS
Вторник 17 января		
Morgan Stanley	Квартальные финансовые результаты	0,65
Среда 18 января		
ASML Holding	Квартальные финансовые результаты	1,05
Citigroup	Квартальные финансовые результаты	1,12
Goldman Sachs	Квартальные финансовые результаты	4,82
US Bancorp	Квартальные финансовые результаты	0,81
Четверг 19 января		
American Express	Квартальные финансовые результаты	0,98
Bank of NY Mellon	Квартальные финансовые результаты	0,77
IBM	Квартальные финансовые результаты	4,89
Пятница 20 января		
General Electric	Квартальные финансовые результаты	0,46

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 № 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 (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.