Премаркет. Ежедневный обзор от 06.03.2017

Прогноз на день

Внешний фон перед открытием торгов складывается умеренно негативный. Открытие локального рынка акций пройдет чуть ниже пятничного уровня.

На текущей неделе ожидается выход блока макроэкономических данных, которые способны оказать влияние как на общее настроение на глобальных рынках, так и на локальную валюту (подробнее в Календаре событий, стр. 3). Кроме того, в четверг запланировано заседание ЕЦБ.

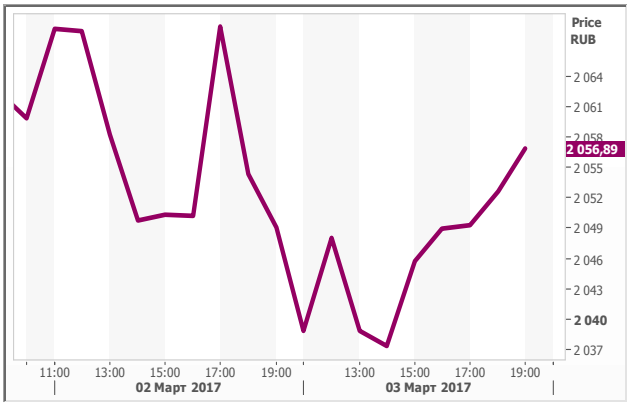
Из сегодняшних корпоративных новостей отметим отчетность НЛМК и Ростелекома по МСФО за 2016 г.

Мировые фондовые индексы

Наименование индикатора	Цена закрытия	Изменение (%)		
		День	Месяц	Год
ММВБ	2056,89	0,39	-7,83	9,51
РТС	1108,26	0,77	-5,08	35,44
S&P500	2383,12	0,05	4,54	19,16
DJIA	21005,71	0,01	5,60	23,51
NASDAQ	5870,75	0,16	4,04	24,46
VIX	10,96	-7,20	-7,20	-34,99
DAX	12027,36	-0,27	3,16	22,43
Nikkei	19469,17	-0,49	1,68	14,43
Shanghai Com.	3218,31	-0,36	1,87	11,97
BOVESPA	66785,53	1,41	3,01	36,06

Источник: Bloomberg

График индекса ММВБ (60 мин.)



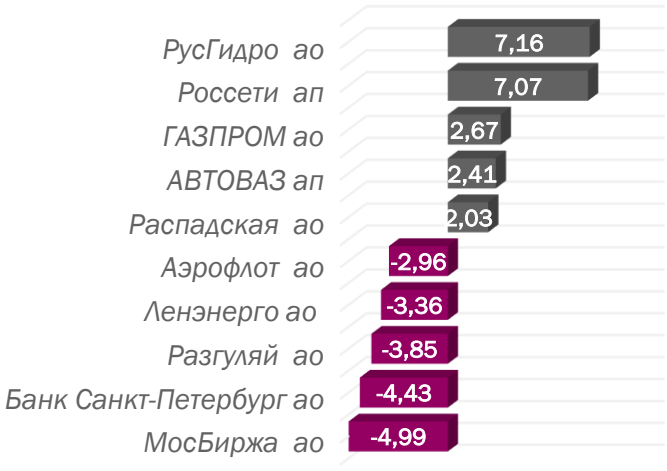
Источник: Reuters

Индикаторы валютного рынка

Наименование индикатора	Цена закрытия	Изменение (%)		
		День	Месяц	Год
Индекс домара	101,54	-0,65	1,91	4,31
USD/RUB	58,23	-0,98	-3,16	-19,09
EUR/RUB	61,74	-0,11	-4,67	-22,05
EUR/USD	1,06	1,09	-1,37	-3,48
GBP/USD	1,23	0,27	-2,84	-13,58
JPY/USD	114,03	-0,34	0,69	0,23
CNY/USD	6,90	0,15	0,47	6,10

Источник: Bloomberg

Лидеры роста/падения, % за день



Источник: Reuters

Индикаторы товарных рынков

Наименование индикатора	Цена закрытия	Изменение (%)		
		День	Месяц	Год
Нефть Brent ($/бар)	55,90	1,49	-1,58	44,37
Нефть WTI ($/бар)	53,33	1,37	-1,02	48,47
Золото ($/унц)	1234,81	0,05	2,06	-1,92
Серебро ($/унц)	17,97	1,15	2,45	15,92
Платина ($/унц)	999,75	1,19	0,08	2,11
Никель ($/тонн)	10944,00	1,95	7,08	16,14
Медь ($/тонн)	5917,00	-0,22	-0,47	17,69
Алюминий ($/тонн)	1884,75	-1,02	3,93	16,63
Натуральный газ	2,83	0,82	-10,76	69,69
Уголь ($/тонн)	162,40	0,06	-4,30	103,51

Источник: Bloomberg

Российский рынок акций в пятницу умеренно подрос, хотя и начал день на отрицательной территории. Индекс ММВБ прибавил 0,4%, до 2 056,89 п., РТС увеличился на 0,77%, достигнув отметки 1 108,26 п.

Рубль в пятницу подорожал относительно доллара США и евро. Курс пары USDRUB к закрытию торгов на Московской бирже составил 58,23 руб., европейская валюта оценивалась в 61,73 руб. На стороне локальной валюты выступил фактор коррекции американского доллара с многонедельных максимумов, а также сообщения о снижении ежедневного объема покупок Минфином РФ. Не подвел и нефтяной рынок, которому удалось отыграть потери прошлой недели.

Минфин в пятницу сообщил, что на текущий курс пары USDRUB на локальном валютном рынке привлекательный для исполнению валютных обязательств бюджета. Ведомство намерено пополнять резервы для этих целей. «Мы с начала марта начали накапливать на счетах казначейства ликвидность в иностранной валюте. Накопление этой валютной ликвидности не связано с дополнительными нефтегазовыми доходами. Это те средства, которые нам необходимы для исполнения текущих обязательств бюджета в иностранной валюте в 2017 году», - сообщил министр финансов Антон Силуанов.

Кроме того, Минфин на период с 7 марта по 6 апреля 2017 г. снизит объем ежедневных покупок валюты до 3,2 млрд руб. с февральских 6,28 млрд руб.
Основным же фактором давления на локальную валюты остается риск ужесточения монетарной политики в США, вероятность повышения процентной ставки на ближайшем заседании ФРС в марте оценивается, согласно данным Futures Fed Funds, в 94%. В случае реализации данного сценария привлекательность высокодоходных российских активов снизится.

После пятничного роста (Brent прибавила +1,5%, WTI +1,37%) на фоне ослабления индекса доллара нефтяные котировки демонстрируют около нулевую динамику на утро понедельника.

Согласно пятничным данным Baker Hughes, с 25 февраля по 3 марта количество активных буровых установок по добыче нефти в США выросло до 609 ед. с 602 ед. Последнее значение является самым высоким с начала октября 2015 г. Количество установок по добыче газа сократилось на 5 ед., составив 146 ед. При этом, общее число буровых установок (газовых +нефтяных) увеличилось на 2 ед., до уровня 755 ед.

Внимание нефтяного рынка на этой неделе направлено на энергетическую конференцию CERAWeek в Хьюстоне, которая пройдет с 6 по 10 марта и соберет лидеров нефтяной отрасли. Отметим, что сегодня глава Минэнерго РФ А.Новак выступит на этой конференции в 21:35 мск.

На текущей неделе ожидается выход блока макроэкономических данных, которые способны оказать влияние как на общее настроение на глобальных рынках, так и на локальную валюты (подробнее в Календаре событий, стр. 3). Кроме того, в четверг пройдет заседание ЕЦБ.

Источник: КИТ Финанс Брокер

Календарь событий

Макроэкономические события

Время	Событие	Период	Ед. изм.	Регион	Прежнее	Прогноз
Понедельник 6 марта						
12:30	Индекс доверия инвесторов Sentix	март	-	EU	17,4	18,50
18:00	Заказы на товары длительного пользования, м/м	январь	%	US	1,8	-
18:00	Заказы предприятий, м/м	январь	%	US	1,3	1,2
Вторник 7 марта						
10:00	Заказы предприятий, м/м	январь	%	GE	5,2	-2,7
13:00	ВВП, вторая оценка, г/г	4 кв.	%	EU	1,7	1,7
Среда 8 марта						
Биржи в РФ закрыты по случаю празднования 8 марта						
02:50	ВВП, вторая оценка, к/к	4 кв.	%	JP	0,2	0,4
10:00	Промышленное производство, м/м	январь	%	GE	-3	2,7
16:15	Число созданных рабочих мест в частном секторе ADR	февраль	-	US	180,00	246,00
Четверг 9 марта						
02:50	Чистые вложения нерезидентов в японские акции	неделя	млрд. йен	JP	-261,1	-
04:30	Индекс потребительских цен, г/г	февраль	%	CH	2,5	1,6
15:45	Ключевая ставка ЕЦБ	март	-	EU	-0,4	-0,4
16:30	Импортные цены, м/м	февраль	%	US	0,4	0,1
16:30	Экспортные цены, м/м	февраль	%	US	0,1	0,1
Пятница 10 марта						
12:30	Промышленное производство, г/г	январь	%	GB	4,3	3,4
16:30	Уровень безработицы	февраль	%	US	4,8	4,7
16:30	Занятость в несельскохозяйственном секторе (non-farm payrolls)	февраль	тыс.	US	227	180
21:00	Данные Baker Hughes по буровым установкам	неделя	ед.	US	756	-

Календарь событий

Корпоративные события российского рынка акций

Компания	Корпоративное событие
Понедельник 6 марта	
НМЛК	Публикация финансовых результатов за 2016 г. по МСФО
Ростелеком	Публикация финансовых результатов за 2016 г. по МСФО
Вторник 7 марта	
Сбербанк	Публикация финансовых результатов за январь-февраль 2017 г. по РСБУ
Четверг 9 марта	
Алроса	Публикация результатов продаж в феврале
Понедельник 13 марта	
Энел Россия	Публикация финансовых результатов за 2016 г. по МСФО
Вторник 14 марта	
Русагро	День инвестора
Русагро	Публикация финансовых результатов за 2016 г. по МСФО
Лукойл	Публикация финансовых результатов за 2016 г. по МСФО
ТКС	Публикация финансовых результатов за 2016 г. по МСФО

Календарь событий

Корпоративные события российского рынка акций

Компания	Корпоративное событие
Среда 15 марта	
Сбербанк	Публикация финансовых результатов за 2016 г. по МСФО
ТГК-1	Публикация финансовых результатов за 2016 г. по МСФО
Polymetal	Публикация финансовых результатов за 2016 г. по МСФО
Qiwi	Публикация финансовых результатов за 2016 г. по МСФО
Четверг 16 марта	
Дикси	Публикация финансовых результатов за 2016 г. по МСФО
Алроса	Публикация финансовых результатов за 2016 г. по МСФО
Юнипро	Публикация финансовых результатов за 2016 г. по МСФО
Русал	Публикация финансовых результатов за 2016 г. по МСФО
Пятница 17 марта	
ФСК ЕЭС	Публикация финансовых результатов за 2016 г. по МСФО
НорНикель	Публикация финансовых результатов за 2016 г. по МСФО
Вторник 21 марта	
Группа ЛСР	Публикация финансовых результатов за 2016 г. по МСФО
Юнипро	Публикация финансовых результатов за 2016 г. по РСБУ
Среда 22 марта	
Алроса	День инвестора
Эталон	Публикация финансовых результатов за 2016 г. по МСФО
Четверг 23 марта	
Русгидро	Публикация финансовых результатов за 2016 г. по МСФО
Пятница 24 марта	
Группа ПИК	Публикация финансовых результатов за 2016 г. по МСФО
Магнит	Публикация аудированных финансовых результатов за 2016 г. по МСФО
Распадская	Публикация финансовых результатов за 2016 г. по МСФО
Фосагро	Публикация финансовых результатов за 2016 г. по МСФО
Фармстандарт	Прекращение торгов акциями компании
Понедельник 27 марта	
X5 Retail Group	Публикация финансовых результатов за 2016 г. по МСФО
Четверг 30 марта	
РусГидро	Публикация финансовых результатов за 2016 г. по РСБУ
Пятница 31 марта	
Энел Россия	Публикация финансовых результатов за 2016 г. по РСБУ

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 № 040-06539-010000 от 14.10.2003,
- брокерской деятельности № 040-06525-100000 от 14.10.2003,
- деятельности по управлению ценными бумагами № 040-13670-001000 от 26.04.2012,
- депозитарной деятельности № 040-06467-000100 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.

За совершение сделок с ценными бумагами взимается комиссионное вознаграждение в соответствии с тарифами КИТ Финанс (АО). Возможны комиссии третьих лиц.