Премаркет. Ежедневный обзор от 15.05.2017

Прогноз на день

Глобальные рынки открылись ростом основных фондовых индексов. Нефтяные котировки прибавляют 1,5% на фоне достигнутых договорённостей между Саудовской Аравией и Россией о сокращении нефтедобычи до конца марта 2018 г. Азия торгуется на положительной территории, игнорируя риски со стороны проводимых на выходных испытаний северокорейской ракеты.

С учетом нефтяного позитива распродажи на локальном рынке акций могут сократить темпы, что позволит индексу ММВБ вернуться выше 2000 п.

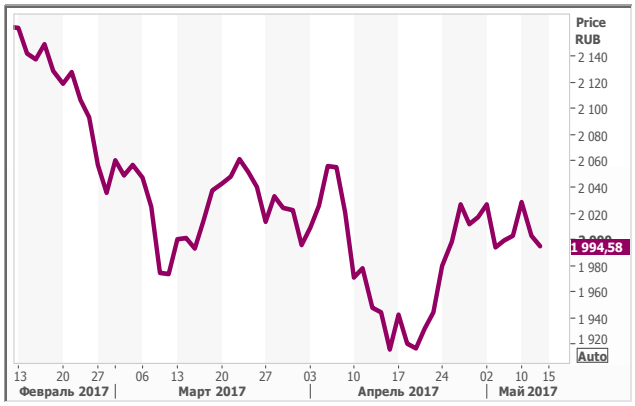
Сегодня ВТБ опубликует финансовые результаты за 1 кв. 2017 г.

Мировые фондовые индексы

Наименование индикатора	Цена закрытия	Изменение (%)		
		День	Месяц	Год
ММВБ	1994,58	-0,40	2,40	4,58
РТС	1099,75	-0,55	1,95	19,29
S&P500	2390,90	-0,15	1,96	16,82
DJIA	20896,61	-0,11	1,48	19,17
NASDAQ	6121,23	0,09	4,88	29,75
VIX	10,40	-1,89	-34,05	-30,85
DAX	12770,41	0,47	5,07	28,31
Nikkei	19883,90	-0,39	7,18	21,15
Shanghai Com.	3083,51	0,72	-5,81	9,07
BOVESPA	68221,94	1,01	6,78	31,69

Источник: Bloomberg

График индекса ММВБ (60 мин.)



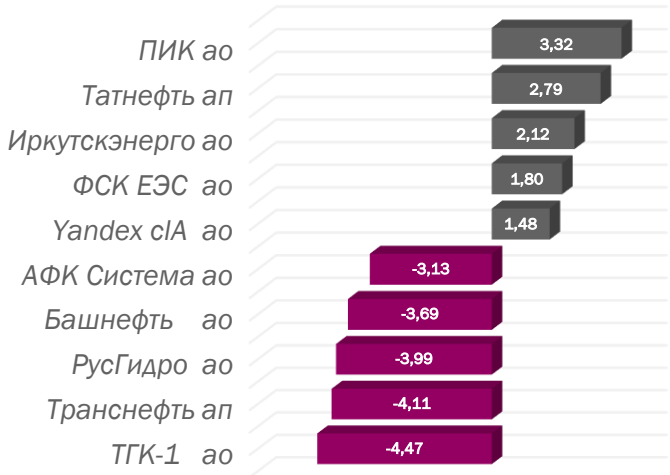
Источник: Reuters

Индикаторы валютного рынка

Наименование индикатора	Цена закрытия	Изменение (%)		
		День	Месяц	Год
Индекс домара	99,25	-0,37	-1,52	4,91
USD/RUB	57,09	0,06	0,87	-12,82
EUR/RUB	62,45	0,78	3,46	-15,62
EUR/USD	1,09	0,66	2,52	-3,34
GBP/USD	1,29	0,06	2,80	-10,25
JPY/USD	113,34	-0,46	3,95	4,33
CNY/USD	6,89	-0,10	0,15	5,48

Источник: Bloomberg

Лидеры роста/падения, % за день



Источник: Reuters

Индикаторы товарных рынков

Наименование индикатора	Цена закрытия	Изменение (%)		
		День	Месяц	Год
Нефть Brent ($/бар)	50,84	0,14	-8,99	6,29
Нефть WTI ($/бар)	47,84	0,02	-9,92	3,53
Золото ($/унц)	1228,43	0,28	-4,53	-3,54
Серебро ($/унц)	16,47	0,79	-10,95	-3,76
Платина ($/унц)	921,10	0,34	-5,35	-12,48
Никель ($/тонн)	9266,00	-0,01	-4,43	5,94
Медь ($/тонн)	5559,50	0,30	-1,22	20,14
Алюминий ($/тонн)	1885,50	0,86	-0,26	20,75
Натуральный газ	3,42	1,42	7,44	63,36
Уголь ($/тонн)	170,00	-2,86	-43,39	83,98

Источник: Bloomberg

В пятницу, на фоне негативных историй как на внешних торговых площадках, так и на локальном рынке, российские фондовые индексы завершили торги снижением. РТС и ММВБ потеряли 0,55% и 0,40% соответственно. По итогам прошедшей недели: ММВБ -0,4%%, РТС +1,3%. В центре внимания американского рынка очередной политический скандал (увольнение главы ФБР), который вновь оттягивает реализацию планов Дональда Трампа, а следовательно, вероятность увидеть коррекцию на рынке увеличивается. Ценам на нефть хоть и удалось подняться выше $50 за баррель на прошлой недели, но поводов для дальнейшего роста рынок не представил. До очередной встречи ОПЕК в Вене остается уже меньше двух недель, отсюда и усиление волатильности на рынке. Масла в огонь добавила и локальная история с АФК Системой, которая усилила репутационные риски российских эмитентов.

На дальнейшую динамику рынка на текущей неделе окажут влияние нефтяные котировки, а также внешний фон. Оба фактора на утро понедельника пока что на стороне покупателей. Саудовская Аравия и Россия договорились о продлении нефтяного пакта до конца марта 2018 г., нефть марки Brent оценивается в $51,60 за баррель. С учетом нефтяного позитива распродажи на локальном рынке акций могут сократить темпы, что позволит индексу ММВБ вернуться выше 2000 п.

В пятницу на торгах лидировали акции Татнефти ап (+2,79%). Бумаги переписали исторический максимум, подорожав до 283 руб. на фоне дивидендного фактора. ФСК ЕЭС прибавили 1,8%. Положительную динамику продемонстрировали и бумаги Газпрома (+1,07%) на фоне предложения ФАС повысить внутренние тарифы на газ на 4% с 1 июля. Лучше рынка выглядели бумаги RUSAL plc (+1,06%) после публикации сильной отчетности за 1 кв. 2017 г. Компания за отчетный период существенно сократила свою долговую нагрузку, объем долга к погашению снизился до $500 млн. Соотношение чистого долга к EBITDA составило 3,2х, то есть на уровне прошлого года. Кроме того, менеджмент компании объявил о планах по закрытию сделки по рефинансирования PXF-кредита в ближайшие недели. После чего компания может пересмотреть дивидендную политику.

В списках аутсайдеров бумаги АФК Системы (-3,13%) в связи с исковыми претензиями со стороны Роснефти (-1,55%) и Башнефти (-3,69%), а также Минобороны. Капитализация РусГидро на пятничных торгах снизилась почти на 4%, практически растеряв весь свой рост за неделю.

Сегодня отчет за 1 кв. 2017 г. представит ВТБ. Акции НЛМК могут показать динамику лучше рынка в связи с включением в индекс MSCI.

Цены на нефть марки Brent за прошедшую неделю выросли на 1,04%, до $50,84 за баррель. Позитивным импульсом выступило неожиданное снижение запасов нефти в США, кроме того, рынок делает ставки на продление пакта ОПЕК об ограничении добычи нефти 25 мая. В ближайшие две недели рынок будет восприимчив к заявлениям представителей стран-нефтепроизводителей, что, безусловно, отразится в ценах на нефть.

Тем временем, сланцевики продолжают наращивать производство. Пятничные данные от Baker Hughes зафиксировали рост нефтяных скважин (+9 ед.) на прошлой неделе, их общее количество составляет 712 ед., а с учетом газовых установок – 877 ед.

Рубль при поддержке нефтяных цен на прошлой неделе вновь вернулся к укреплению против доллара США, завершив торги в пятницу на уровне 57,09 руб. На этой неделе стартует налоговый период, что окажет дополнительную поддержку рублю. Пик выплат приходится на 25 мая, так что в ближайшие дни экспортёры начнут активно продавать валютную выручку.

Источник: КИТ Финанс Брокер

Календарь событий

Макроэкономические события

Время	Событие	Период	Ед. изм.	Регион	Прежнее	Прогноз
Понедельник 15 мая						
05:00	Розничные продажи, г/г	апрель	%	CH	10,9	10,6
Вторник 16 мая						
Ежемесячный отчет МЭА по рынку нефти						
11:30	Индекс потребительских цен, м/м	апрель	%	GB	0,4	-
11:30	Индекс потребительских цен, г/г	апрель	%	GB	2,3	-
12:00	Торговый баланс	март	млрд. евро	EU	17,8	-
12:00	ВВП (предварительный), к/к	1 кв.	%	EU	0,5	0,5
12:00	ВВП (предварительный), г/г	1 кв.	%	EU	1,7	1,7
16:15	Промышленное производство	апрель	%	US	0,5	0,3
Среда 17 мая						
07:30	Промышленное производство	март	%	JP	-2,1	-
11:30	Уровень безработицы	март	%	GB	4,7	-
12:00	Индекс потребительских цен, г/г	апрель	%	EU	1,9	1,9
12:00	Индекс потребительских цен, м/м	апрель	%	EU	0,8	0,4
17:30	Запасы нефти по версии EIA	неделя	млн. барр.	US	-5,247	-
Четверг18 мая						
02:50	ВВП (предварительный), к/к	1 кв.	%	JP	0,3	0,4
11:30	Розничные продажи, м/м	апрель	%	GB	-1,8	-
11:30	Розничные продажи, г/г	апрель	%	GB	1,7	-
Пятница 19 мая						
09:00	Индекс цен производителей, м/м	апрель	%	GE	0,0	-
09:00	Индекс цен производителей, г/г	апрель	%	GE	3,1	-
17:00	Индекс потребительского доверия	апрель	-	EU	-3,6	-3,05
20:30	Данные Baker Hughes по количеству буровых установок (общее кол-во)	неделя	ед.	US	877	-

Календарь событий

Корпоративные события российского рынка акций

Компания	Корпоративное событие
Понедельник 15 мая	
МРСК Центр	Заседание совета директоров (дивиденды)
ВТБ	Публикация финансовых результатов по МСФО за 1 квартал 2017 года
Мосэнерго	Публикация финансовых результатов по МСФО за 1 квартал 2017 года
Вторник 16 мая	
ТГК-1	Публикация финансовых результатов по МСФО за 1 квартал 2017 года
Мосэнерго	Публикация финансовых результатов по МСФО за 1 квартал 2017 года
Газпром	Заседание совета директоров (дивиденды)
Среда 17 мая	
Черкизово	Публикация финансовых результатов по МСФО за 1 квартал 2017 года
ТМК	Публикация финансовых результатов по МСФО за 1 квартал 2017 года
Четверг 18 мая	
Русагро	Заседание совета директоров (специальные дивиденды)
Мосбиржа	Публикация финансовых результатов по МСФО за 1 квартал 2017 года
Пятница 19 мая	
Русагро	Публикация финансовых результатов по МСФО за 1 квартал 2017 года
Ростелеком	Публикация финансовых результатов по МСФО за 1 квартал 2017 года
Мечел	Публикация финансовых результатов по МСФО за 4 квартал 2016 года
ВТБ	Публикация финансовых результатов по МСФО за 1 квартал 2017 года
Среда 24 мая	
Сбербанк	Публикация финансовых результатов по МСФО за 1 квартал 2017 года
Четверг 25 мая	
Мегафон	Публикация финансовых результатов по МСФО за 1 квартал 2017 года
Пятница 26 мая	
Банк Санкт-Петербург	Публикация финансовых результатов по МСФО за 1 квартал 2017 года
Алроса	Публикация финансовых результатов по МСФО за 1 квартал 2017 года
ФосАгро	Публикация финансовых результатов по МСФО за 1 квартал 2017 года
Понедельник 29 мая	
ОГК-2	Публикация финансовых результатов по МСФО за 1 квартал 2017 года

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.