Премаркет. Ежедневный обзор от 18.05.2017

Прогноз на день

Роста в первой половине сегодняшней сессии ждать, пожалуй, не приходится. Америка вчера закрылась серьезным падением, а индекс страха VIX подскочил на 46%.

Открытие локального рынка акций пройдет ниже закрытия вчерашнего дня.

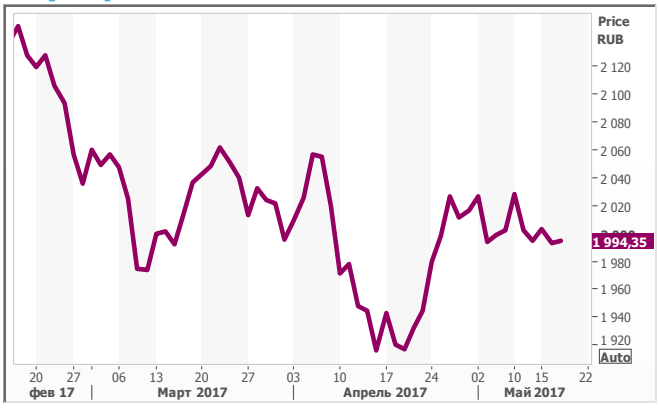
Ждем дивидендных новостей от совета директоров Газпрома.

Мировые фондовые индексы

Наименование индикатора	Цена закрытия	Изменение (%)		
		День	Месяц	Год
ММВБ	1994,35	0,07	2,66	4,47
РТС	1104,30	-0,78	0,92	18,52
S&P500	2357,03	-1,82	0,34	15,13
DJIA	20606,93	-1,78	-0,15	17,55
NASDAQ	6011,24	-2,57	2,64	27,47
VIX	15,59	46,38	6,34	0,13
DAX	12631,61	-1,35	4,32	27,72
Nikkei	19814,88	-0,53	7,95	18,99
Shanghai Com.	3104,44	-0,27	-3,65	9,17
BOVESPA	67540,25	-1,67	4,98	32,85

Источник: Bloomberg

График индекса ММВБ (60 мин.)



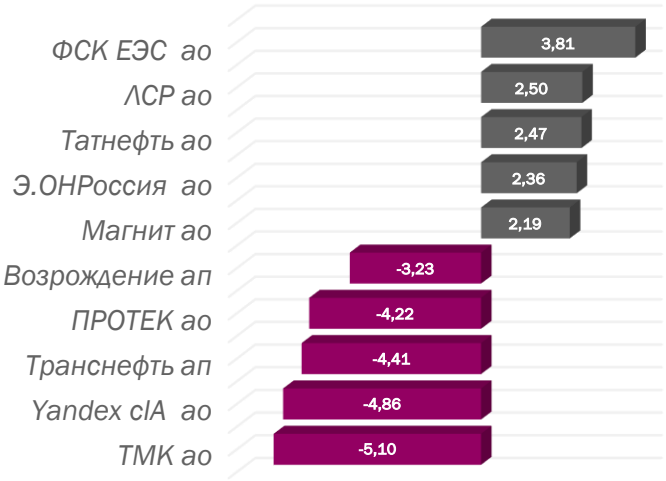
Источник: Reuters

Индикаторы валютного рынка

Наименование индикатора	Цена закрытия	Изменение (%)		
		День	Месяц	Год
Индекс домара	97,58	-0,54	-2,71	3,20
USD/RUB	57,09	0,89	2,04	-11,80
EUR/RUB	63,68	1,59	6,91	-13,00
EUR/USD	1,12	0,69	4,84	-1,36
GBP/USD	1,30	0,41	3,23	-10,32
JPY/USD	110,83	-2,02	1,76	1,54
CNY/USD	6,87	-0,04	-0,14	5,33

Источник: Bloomberg

Лидеры роста/падения, % за день



Источник: Reuters

Индикаторы товарных рынков

Наименование индикатора	Цена закрытия	Изменение (%)		
		День	Месяц	Год
Нефть Brent ($/бар)	52,21	1,08	-5,69	5,95
Нефть WTI ($/бар)	49,07	0,84	-6,80	1,57
Золото ($/унц)	1261,36	1,95	-1,82	-1,38
Серебро ($/унц)	16,91	0,29	-8,22	-1,98
Платина ($/унц)	946,27	0,58	-3,89	-10,23
Никель ($/тонн)	9182,00	1,07	-5,67	3,10
Медь ($/тонн)	5610,00	-0,02	-1,44	20,46
Алюминий ($/тонн)	1919,25	0,08	0,64	21,61
Натуральный газ	3,19	-1,18	0,92	55,86
Уголь ($/тонн)	158,30	-1,06	-49,59	75,89

Источник: Bloomberg

Российский рынок акций накануне предпринял пару попыток подрасти к уровню 2000 пунктов по индексу ММВБ, но успехом они не увенчались. Рублевый индекс по итогам дня практически не претерпел изменений, а долларовый РТС подешевел на 0,8% вслед за переоценкой вверх котировок USD/RUB.

Финансовую отчетность за I кв. накануне опубликовали Фосагро и Ростелеком. Результаты слабые, но это в целом ожидаемо. EBITDA Фосагро упала вдвое, чистая прибыль – на 46%. В январе-марте 2017 г. компания испытала сложности не только из-за низких цен на производимую продукцию (цены на удобрения даже начали понемногу восстанавливаться в сравнении с IV кв. 2016 г.), но и из-за существенного укрепления рубля. Держать Фосагро в портфеле на сегодня означает делать ставку на ослабление российской валюты.

Выручка Ростелекома сократилась на 2,8%, OIBDA – на 13%. В ближайшие 1-2 месяца будут интересны привилегированные акции Ростелекома – по ним дивидендная доходность около 10%. Но бумаги неликвидны, поэтому движения по ним могут быть неэластичными.

Менеджмент Уралкалия рассказал о дальнейших планах компании: к buyback и выплате дивидендов Уралкалий вернется, но только после снижения долговой нагрузки. По состоянию на 31 декабря 2016 г. коэффициент NetDebt/EBIDTA Уралкалия оценивался в 4,7, задача менеджмента сократить леверидж до 4,0.

Сегодня состоится долгожданное заседание совета директоров Газпрома, на котором будут разработаны рекомендации собранию акционеров по дивидендам. К этому моменту должна быть готова правительственная директива. Накануне г-н Дворкович обещал, что дивидендные выплаты Газпрома будут не ниже чем в прошлом году (т.е. 7,89 руб. на акцию). Любое повышение выплаты относительно этой отметки будет очень позитивно оценено рынком.

Но по рынку в целом роста в первой половине сегодняшней сессии ждать, пожалуй, не приходится. Америка вчера закрылась серьезным падением – S&P 500 потерял 1,8%, DJIA - 1,78%, высокотехнологичный NASDAQ снизился на 2,57%, а индекс страха VIX подскочил на 46%. Снова кипят страсти вокруг фигуры Трампа и его решений. Сколько эта ситуация будет продолжаться пока неизвестно, но до тех пор волатильность американского рынка будет оставаться высокой.

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.