Премаркет. Ежедневный обзор от 31.05.2017

Прогноз на день

Внешний фон на утро среды носит нейтральный характер. Нефтяные котировки теряют 0,6-0,7%

Локальный рынок акций продолжает медленно скатываться вниз. Торговый диапазон для индекса ММВБ 1930-1950 п.

Из корпоративных новостей отметим отчет Газпрома за 1 кв. 2017 г. по МСФО. Мечел опубликует операционные результаты.

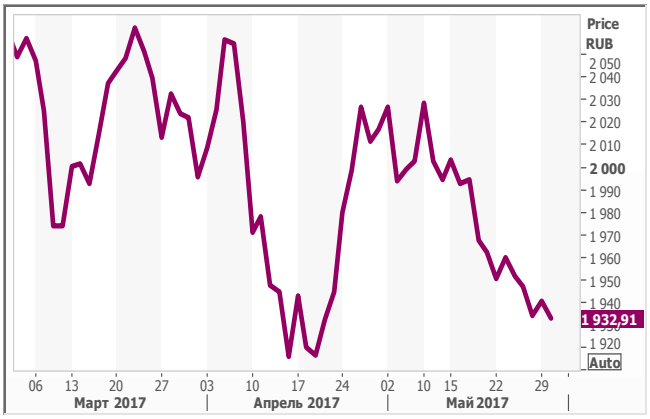
С гэпом вверх начнут день «префы» Россетей после объявления размера дивиденда за 2016 г.

Мировые фондовые индексы

Наименование индикатора	Цена закрытия	Изменение (%)		
		День	Месяц	Год
ММВБ	1932,91	-0,40	-4,16	-0,14
РТС	1074,81	-1,01	-3,56	16,13
S&P500	2412,91	-0,12	1,20	14,95
DJIA	21029,47	-0,24	0,42	17,66
NASDAQ	6203,19	-0,11	2,57	25,74
VIX	10,38	5,81	-4,07	-20,88
DAX	12598,68	-0,24	1,29	21,92
Nikkei	19677,85	-0,02	2,51	15,29
Shanghai Com.	3110,06	#N/A N/A	-1,41	10,19
BOVESPA	63962,27	0,32	-2,20	30,63

Источник: Bloomberg

График индекса ММВБ (60 мин.)



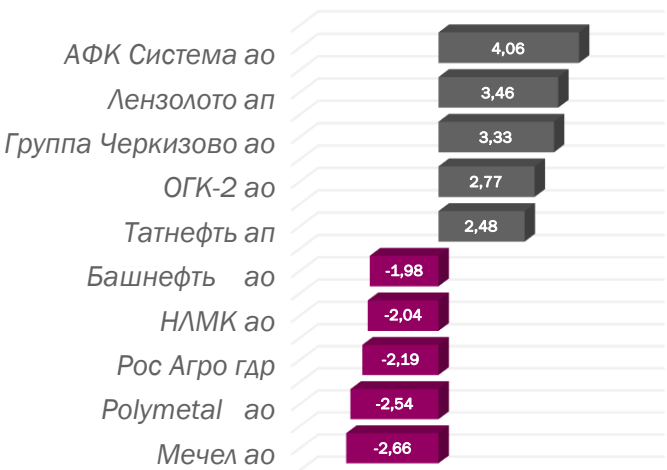
Источник: Reuters

Индикаторы валютного рынка

Наименование индикатора	Цена закрытия	Изменение (%)		
		День	Месяц	Год
Индекс домара	97,28	-0,17	-1,79	1,84
USD/RUB	56,54	0,16	-0,67	-14,01
EUR/RUB	63,36	0,48	2,13	-13,60
EUR/USD	1,12	0,19	2,65	0,43
GBP/USD	1,29	0,15	-0,70	-12,15
JPY/USD	110,85	-0,37	-0,62	-0,25
CNY/USD	6,85	-0,08	-0,57	3,99

Источник: Bloomberg

Лидеры роста/падения, % за день



Источник: Reuters

Индикаторы товарных рынков

Наименование индикатора	Цена закрытия	Изменение (%)		
		День	Месяц	Год
Нефть Brent ($/бар)		-0,86	0,21	4,18
Нефть WTI ($/бар)	49,66	-0,28	0,67	0,67
Золото ($/унц)	1263,09	-0,40	-0,41	4,83
Серебро ($/унц)	17,41	0,03	1,10	8,83
Платина ($/унц)	939,53	-1,63	-0,63	-3,09
Никель ($/тонн)	9075,00	0,35	-3,74	6,39
Медь ($/тонн)	5656,00	-0,03	-1,39	20,47
Алюминий ($/тонн)	1918,00	-1,35	0,56	21,01
Натуральный газ	3,15	-2,81	-4,00	45,00
Уголь ($/тонн)	149,60	0,00	-39,24	79,38

Источник: Bloomberg

На локальном рынке акций без перемен. Индекс ММВБ продолжает торговаться в узком диапазоне 1930-1950 п, упираясь в линию поддержки. Вчерашние торги завершились снижением как рублевого индекса, так и РТС. Первый потерял 0,40%, до 1932,91 пр. РТС снизился на 1,01%, до 1074,81 п.

Вчерашние торги сопровождались относительно активным корпоративным фоном. Так, Лукойл представил сильные финансовые результаты за 1 кв. 2017 г. Выручка компании в I кв. совпала с рыночными ожиданиями и составила 1,43 трлн руб., +22% по сравнению с I кв. 2016 г. Чистая прибыль увеличилась на 46% в годовом сравнении, до 62,31 млрд руб. Показатель EBITDA вырос на 8,2% относительно аналогичного периода 2016 г. и достиг уровня 207,6 млрд руб. Свободный денежный поток составил 67,1 млрд руб. (+16,8%: г/г), а капитальные затраты - 130,2 млрд руб. (+3,5% г/г). Опубликованная отчетность поддержала котировки компании на рынке, капитализации Лукойла увеличивается на 1,09% на падающем рынке. Подтверждаем рекомендацию ПОКУПАТЬ бумаги в долгосрочные портфели с целевым уровнем 3550 руб. Подробнее по ссылке.

Совет директоров ФСК на заседании 29 мая рекомендовал дивиденды за 2016 г. и I кв. 2017 г. Решение опубликовано во вторник, незадолго до открытия торгов. Компания намерена выплатить акционерам в качестве дивидендов за 2016 г. 0,014 руб. на акцию и за I кв. 0,0011, итого около 0,015 руб. на акцию. Таким образом, дивиденд за прошлый год составит всего 18% чистой прибыли по РСБУ или 27% нескорректированной прибыли по МСФО. Дивидендная доходность предстоящих выплат по состоянию на 29 мая – 9%. Дата ГОСА 29 июня 2017 г., дата дивидендной отчетки – 19 июля 2017 г.

Напомним, что ранее компания опубликовала отчет за 1 кв. 2017 г., который спровоцировал снижение цены акций ФСК ЕЭС, а информация о сравнительно низких дивидендов – усилили распродажи. При этом, если скорректировать финпоказатели на единоразовые «бумажные» факторы, результаты за I кв. 2017 г. не столь плохи. Тем не менее, очевидно, что история роста финрезультатов ФСК ЕЭС осталась в прошлом, а опасения ухудшения результатов в следующих кварталах будут довлеть над котировками ФСК ЕЭС после дивидендной отсечки. Подробнее по ссылке.

На вчерашних торгах также обратили на себя внимание акции АЛРОСы. Диапазон колебаний бумаг составил 88-92 руб. Поводом для волнения стали заявления вице-премьера РФ, полпреда президента на Дальнем Востоке Юрия Трутнева, который в интервью Интерфаксу предложил рассмотреть в качестве одной из мер поддержки отечественной огранки направление часть прибыли АЛРОСы, при этом сократить дивиденды. На предстоящие дивидендные выплаты это предложение, скорее всего, не повлияет.

Совет директоров Россетей рекомендовал выплатить по итогам 2016 г. дивиденды в размере в размере 0,368355281 руб. на одну привилегированную акцию и 0,006214460 руб. на одну обыкновенную акцию. Общая сумма дивидендов за 2016 г. составляет около 3,8 млрд руб. Эта сумма включает ранее выплаченные дивиденды за 1 кв. прошлого года в размере 1,8 млрд руб. Дата составления списка лиц, имеющих право на получение дивидендов – 19 июля 2017 г. В связи с этим *с гэпом вверх начнут день «префы» Россетей.*

Календарь событий

Макроэкономические события

Время	Событие	Период	Ед. изм.	Регион	Прежнее	Прогноз
Понедельник 29 мая						
Выходной день в США, Великобритании и Китае. Биржи закрыты						
Вторник 30 мая						
12:00	Индекс потребительского доверия, оконч.	май	-	EU	-3,60	-3,30
15:00	Индекс потребительских цен, предв. г/г	май	-	GE	2,00	1,70
17:00	Индекс потребительского доверия Conference Board	май	-	US	120,30	119,50
Среда 31 мая						
04:00	Индекс деловой активности в промышленности	Май	-	CH	51,20	51,00
04:00	Индекс деловой активности в сфере услуг	май	-	CH	54,00	-
09:00	Розничные продажи г/г	апрель	%	GE	2,90	-
11:00	Уровень безработицы	май	%	GE	5,80	5,70
12:00	Уровень безработицы	апрель	%	EU	9,50	9,40
12:00	Индекс потребительских цен г/г	май	%	EU	1,90	1,50
Четверг 1 июня						
09:00	Индекс деловой активности в промышленности	май	-	RU	50,80	-
15:15	Число созданных рабочих мест в частном секторе ADP	май	тыс.	US	177,00	185,00
15:30	Первичные обращения за пособиями по безработице	неделя	тыс.	US	234,00	-
17:00	Индекс деловой активности в промышленности ISM	май	-	US	54,80	54,60
18:00	Запасы нефти EIA	неделя	млн. барр.	US	4,43	-
Пятница 2 июня						
15:30	Торговый баланс	апрель	млрд. долл.	US	-43,71	-43,90
15:30	Уровень безработицы	май	%	US	4,40	4,50
15:30	**Количество рабочих мест, созданных вне с/х секторе**	май	тыс.	US	211,00	183,00
20:00	Отчет Baker Hughes по количеству буровых установок	неделя	ед.	US	908	-

Календарь событий

Корпоративные события российского рынка акций

Компания	Корпоративное событие
Понедельник 29 мая	
ВТБ	Публикация финансовых результатов по МСФО за 4 кв. 2017 г.
Вторник 30 мая	
РусАгро	Заседание совета директоров
Россети	Заседание совета директоров (дивиденды)
Лукойл	Публикация финансовых результатов по МСФО за 1 кв. 2017 г.
ТКС	Публикация финансовых результатов по МСФО за 1 кв. 2017 г.
Интер РАО	Публикация финансовых результатов по МСФО за 1 кв. 2017 г.
Среда 31 мая	
РусАгро	Публикация финансовых результатов по МСФО за 1 кв. 2017 г.
Итоги полугодовой ребалансировки индексов MSCI вступят в силу	
Четверг 1 июня	
Банк Санкт-Петербург	Публикация финансовых результатов по МСФО за 1 квартал 2017 г.
Пятница 2 июня	
Мосбиржа	Публикация данных по оборотам в мае

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 (ПАО).
Лицензии профессионального участника рынка ценных бумаг:
-дилерской деятельности № 040-06539-010000 от 14.10.2003 (ФКЦБ России),
-брокерской деятельности № 040-06525-100000 от 14.10.2003 (ФКЦБ России),
-деятельности по управлению ценными бумагами № 040-13670-001000 от 26.04.2012 (ФСФР России),
-депозитарной деятельности № 040-06467-000100 от 03.10.2003 (ФКЦБ России).
Без ограничения срока действия.

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 (ПАО) не дает никаких гарантий корректности, содержащейся в настоящем обзоре информации. КИТ Финанс (ПАО) не обязан обновлять или каким-либо образом актуализировать настоящий обзор, однако КИТ Финанс (ПАО) 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 (ПАО). КИТ Финанс (ПАО) 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 (ПАО). Возможны комиссии третьих лиц.