Премаркет. Ежедневный обзор от 01.06.2017

Прогноз на день

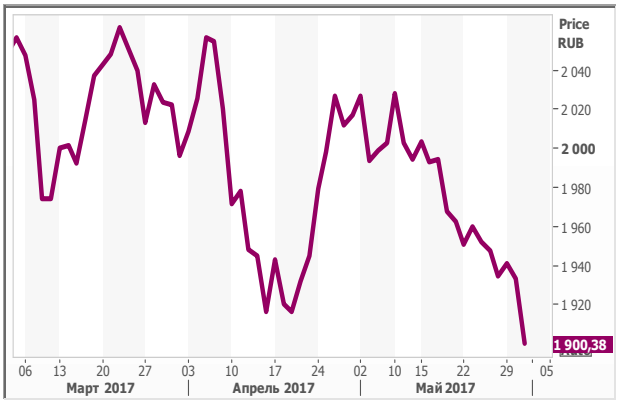
Рынки вчера реализовали принцип Sell in May and go away. Индекс ММВБ потерял 1,68%, РТС -2%. Цены акций в рублевом выражении достигли минимума с июля 2016 г. Цены на нефть снизились почти на 3%. При этом рубль в паре с долларом стойко держится на уровне 56,56 руб.

Сегодня старт торгов ожидаем на положительной территории.

Новостной фон в ближайшие дни будет активным. В Санкт-Петербурге открывается экономический форум.

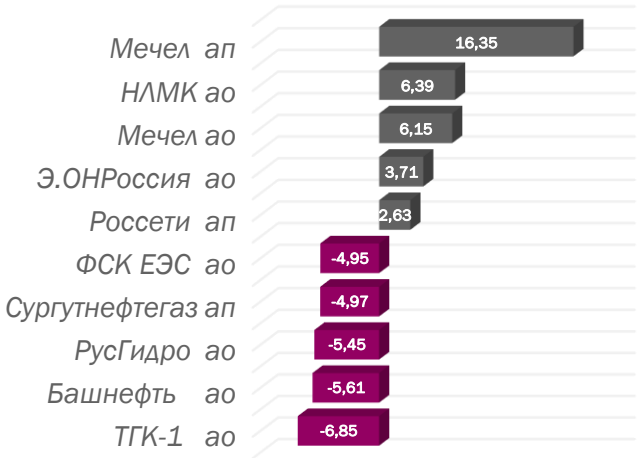
Акции ВСМПО-АВИСМА торгуются сегодня последний день с дивидендами.

График индекса ММВБ (60 мин.)



Источник: Reuters

Лидеры роста/падения, % за день



Источник: Reuters

Мировые фондовые индексы

Наименование индикатора	Цена закрытия	Изменение (%)		
		День	Месяц	Год
ММВБ	1900,38	-1,68	-5,77	0,07
РТС	1053,30	-2,00	-5,49	16,47
S&P500	2411,80	-0,05	0,98	15,01
DJIA	21008,65	-0,10	0,46	18,11
NASDAQ	6198,52	-0,08	1,76	25,27
VIX	10,41	0,29	2,97	-26,64
DAX	12615,06	0,13	1,42	22,92
Nikkei	19650,57	-0,14	1,76	14,02
Shanghai Com.	3117,18	0,23	-1,19	6,88
BOVESPA	62711,47	-1,96	-4,12	29,38

Источник: Bloomberg

Индикаторы валютного рынка

Наименование индикатора	Цена закрытия	Изменение (%)		
		День	Месяц	Год
Индекс домара	96,92	-0,37	-2,18	1,08
USD/RUB	56,56	0,04	-0,64	-15,20
EUR/RUB	63,64	0,43	2,57	-14,26
EUR/USD	1,12	0,52	3,17	1,12
GBP/USD	1,29	0,23	0,04	-10,99
JPY/USD	110,78	-0,06	-0,95	0,05
CNY/USD	6,82	-0,42	-1,06	3,61

Источник: Bloomberg

Индикаторы товарных рынков

Наименование индикатора	Цена закрытия	Изменение (%)		
		День	Месяц	Год
Нефть Brent ($/бар)		-2,95	-2,35	1,25
Нефть WTI ($/бар)	48,32	-2,70	-1,06	-1,59
Золото ($/унц)	1268,92	0,46	0,98	4,41
Серебро ($/унц)	17,33	-0,44	2,79	8,33
Платина ($/унц)	950,04	1,12	2,01	-3,00
Никель ($/тонн)	8931,00	-1,59	-5,27	4,50
Медь ($/тонн)	5682,00	0,46	-0,93	21,64
Алюминий ($/тонн)	1920,25	0,12	0,68	21,04
Натуральный газ	3,07	-2,35	-4,48	34,22
Уголь ($/тонн)	149,20	-0,27	-39,40	78,90

Источник: Bloomberg

Последний день мая для российского рынка выдался не простым, фондовые индексы обновляли минимумы. Индекс ММВБ в течение торговой сессии опускался ниже 1900 п. При этом существенных негативных факторов, кроме распродажи на рынке нефти, не наблюдалось. Продажи на локальном рынке акций прошли широким фронтом. «Тяжеловесы», Сбербанк, Лукойл, Роснефть и Газпром, потеряли -3,53%, 2,55%, 1,13% и 1,5% соответственно. РТС снизился на 2%, до 1053, 30 п.

Если говорить в целом о ситуации на локальном рынке, то здесь действует фактор неоправдавшихся ожиданий: это и политика Трампа, и отказ от нормы выплат дивидендов госкомпаний, и снижение цен на нефть. Кроме того, финансовые результаты российских эмитентов пока что не радуют: прибыли в основном снижаются. Так что те факторы и ожидания, которые закладывались в цены рублевых акций во втором полугодии 2016 г. - практически все они не реализовались. После завершения дивидендного сезона вообще сложно придумать какой-то новый фактор поддержки для российского рынка.

Если говорить про отдельные истории роста в мае, то необходимо отметить префы Татнефти. Бумаги поддерживает дивидендный фактор. Дивиденды Татнефти приятный сюрприз этого дивидендного сезона. В конце апреля совет директоров Татнефти рекомендовал акционерам утвердить дивиденды по итогам 2016 г. в размере **22,81 руб.** на все типы акций. Это соответствует 50% чистой прибыли компании по МСФО за 2016 г. Ввиду того, что префы дешевле, именно их покупка выглядит целесообразнее накануне дивидендных выплат, поэтому рост рыночной цены вполне оправдан.
Что же касается вчерашних торгов, то при всеобщем пессимизме радовали бумаги Мечела: префы выросли на 16,35%, обыкновенные на 6,15%. Компания опубликовала сильные результаты за 1 кв.

Чистая прибыль по МСФО Газпрома в 1 кв. снизилась на 8%, до 333,4 млрд руб., при ожиданиях 319,7 млрд руб. Прибыль компании по курсовым разницам составила 123 млрд руб.

Нефтяные котировки вчера стремительно падали, снижение составило почти 3%. Цена нефти Brent опускалась ниже $50 за баррель. Сегодня внимание рынка будет сфокусировано на данные о запасах нефти в США. Отчет выйдет сегодня, поскольку понедельник был выходным днем. Ожидается снижение запасов на 2,5 млн баррелей.

Источник: КИТ Финанс Брокер

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.