Премаркет. Ежедневный обзор от 16.06.2017

Прогноз на день

Внешний фон с утра формируется умеренно позитивный. Вчерашний оборот на Московской бирже – рекордный с декабря 2014 г. Наторговали на 90 млрд. руб. с лишним, выкупили падение первой половины сессии и закрылись в минусе «всего» на 1,12%.

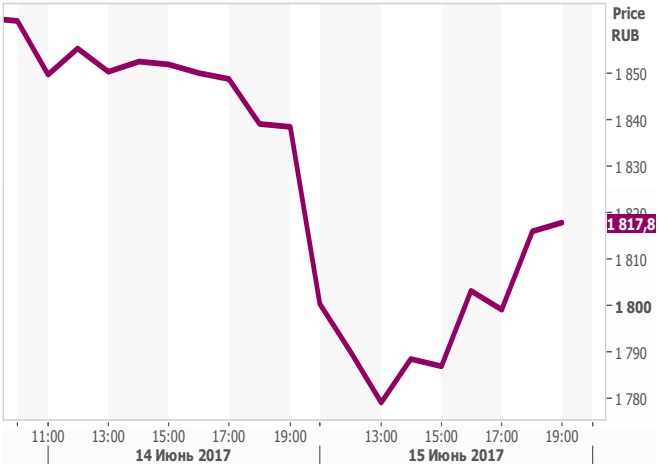
Сегодня следим за заседанием ЦБ РФ. Ждем снижения процентной ставки на 0,25 п.п. Реакции рынка, как обычно, не будет – весь эффект «размажется» на более длинном временном отрезке.

Мировые фондовые индексы

Наименование индикатора	Цена закрытия	Изменение (%)		
		День	Месяц	Год
ММВБ	1817,82	-1,12	-8,79	-3,81
РТС	991,96	-2,15	-10,87	9,00
S&P500	2432,46	-0,22	1,32	17,43
DJIA	21359,90	-0,07	1,81	21,09
NASDAQ	6165,50	-0,47	-0,07	27,52
VIX	10,90	2,44	2,35	-45,88
DAX	12691,81	-0,89	-0,88	32,11
Nikkei	19831,82	-0,26	-0,44	24,58
Shanghai Com.	3132,49	0,06	0,63	8,50
BOVESPA	61922,93	0,00	-9,84	26,59

Источник: Bloomberg

График индекса ММВБ (60 мин.)

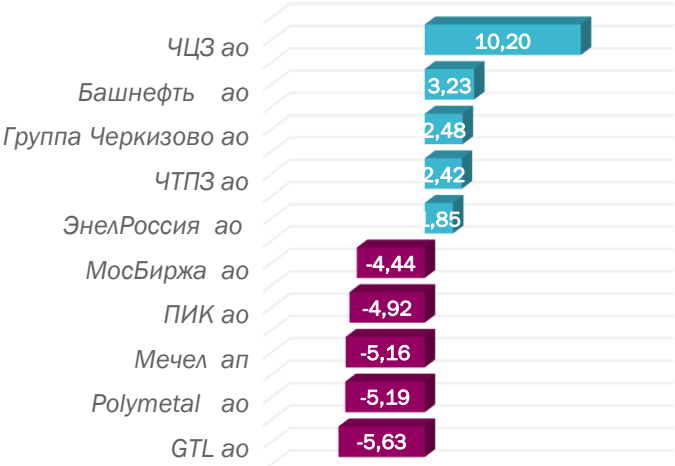


Индикаторы валютного рынка

Наименование индикатора	Цена закрытия	Изменение (%)		
		День	Месяц	Год
Индекс домара	97,43	0,51	-0,68	2,98
USD/RUB	57,89	0,79	2,32	-11,64
EUR/RUB	64,52	0,12	2,93	-12,69
EUR/USD	1,11	-0,65	0,56	-1,02
GBP/USD	1,28	0,05	-1,25	-10,19
JPY/USD	110,94	1,23	-1,93	4,65
CNY/USD	6,80	0,23	-1,01	3,39

Источник: Bloomberg

Лидеры роста/падения, % за день



Источник: Reuters

Индикаторы товарных рынков

Наименование индикатора	Цена закрытия	Изменение (%)		
		День	Месяц	Год
Нефть Brent ($/бар)	46,92	-0,17	-9,16	-4,19
Нефть WTI ($/бар)	44,46	-0,60	-8,63	-7,39
Золото ($/унц)	1253,98	-0,55	1,35	-2,92
Серебро ($/унц)	16,75	-0,87	-0,62	-4,40
Платина ($/унц)	923,45	-1,47	-1,85	-5,37
Никель ($/тонн)	8792,00	-1,08	-3,22	-4,03
Медь ($/тонн)	5661,00	-0,67	0,89	22,02
Алюминий ($/тонн)	1859,25	-0,57	-3,05	12,66
Натуральный газ	3,06	4,19	-5,39	17,76
Уголь ($/тонн)	145,90	0,00	-8,81	59,80

Источник: Bloomberg

Перспективы расширения антироссийских санкций со стороны США, вкупе с отрицательной динамикой цен на нефть, подействовали на российский рынок соответствующим образом. Локальный рынок акций возглавил тренд на снижение среди EM. Индекс ММВБ в минусе на 1,12%, РТС потерял более 2% на вчерашних торгах.

При этом, вчерашний оборот на Московской бирже – рекордный с декабря 2014 г. Наторговали на 90 млрд. руб. с лишним, выкупили падение первой половины сессии и закрылись в минусе «всего» на 1,12%. Косвенно, это позитив – маржин коллы вчера выкупили, может быть немного подрастем.

Если говорить о ситуации на рынке в целом, то поводов для роста особо не наблюдается. Приход к власти Дональда Трампа, надежды на которого поддержали рынок во втором полугодии 2016 г., породил больше неопределённости на мировой арене, нежели придал импульс для роста. Обещания американского президента реализуются медленно, а в отношениях между Россией и США сдвигов не наметилось, скорее, наоборот.

Кроме того, корпоративные отчеты российских компаний за 1 квартал зафиксировали снижение прибыли. Более того, отнюдь не все госкомпании согласились выплатить 50% чистой прибыли в качестве дивидендов.

При смене настроений на рынке, рекомендуем обратить внимание, в первую очередь, на акции Сбербанка. Банк предоставил традиционно сильные квартальные результаты. Кроме того, внимания заслуживают дивидендные акции Татнефти АП и Мечела АП.

Сегодня состоится заседание ЦБ РФ. Результаты обычно публикуются в 13:30 мск. Мы ждем снижения процентной ставки на 0,25 п.п. Реакции рынка, как обычно, не будет – весь эффект «размажется» на более длинном временном отрезке.

Котировки USD/RUB в пятницу утром подрастают: российская валюта на минимумах с мая: доллар стоит около 57,8 руб. При нефти $46,97 за барр. – это еще немного, потенциал снижения рубля, в особенности, учитывая жесткий внешний фон, есть.

Источник: КИТ Финанс Брокер

Календарь событий

Макроэкономические события

Время	Событие	Период	Ед. изм.	Регион	Прежнее	Прогноз
Вторник 13 июня						
Заседание ФРС (13-14 июня)						
Публикация месячного отчета ОПЕК по рынку нефти (ориентировочно в 14:00-15:00 мск)						
15:30	Индекс цен производителей г/г	май	%	US	2,50	2,30
Среда 14 июня						
МЭА публикует месячный отчет по рынку нефти						
05:00	Промышленное производство г/г	май	%	CH	6,50	6,30
12:00	Промышленное производство г/г	май	%	EU	1,90	1,10
15:30	Индекс потребительских цен г/г	май	%	US	2,20	2,10
17:30	Запасы нефти по данным EIA	Неделя	млн. баррелей	US	3,30	-
21:00	Размер ключевой ставки ФРС	июнь	%	US	1,25	1,00
21:00	Пресс-конференция главы ФРС Джанет Йеллен					
Четверг 15 июня						
Ключевая ставка Банка Англии						
15:30	Первичные обращения за пособиями по безработице	неделя	тыс.	US	245,00	-
16:15	Промышленное производство	май	%	US	1,00	0,20
Пятница 16 июня						
Ставка по избыточным резервам Банка Японии						
12:00	Индекс потребительских цен г/г	май	%	EU	0,40	-0,10
13:30	Размер ключевой ставки ЦБ РФ	июнь	%	RU	9,75	9,25
15:00	Пресс-конференция главы РФ Эльвиры Набиуллиной					
16:00	Промышленное производство	май	%	RU	2,30	1,90
16:00	ВВП г/г	1кв.	%	RU	0,30	-
17:00	Индекс потребительского доверия Университета Мичигана	июнь	-	US	97,70	97,10
20:00	Данные Baker Hughes по количеству буровых установок	неделя	ед.	US	927	-

Календарь событий

Корпоративные события российского рынка акций

Компания	Корпоративное событие
Среда 14 июня	
Ленэнерго	ГОСА
Четверг 15 июня	
ПИК	Делистинг с Лондонской биржи
Энел Россия	ГОСА
Пятница 16 июня	
Интер РАО	Последний день акции торгуются с дивидендами
ЛСР	Последний день акции торгуются с дивидендами
ОГК-2	Последний день акции торгуются с дивидендами
ТМК	Последний день акции торгуются с дивидендами

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.