

Премаркет. Ежедневный обзор от 28.06.2017

Прогноз на день

На внешних площадках с утра формируется умеренно негативная диспозиция. В легком минусе торгуются азиатские площадки, цены на нефть после вчерашнего роста почти на 2% находятся в отрицательной зоне. Brent оценивается в \$46,6 за баррель.

С учетом внешнего фона российские фондовые индексы откроют торговую сессию снижением.

Во второй половине дня рынок нефти может получить поддержку со стороны данных по запасам нефти в США, публикуемые EIA. Согласно консенсус-прогнозу, запасы на прошлой неделе сократились на 2,59 млн баррелей.

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 | 1878,94 | 1,00 | -2,86 | 2,02 |
| PTC | 1003,79 | 1,10 | -6,45 | 12,94 |
| S&P500 | 2419,38 | -0,81 | 0,15 | 20,94 |
| DJIA | 21310,66 | -0,46 | 1,09 | 24,33 |
| NASDAQ | 6146,62 | -1,61 | -1,02 | 33,78 |
| VIX | 11,06 | 11,72 | 12,74 | -53,63 |
| DAX | 12671,02 | -0,78 | 0,55 | 36,71 |
| Nikkei | 20225,09 | 0,36 | 2,73 | 32,11 |
| Shanghai Com. | 3191,20 | 0,18 | 2,61 | 10,20 |
| BOVESPA | 61675,46 | -0,82 | -3,76 | 25,24 |

Источник: Bloomberg

Индикаторы валютного рынка

| Наименование индикатора | Цена закрытия | Изменение (%) | | |
|-------------------------|---------------|---------------|-------|-------|
| | | День | Месяц | Год |
| Индекс домара | 96,39 | -1,06 | -1,08 | -0,16 |
| USD/RUB | 59,49 | 1,23 | 5,29 | -9,16 |
| EUR/RUB | 67,48 | 2,67 | 6,85 | -6,56 |
| EUR/USD | 1,13 | 1,40 | 1,39 | 2,83 |
| GBP/USD | 1,28 | 0,72 | 0,18 | -3,09 |
| JPY/USD | 112,35 | 0,44 | 0,92 | 10,15 |
| CNY/USD | 6,81 | -0,20 | -0,68 | 2,34 |

Источник: Bloomberg

Индикаторы товарных рынков

| Наименование индикатора | Цена закрытия | Изменение (%) | | |
|-------------------------|---------------|---------------|--------|-------|
| | | День | Месяц | Год |
| Нефть Brent (\$/бар) | 46,65 | 1,79 | -10,55 | -1,08 |
| Нефть WTI (\$/бар) | 44,24 | 1,98 | -11,16 | -4,51 |
| Золото (\$/унц) | 1247,17 | 0,20 | -1,55 | -5,85 |
| Серебро (\$/унц) | 16,67 | 0,34 | -3,95 | -6,06 |
| Платина (\$/унц) | 918,87 | 0,14 | -4,29 | -6,19 |
| Никель (\$/тонн) | 9225,00 | 2,65 | 1,83 | 1,40 |
| Медь (\$/тонн) | 5858,00 | 1,10 | 3,54 | 24,37 |
| Алюминий (\$/тонн) | 1875,00 | 1,16 | -3,72 | 15,72 |
| Натуральный газ | 3,04 | 0,33 | -6,15 | 11,82 |
| Уголь (\$/тонн) | 147,40 | 0,00 | -1,47 | 62,16 |

Источник: Bloomberg

Индексы ММВБ и РТС накануне синхронно выросли на 1% при поддержке роста цен на нефть. При этом фундаментальных причин для дальнейшего роста рынка не предполагается.

В центре внимания локального рынка - история Роснефти и АФК Системы. Арбитражный суд Республики Башкирии озвучил размер арестованных по иску Роснефти активов - 185 млрд руб. В связи с этим бумаги АФК оказались под давлением в очередной раз, капитализация компании снизилась до уровня конца 2014 г., но к закрытию торгов удалось отыграть часть потерь, в итоге снижение составило -6,38%. Негативное влияние распространилось и на дочернюю компанию МТС (-2,95%). Напомним, накануне появилась информация о заморозке 31,7% акций МТС. Бумаги на вчерашних торгах достигли минимума года, а по объему торгов заняли второе место, уступив лишь Сбербанку.

Цены на нефть по итогам вчерашних торгов продемонстрировали активный рост. Нефть марки Brent достигла уровня \$46,6 за баррель (+1,79%), WTI \$44,24 (+1,98%). На утро среды рынок нефти слегка корректируется вниз после выхода данных от Американского института нефти, свидетельствующих о росте запасов нефти в США на прошлой неделе.

Сегодня во второй половине дня рынок нефти может получить поддержку со стороны данных по запасам нефти в США, публикуемых EIA. Согласно консенсус-прогнозу, запасы на прошлой неделе сократились на 2,59 млн баррелей.

Несмотря на вчерашний рост нефтяных котировок, рубль во вторник остался в минусе. Курс пары USDRUB составил 59,49 руб. (+1,23%), пара EURRUB оценивалась в 67,46 руб. (+2,67%). Национальная валюта остается без поддержки после окончания налогового периода, отметим и снижение активности среди участников торгов валютного рынка.

Но основные события разворачивались на глобальном валютном рынке. Курс пары EURUSD на вчерашних торгах поднимался до 1,135 на фоне заявлений главы Европейского центрального банка Марио Драги, который дал положительную оценку текущему курсу денежно-кредитной политики, а также выразил надежду на ускорения темпов роста ВВП и инфляции. Заявления М.Драги рынок расценил как сигнал регулятора о намерении свернуть стимулирующую программу раньше, чем ожидалось.

Рост европейской валюты заставил американский доллар снизиться до минимума за 9 месяцев. Значение индекса доллара составило 96,34. Помимо европейского фактора, на американскую валюту оказывает негативное давление и «затягивание» принятия законопроекта о реформе здравоохранения в США. Впрочем, перенос сроков голосования в Сенате сыграл против всего американского рынка: S&P 500 -0,81%, высокотехнологичный NASDAQ -1,61%, DJIA -0,46%.

Тем временем, международный валютный фонд (МВФ) ухудшил ожидания роста американской экономики на 2017 и 2018 гг. до 2,1% против ранее 2,3% и 2,5% соответственно. Основные риски МВФ видит в усилении политической нестабильности.

Календарь событий

Макроэкономические события

| Время | Событие | Период | Ед. изм. | Регион | Прежнее | Прогноз |
|----------------------------|---|--------|---------------|--------|---------|---------|
| Понедельник 26 июня | | | | | | |
| 15:30 | Заказы на товары длительного пользования | май | % | US | -0,80 | -0,60 |
| Вторник 27 июня | | | | | | |
| 17:00 | Индекс потребительского доверия от Conference Board | июнь | - | US | 117,90 | 116,90 |
| Среда 28 июня | | | | | | |
| 17:30 | Запасы нефти по данным EIA | неделя | млн. баррелей | US | -2,45 | - |
| Четверг 29 июня | | | | | | |
| 15:30 | Первичные обращения за пособиями по безработице | неделя | тыс. | US | 241,00 | - |
| 15:30 | ВВП (третья оценка) | 1 кв. | % | US | 2,10 | 1,20 |
| Пятница 30 июня | | | | | | |
| 04:00 | Индекс деловой активности в промышленности | июнь | - | CH | 51,20 | 51,00 |
| 04:00 | Индекс деловой активности в сфере услуг | июнь | - | CH | 54,50 | - |
| 15:30 | Ценовой индекс потребительских расходов г/г | май | % | US | 1,70 | - |
| 17:00 | Индекс потребительского доверия Университета Мичигана | июнь | - | US | 97,10 | 94,50 |
| 20:00 | Данные Baker Hughes по количеству буровых установок | неделя | ед. | US | 941 | - |

Календарь событий

Корпоративные события российского рынка акций

| Компания | Корпоративное событие |
|----------------------------|---|
| Понедельник 26 июня | |
| Аэрофлот | ГОСА (решение о выплате дивидендов) |
| РусГидро | ГОСА |
| Энел Россия | Последний день для покупки акций под дивиденды (дивиденд: 0,06822 руб.) |
| Распадская | Публикация производственных результатов за 2 кв. 2017 г. |
| Вторник 27 июня | |
| Роснефть/ АФК Система | Рассмотрение иска Роснефти и Башнефти к АФК Система |
| Среда 28 июня | |
| Четверг 29 июня | |
| СОЛЕРС | ГОСА |
| МТС | ГОСА |
| Роснефть | Последний день для покупки акций под дивиденды (дивиденд: 5,98 руб.) |
| ФСК ЕЭС | ГОСА |
| Пятница 30 июня | |
| ВТБ | Публикация финансовых результатов за 5 месяцев 2017 г. по МСФО |
| АЛРОСА | ГОСА |
| Газпром | ГОСА |
| Мечел | ГОСА |
| Россети | ГОСА |
| Мегафон | ГОСА |
| Башнефть | ГОСА |
| Юнипро | Последний день для покупки акций под дивиденды (дивиденд за 2016 г. + 1 кв. 2017 г.): 0,093676292+0,017348984 |
| Мосбиржа | Заседание наблюдательного совета (повестка: выплата промежуточных дивидендов) |

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.