

Премаркет. Ежедневный обзор от 05.12.2016

Прогноз на день

Сегодня основной удар примет на себя итальянский фондовый рынок, где давление испытают на себе акции банков.

Российский рынок акций пока находится в стороне от происходящего, реакция на итоги итальянского референдума будет минимальной.

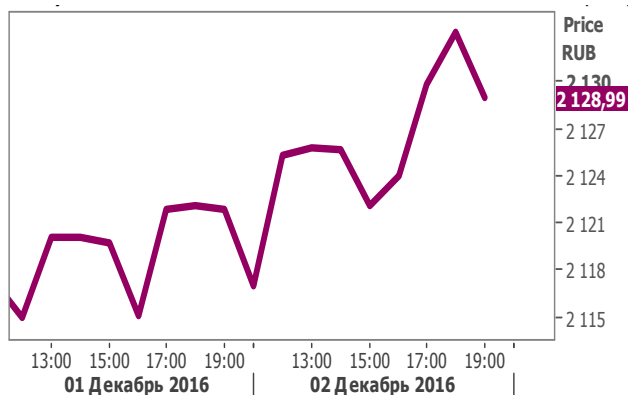
Тем не менее, неопределенность весьма высока. Мы продолжаем постепенно сокращать позиции в акциях и замещать их облигациями.

Мировые фондовые индексы

Наименование индикатора	Цена закрытия	Изменение (%)		
		День	Месяц	Год
MMB	2128,99	0,34	8,14	21,29
PTC	1050,21	0,27	7,93	29,38
S&P500	2191,95	0,04	4,48	4,79
DJIA	19170,42	-0,11	6,74	7,41
NASDAQ	5255,65	0,09	2,94	2,20
VIX	14,12	0,36	-26,92	-4,66
DAX	10513,35	-0,20	1,37	-2,22
Nikkei	18426,08	-0,47	7,54	-5,53
Shanghai Com.	3243,84	-0,90	4,55	-7,98
BOVESPA	60316,13	1,36	-4,75	32,97

Источник: Bloomberg

График индекса ММВБ (60 мин.)



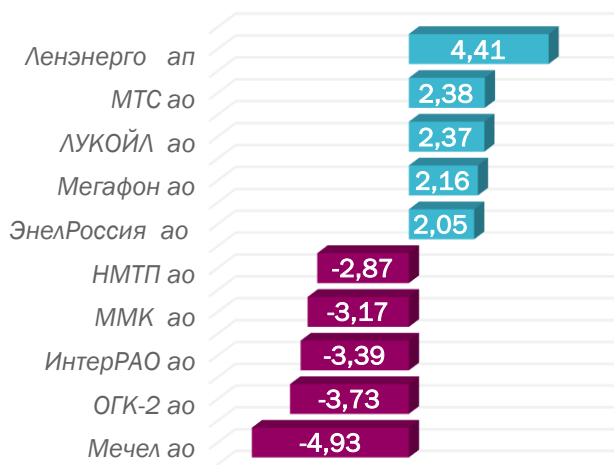
Источник: Reuters

Индикаторы валютного рынка

Наименование индикатора	Цена закрытия	Изменение (%)		
		День	Месяц	Год
Индекс домара	100,77	-0,27	3,46	2,46
USD/RUB	63,88	-0,16	0,57	-6,25
EUR/RUB	68,16	0,04	-3,30	-7,97
EUR/USD	1,07	0,02	-3,90	-1,98
GBP/USD	1,27	1,04	3,41	-15,81
JPY/USD	113,51	-0,51	9,87	-7,81
CNY/USD	6,87	-0,08	1,77	7,33

Источник: Bloomberg

Лидеры роста/падения, % за день



Источник: Reuters

Индикаторы товарных рынков

Наименование индикатора	Цена закрытия	Изменение (%)		
		День	Месяц	Год
Нефть Brent (\$/бар)	54,46	0,96	16,22	26,65
Нефть WTI (\$/бар)	51,68	1,21	13,98	29,30
Золото (\$/унц)	1177,43	0,49	-9,21	8,38
Серебро (\$/унц)	16,74	1,36	-9,41	15,06
Платина (\$/унц)	929,50	1,43	-6,16	5,57
Никель (\$/тонн)	11414,75	2,20	10,87	25,65
Медь (\$/тонн)	5760,00	-0,54	17,07	24,89
Алюминий (\$/тонн)	1716,50	-0,35	-0,49	10,81
Натуральный газ	3,44	-1,97	23,07	57,18
Уголь (\$/тонн)	305,00	-0,97	14,88	299,74

Источник: Bloomberg

Очередной черный лебедь прилетел на прошедших выходных: конституционная реформа в Италии провалилась, премьер Маттео Ренци признал поражение и объявил о своей отставке. Европейская валюта отреагировала процентным снижением к доллару США, обновив минимум с марта 2015 г.

После Brexit и победы Трампа рынки уже начали привыкать к тому, что 2016 г. богат на неожиданности. Сегодня основной удар примет на себя итальянский фондовый рынок, где сильнейшее давление испытают на себе акции банков. О долгосрочных последствиях волеизъявления итальянцев пока говорить преждевременно, но все происходящее однозначно не в пользу проблемных финансовых учреждений, планировавших после референдума начать процедуру списания субординированных займов и докапитализации.

Вероятно, акции банков будут падать на рынках всей объединенной Европы. Необходимо оценить уровень интегрированности наиболее слабых итальянских финансовых учреждений в

европейскую финансовую систему. Это позволит судить о том, какова истинная величина рисков для прочих банков еврозоны.

В Италии набирают силы евроскептики, так что в скором времени мы обязательно услышим словесные спекуляции на тему возможности выхода Италии из ЕС или по крайней мере отказа от единой валюты.

Российский фондовый рынок пока находится в стороне от происходящего, реакция будет минимальной. Но если итальянскому референдуму удастся «раскрутить маховик» коррекции на крупнейших мировых фондовых площадках, то и российский фондовый рынок так же снизится.

Неопределенность весьма высока, мы продолжаем постепенно сокращать позиции в акциях и замещать их облигациями.

Источник: КИТ Финанс Брокер

Календарь событий

Корпоративные события российского рынка акций

Компания	Корпоративное событие
Вторник 6 декабря	
НМТП	Публикация финансовых результатов 9 мес. 2016 г. по МСФО.
Среда 7 декабря	
Сбербанк	Публикация финансовых результатов по РСБУ за 11 мес. 2016 г.
Пятница 9 декабря	
Акрон	Публикация финансовых результатов и операционных за 3 кв. по МСФО.

Календарь событий

Макроэкономические события

Время	Событие	Период	Ед. изм.	Регион	Прежнее	Прогноз
Понедельник 5 декабря						
04:45	Индекс деловой активности в сфере услуг Caixin	ноябрь	-	CH	52,40	53,10
08:00	Индекс деловой активности в сфере услуг	ноябрь	-	RU	52,70	-
11:55	Индекс деловой активности в сфере услуг	ноябрь	-	GE	55,00	55,00
12:00	Индекс деловой активности в сфере услуг	ноябрь	-	EU	54,10	54,10
18:00	Индекс деловой активности в сфере услуг ISM	ноябрь	-	US	54,80	55,40
Вторник 6 декабря						
13:00	ВВП пересмотренный , г/г	3 кв.	%	EU	1,60	1,60
13:00	ВВП пересмотренный, кв/кв	3 кв.	%	EU	0,30	0,30
16:00	Индекс потребительских цен, г/г	ноябрь	%	RU	6,10	5,90
16:00	Индекс потребительских цен, м/м	ноябрь	%	RU	0,40	0,60
Среда 7 декабря						
10:00	Промышленное производство, м/м	октябрь	%	GE	-1,80	0,80
18:30	Запасы нефти EIA	неделя	Млн.	US	-0,88	-
Четверг 8 декабря						
Заседание ЕЦБ						
02:50	ВВП, г/г (пересмотренный)	3 кв.	%	JP	0,20	0,60
05:00	Торговый баланс	ноябрь	Млрд. долл.	CH	48,76	-
16:30	Первичные обращения за пособиями по безработице	неделя	Тыс.	US	268,00	-
Пятница 9 декабря						
18:00	Индекс потребительского доверия Университета Мичигана, предв.	декабрь	-	US	91,60	94,00
21:00	Количество буровых установок Baker Hughes	неделя	Ед.	US	597	-

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 (ООО).

Лицензии профессионального участника рынка ценных бумаг ФСФР России выданы на осуществление:

- дилерской деятельности № 078-06539-010000 от 14.10.2003,
- брокерской деятельности № 078-06525-100000 от 14.10.2003,
- деятельности по управлению ценными бумагами № 178-13670-001000 от 26.04.2012,
- депозитарной деятельности № 178-06467-000100 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 (ООО) не дает никаких гарантий корректности, содержащейся в настоящем обзоре информации. КИТ Финанс (ООО) не обязан обновлять или каким-либо образом актуализировать настоящий обзор, однако КИТ Финанс (ООО) 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 (ООО). КИТ Финанс (ООО) 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.