

Премаркет. Ежедневный обзор от 13.03.2017

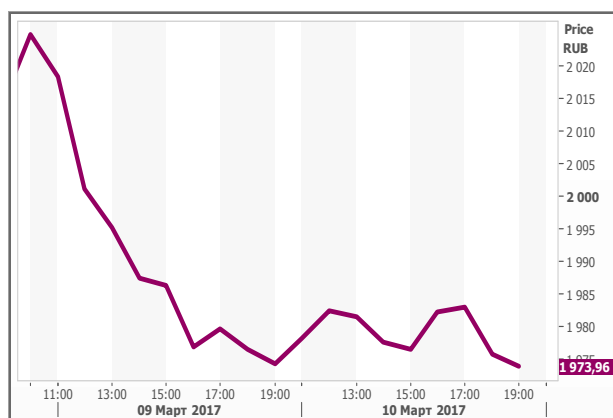
Прогноз на день

Внешний фон на утро понедельника носит умеренно позитивный характер. Азиатские площадки торгуются в «зеленой зоне». Нефтяные котировки теряют в пределах 0,7-0,9%. Американский рынок в пятницу завершил торги ростом основных рыночных индексов.

Открытие локального рынка акций, скорее всего, пройдет выше уровня закрытия пятницы.

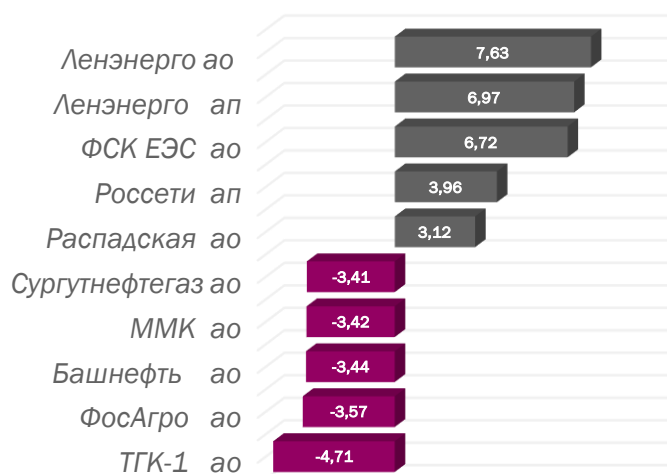
Корпоративные события: ТМК, РусАгро, ТГК-1 и Уралкалий представят финансовые результаты по МСФО за 2016 г.

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	1973,96	-0,01	-9,85	5,19
PTC	1055,93	0,86	-9,33	24,87
S&P500	2372,60	0,33	3,40	17,33
DJIA	20902,98	0,21	4,23	21,43
NASDAQ	5861,73	0,39	3,15	23,44
VIX	11,66	-5,20	1,83	-29,33
DAX	11963,18	-0,13	3,64	21,69
Nikkei	19604,61	1,48	3,14	15,74
Shanghai Com.	3212,76	-0,12	1,45	14,32
BOVESPA	64675,46	0,14	-0,25	30,29

Источник: Bloomberg

Индикаторы валютного рынка

Наименование индикатора	Цена закрытия	Изменение (%)		
		День	Месяц	Год
Индекс домара	101,25	-0,59	0,97	5,28
USD/RUB	59,00	-0,54	-0,39	-15,58
EUR/RUB	63,08	0,50	-0,28	-19,10
EUR/USD	1,07	0,91	-0,24	-4,30
GBP/USD	1,22	0,02	-2,97	-15,43
JPY/USD	114,78	-0,15	2,54	0,77
CNY/USD	6,90	-0,26	0,27	6,16

Источник: Bloomberg

Индикаторы товарных рынков

Наименование индикатора	Цена закрытия	Изменение (%)		
		День	Месяц	Год
Нефть Brent (\$/бар)	51,37	-1,57	-6,80	27,18
Нефть WTI (\$/бар)	48,49	-1,60	-7,36	25,95
Золото (\$/унц)	1204,64	0,28	-2,97	-3,59
Серебро (\$/унц)	17,04	0,44	-4,15	10,00
Платина (\$/унц)	942,60	0,66	-7,31	-2,07
Никель (\$/тонн)	9841,00	-2,51	-5,94	10,34
Медь (\$/тонн)	5732,00	0,74	-2,77	15,33
Алюминий (\$/тонн)	1868,00	0,66	1,56	17,32
Натуральный газ	3,01	1,14	-3,77	65,09
Уголь (\$/тонн)	159,40	-0,99	-5,12	93,21

Источник: Bloomberg

За прошлую неделю, которая прошла на фоне маржин-коллов и фиксации убытков, индекс ММВБ потерял 4%, РТС 4,7%. Если говорить про отдельные истории, то мощные распродажи наблюдались в акциях ФСК ЕЭС, капитализация компании снизилась почти на 17% за неделю. Кроме того, под ударом оказались акции ММК (-12,01%), Аэрофлота (-11,64%) и АЛРОСы (-10,28%). «Защитными» активами выступили обыкновенные акции Башнефти (+4,49%), СОЛЕРСа (+1,34%) и М.Видео (+0,26%).

Что касается динамики рынка в пятницу, то распродажи снизили темп. Индекс ММВБ продемонстрировал околонулевую динамику, оставшись возле отметки 1974 п. РТС вырос на 0,86%, до 1055,93 п. В лидерах роста - обыкновенные и привилегированные акции Ленэнерго: +7,63% и +6,97% соответственно. Совет директоров компании на заседании 6 марта утвердил список кандидатов в новый состав совета для избрания на внеочередном собрании акционеров. На 13 мест в совете директоров выдвинуто 20 кандидатур, из которых 13 - представители Россетей (владеет 68,25% обыкновенных акций Ленэнерго). Петербург в лице комитета по управлению госимуществом (владеет 29,08% обыкновенных акций) предложил 7 кандидатур. Заседание совета директоров, на котором, в том числе, будет определена дата годового собрания, должно состояться не позднее 5 мая 2017 г.

Напомним, что «префы» Ленэнерго являются нашими фаворитами среди дивидендных акций. Ожидаемый размер дивиденда за 2016 г. составит 8,1 руб., текущая дивидендная доходность - 16,2%.

Американский рынок по итогу прошедшей недели потерпел убытки на фоне снижения цен на нефть. Индекс DJIA снизился на 0,5%, S&P 500 потерял 0,4%, а NASDAQ Comp. скорректировался на 0,2%, последние два индикатора росли на протяжении последних шести недель подряд. При этом в прошлую пятницу рынок завершил торги на позитивной ноте.

В пятницу лучше рынка выглядели акции промышленного концерна General Electric Co. (+2,1%) и страховщика UnitedHealth Group Inc. (+1,2%). Лидерами снижения котировок стали бумаги производителя самолетов Boeing Co. (-1%) и банка Goldman Sachs Group Inc. (-0,7%).

Поддержкой рынку в пятницу выступили сильные данные по рынку труда США. Так, число рабочих мест в не с/х секторе увеличилось на 235 тыс., что превзошло консенсус-прогноз (+190 тыс.). Кроме того, предыдущее значение индикатора было пересмотрено в сторону увеличения: с 227 тыс. до 238 тыс. Таким образом, с нового года прирост рабочих мест стал рекордным с июля прошлого года. Ситуация на рынке труда стабильная, что является мощным аргументом для ФРС США в вопросе повышения процентной ставки уже на ближайшем заседании, итоги которого будут объявлены уже в эту среду. Так что в ближайшие дни фондовый рынок США займет выжидательную позицию, при этом волатильность может увеличиться.

Цены на нефть на утро понедельника находятся под давлением. Марка Brent теряет 0,66%, WTI снижается на 0,85%. По итогу прошлой недели нефтяные котировки снизились на 9%. Рынок прайсит риски, связанные с ростом активности «сланцевиков», которая может нивелировать эффект от соглашения ОПЕК по ограничению добычи нефти. Так, число буровых установок в США, по данным Baker Hughes, выросло за неделю, завершившуюся 10 марта, на 8 ед. до 617 против 386 годом ранее. Это самый высокий показатель с сентября 2015 г.

Сегодня внимание нефтяного рынка привлечет отчет EIA Drilling Productivity Report.

Календарь событий

Макроэкономические события

Время	Событие	Период	Ед. изм.	Регион	Прежнее	Прогноз
Понедельник 13 марта						
США перешли на летнее время						
Речь главы ЕЦБ Марио Драги (16:30 мск)						
Публикация EIA месячного отчета Drilling Productivity Report						
Вторник 14 марта						
05:00	Розничные продажи г/г	январь	%	CH	10,9	10,5
05:00	Промышленное производство г/г	январь	%	CH	6,00	6,20
10:00	Индекс потребительских цен м/м	февраль	%	GE	-0,6	0,6
10:00	Индекс потребительских цен г/г	февраль	%	GE	1,9	2,2
13:00	Промышленное производство г/г	январь	%	EU	2,0	0,9
13:00	Промышленное производство м/м	январь	%	EU	-1,6	1,3
15:30	Индекс цен производителей м/м	февраль	%	US	0,6	0,1
Среда 15 марта						
Заседание ФРС США						
Заседание Банка Японии						
15:30	Индекс потребительских цен м/м	февраль	%	US	0,6	0,1
15:30	Розничные продажи м/м	февраль	%	US	0,4	0,1
17:30	Запасы нефти EIA	неделя	млн. барр.	US	8,21	-
20:00	Размер ключевой ставки	-	%	US	0,5-0,75	0,875
Четверг 16 марта						
Заседание Банка Англии						
07:00	Размер ключевой ставки Японии	-	%	JP	-0,10	-0,10
13:00	Индекс потребительских цен г/г	февраль	%	EU	1,8	2,0
15:00	Размер ключевой ставки Англии	-	%	GB	0,25	0,25
Пятница 17 марта						
16:15	Промышленное производство	февраль	%	US	-0,30	0,20
17:00	Индекс потребительского доверия Университета Мичигана, пред.	март	-	US	95,70	96,00
21:00	Данные Baker Hughes по буровым установкам	неделя	ед.	US	756	-

Календарь событий

Корпоративные события российского рынка акций

Компания	Корпоративное событие
Понедельник 13 марта	
Энел Россия	Публикация финансовых результатов за 2016 г. по МСФО
ТМК	Публикация финансовых результатов за 2016 г. по МСФО
Вторник 14 марта	
Русагро	День инвестора
Русагро	Публикация финансовых результатов за 2016 г. по МСФО
Лукойл	Публикация финансовых результатов за 2016 г. по МСФО
ТКС	Публикация финансовых результатов за 2016 г. по МСФО
НОВАТЭК	Совет директоров рассмотрит дивиденды за 2016 г.
Среда 15 марта	
Сбербанк	Публикация финансовых результатов за 2016 г. по МСФО
ТГК-1	Публикация финансовых результатов за 2016 г. по МСФО
Polymetal	Публикация финансовых результатов за 2016 г. по МСФО
QIWI	Публикация финансовых результатов за 2016 г. по МСФО
Четверг 16 марта	
Дикси	Публикация финансовых результатов за 2016 г. по МСФО
Алроса	Публикация финансовых результатов за 2016 г. по МСФО
Юнипро	Публикация финансовых результатов за 2016 г. по МСФО
Русал	Публикация финансовых результатов за 2016 г. по МСФО
Пятница 17 марта	
ФСК ЕЭС	Публикация финансовых результатов за 2016 г. по МСФО
НорНикель	Публикация финансовых результатов за 2016 г. по МСФО
Вторник 21 марта	
Группа ЛСР	Публикация финансовых результатов за 2016 г. по МСФО
Юнипро	Публикация финансовых результатов за 2016 г. по РСБУ
Среда 22 марта	
Алроса	День инвестора
Эталон	Публикация финансовых результатов за 2016 г. по МСФО
Четверг 23 марта	
Русгидро	Публикация финансовых результатов за 2016 г. по МСФО
Пятница 24 марта	
Группа ПИК	Публикация финансовых результатов за 2016 г. по МСФО
Магнит	Публикация аудированных финансовых результатов за 2016 г. по МСФО
Распадская	Публикация финансовых результатов за 2016 г. по МСФО
Фосагро	Публикация финансовых результатов за 2016 г. по МСФО
Фармстандарт	Прекращение торгов акциями компании
Понедельник 27 марта	
X5 Retail Group	Публикация финансовых результатов за 2016 г. по МСФО
Четверг 30 марта	
РусГидро	Публикация финансовых результатов за 2016 г. по РСБУ

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 (АО).

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

- дилерской деятельности № 040-06539-010000 от 14.10.2003,
- брокерской деятельности № 040-06525-100000 от 14.10.2003,
- деятельности по управлению ценными бумагами № 040-13670-001000 от 26.04.2012,
- депозитарной деятельности № 040-06467-000100 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 (АО) не дает никаких гарантий корректности, содержащейся в настоящем обзоре информации. КИТ Финанс (АО) не обязан обновлять или каким-либо образом актуализировать настоящий обзор, однако КИТ Финанс (АО) 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 (АО). КИТ Финанс (АО) 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 (АО). Возможны комиссии третьих лиц.