

Премаркет. Ежедневный обзор от 25.09.2017

Прогноз на день

С утра формируется на внешних площадках нейтральная диспозиция. Нефтяные котировки находятся в слабом минусе. Нефть марки Brent оценивается в \$56,81 за баррель.

При условии понижения градуса геополитической напряженности на этой неделе индекс ММВБ имеет высокий шанс выйти за пределы верхней границы текущего диапазона.

Сегодня торги начнутся снижением акции Северстали и Акрона на фоне дивидендного гэта.

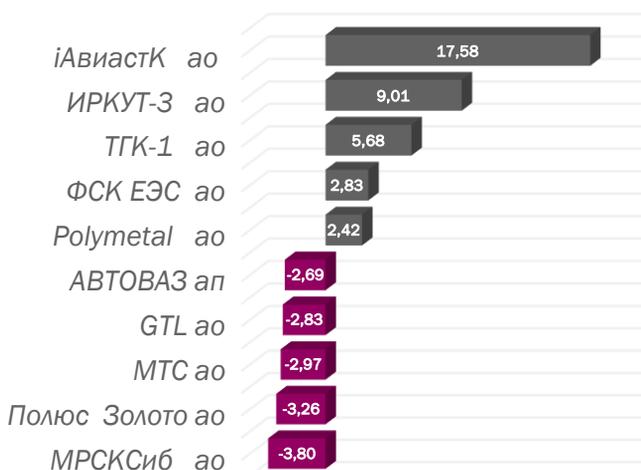
Выход макроэкономических данных, способных оказать влияние на ход торгов, сегодня не запланирован.

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	2051,63	-0,42	4,75	1,98
PTC	1123,24	0,28	7,49	13,01
S&P500	2502,22	0,06	2,38	15,59
DJIA	22349,59	-0,04	2,46	22,39
NASDAQ	6426,92	0,07	2,37	21,13
VIX	9,59	-0,83	-21,71	-21,97
DAX	12592,35	-0,06	3,43	18,49
Nikkei	20296,45	-0,25	4,43	21,14
Shanghai Com.	3352,53	-0,16	1,97	10,50
BOVESPA	75389,75	-0,28	6,97	28,44

Источник: Bloomberg

Индикаторы валютного рынка

Наименование индикатора	Цена закрытия	Изменение (%)		
		День	Месяц	Год
Индекс долара	92,17	-0,10	-1,05	-3,46
USD/RUB	57,50	-0,69	-2,65	-10,24
EUR/RUB	68,66	-0,71	-1,53	-4,55
EUR/USD	1,20	0,08	1,22	6,46
GBP/USD	1,35	-0,64	5,43	4,02
JPY/USD	111,99	-0,43	2,71	10,86
CNY/USD	6,58	0,33	-1,07	-1,21

Источник: Bloomberg

Индикаторы товарных рынков

Наименование индикатора	Цена закрытия	Изменение (%)		
		День	Месяц	Год
Нефть Brent (\$/бар)	56,86	0,76	8,16	23,90
Нефть WTI (\$/бар)	50,66	0,22	4,65	13,89
Золото (\$/унц)	1297,30	0,47	0,49	-3,01
Серебро (\$/унц)	17,00	0,21	-0,58	-13,67
Платина (\$/унц)	933,00	-0,62	-4,58	-11,48
Никель (\$/тонн)	10361,00	-5,37	-10,97	-3,87
Медь (\$/тонн)	6457,00	-0,35	-1,65	33,00
Алюминий (\$/тонн)	2141,50	-0,48	2,45	27,74
Натуральный газ	2,96	0,44	1,06	0,14
Уголь (\$/тонн)	200,60	-1,18	-0,30	-2,81

Источник: Bloomberg

Пятничные торги на российском фондовом рынке завершились разнонаправленно: индекс ММВБ снизился на 0,42%, до 2051,63 пунктов. РТС прибавил 0,28%, остановившись на уровне 1 112,24 пунктов. По итогу недели оба индикатора показали незначительное снижение на 0,11% и 0,02% соответственно. Последние 1,5 недели локальный рынок консолидируется в довольно узком диапазоне 2040-2060 пунктов, оставаясь в стороне от развивающегося конфликта между США и Северной Кореей. При условии понижения градуса геополитической напряженности на этой неделе индекс ММВБ имеет высокий шанс выйти за пределы верхней границы текущего диапазона.

Капитализация Алросы в пятницу выросла на 1,76%. Наблюдательный совет компании провел заседание, посвященное обсуждению причин аварии на руднике Мир. Как сообщил глава Минфина РФ, председатель наблюдательного совета Алросы Антон Силуанов, окончательные причины аварии на руднике до сих пор не установлены. В компании ждут результаты расследования аварии комиссией Ростехнадзора, которые могут быть представлены в ближайшие несколько недель. Что касается последствий аварии, то общий объем добычи алмазов изменится, но компания планирует предпринять ряд мер по нивелированию негативных последствий и поддержанию показателей компании на уровне прошлого года.

Любопытная ситуация развивается в электроэнергетике. Акции Россетей в пятницу заняли место среди аутсайдеров торгов. Давление оказала появившаяся в СМИ информация относительно того, что электросети в Крыму могут перейти под контроль компании в рамках реформы энергетики на территории полуострова. Таким образом, Россети могут стать ключевым бенефициаром нового Крымэнерго, что сулит компании новыми рисками. Во-первых, компания может попасть под западные санкции. Во-вторых, планируемая докапитализация Россетей в размере до 9 млрд руб. в 2018-2020 гг. может привести к размытию акционерного капитала.

Важно отметить и то, что на фоне распродажи в бумагах Россетей, спросом пользовались акции ФСК ЕЭС (+2,83%), что позволило последним выйти в лидеры роста в пятницу.

Сегодня торги начнут снижением акции Северстали и Акрона на фоне дивидендного гэпа. Акционеры Северстали за 2 кв. получают дивиденд в размере 22,28 руб., текущая дивидендная доходность 2,5%. Фактическое закрытие реестра акционеров состоится завтра, 26 сентября. В свою очередь, Акрон выплатит акционерам 235 руб. на акцию за 1 полугодие. Дивидендная доходность – 6,51%.

На этой неделе закроется реестр акционеров для получения дивидендов Московской биржи (29 сентября), с учетом режима торгов «Т+2» последний день для покупки акций под дивиденды – 27 сентября. Размер дивиденда за 1 полугодие составит 2,49, дивидендная доходность 2,14%.

Нефтяные котировки завершили прошлую неделю ростом, цены основных бенчмарков переписали многомесячные максимумы. По итогам заседания министерского комитета ОПЕК по мониторингу, прошедшего в прошлую пятницу в Вене, все страны-участницы соглашения об ограничении нефти выполнили свои обязательства на 100%, что, безусловно, поддерживает положительный ценовой тренд на рынке.

Тем временем, количество нефтяных скважин в США снижаются третью неделю подряд. На прошлой неделе их число сократилось еще на 5 единиц, до 744. При этом общее количество буровых (газовые + нефтяные) в США уменьшилось лишь на единицу, до 935 штук. Закрытие нефтяных компенсировано приростом новых газовых установок.

Пара USDRUB завершила торги на отметке 57,5 руб. Российская валюта на фоне роста цен на нефть укрепилась против доллара США и евро 0,7%. На этой неделе ждем умеренного роста рубля в диапазон 57,15-57,40 руб. На стороне национальной валюты, помимо нефтяного фактора, выступает налоговый период, пик которого придется на 25 сентября.

Источник: КИТ Финанс Брокер

Календарь событий

Макроэкономические события

Время	Событие	Период	Ед. изм.	Регион	Прежнее	Прогноз
Понедельник 25 августа						
-	-	-	-	-	-	-
Вторник 26 августа						
17:00	Индекс потребительского доверия от Conference Board	август	-	US	122,90	120,60
Среда 27 августа						
11:30	ВВП г/г	2 кв.	%	GB	2,00	1,70
15:30	Заказы на товары длительного пользования	август	%	US	-6,80	1,50
17:30	Запасы нефти EIA	неделя	млн. барр.	US	4,59	-
Четверг 28 августа						
15:00	Индекс потребительских цен г/г	сентябрь	%	GE	1,80	1,80
15:30	Первичные обращения за пособиями по безработице	неделя	тыс.	US	259,00	-
15:30	ВВП, третья оценка	2 кв.	%	US	1,40	3,00
Пятница 29 августа						
20:00	Индекс потребительского доверия Университета Мичигана, предварит.	сентябрь	-	US	96,80	96,00
20:00	Данные Baker Hughes по количеству буровых установок	неделя	ед.	US	935	-

Календарь событий

Корпоративные события российского рынка акций

Компания	Корпоративное событие
Понедельник 25 августа	
-	-
Вторник 26 августа	
Акрон	Закрытие реестра акционеров для выплаты дивидендов
Северсталь	Закрытие реестра акционеров для выплаты дивидендов (22,28 руб.)
Среда 27 августа	
Мосбиржа	Последний день для покупки акций под дивиденды (2,49 руб.)
Четверг 28 августа	
Эталон	Публикация финансовых результатов по МСФО за 1 полугодие 2017 г.
Пятница 29 августа	
ВТБ	Публикация финансовых результатов по МСФО за 8 мес. 2017 г.
Мосбиржа	Закрытие реестра акционеров для выплаты дивидендов
Роснефть	ВОСА (повестка: новая дивидендная политика)

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.