

Ключевые индикаторы рынка

Глобальные индикаторы			
	Последнее значение	Изменение за день, б.п.	Изменение за неделю, б.п.
UST10, USA	2,83	+4	+12
UST30, USA	3,89	+4	+9
Bund10, Germany	1,81	+8	+12
UK10, UK	2,90	+5	+13
Russia CDS 5yr	176	+3	+9

Еврооблигации			
	Последнее значение	Изменение за день, б.п.	Изменение за неделю, б.п.
Russia 30 цена, %	116,52	-40	-116
Russia 30 YTW, %	4,21	+7	+19
Russia 42 цена, %	98,48	-45	-132
Russia 42 YTM, %	5,73	+3	+9
Russia 30 – UST 10 спред, б.п.	138	+2	+8

Локальный рынок			
	Последнее значение	Изменение за день, б.п.	Изменение за неделю, б.п.
ОФЗ 26207, YTM, %	8,08	+4	+18
ОФЗ 26205, YTM, %	7,64	+3	+18
ОФЗ 26206, YTM, %	6,98	+1	+8
ОФЗ 26204, YTM, %	7,07	+1	+8
ОФЗ 25079, YTM, %	6,50	+4	+18
фьючерс на 6-летние ОФЗ, руб.	10160	+25	-53
Mosprime o/n, %	6,54	-13	-6
NDF 1m, %	6,67	-4	+6

Общерыночные индикаторы			
	Последнее значение	Изменение за день, коп.	Изменение за неделю, коп.
USDRUB	33,11	-15	+13
EURRUB	45,14	-11	+44

5 декабря 2013

Комментарий по рынку

Вчера на долговых рынках основной темой стал выход статистики по американской экономике. Наиболее ожидаемые данные – по приросту рабочих мест от агентства ADP и по продажам новых домов – оказались значительно лучше ожиданий аналитиков. Так, цифры по рынку труда от ADP составили 215 тыс. против прогноза в 170 тыс., причем цифры за предыдущий месяц были значительно пересмотрены (до 184 тыс. со 130 тыс.). При этом данные по продажам новых домов за октябрь показали сильный рост и составили значение 444 тыс. против ожиданий в 429 тыс. Выход хороших данных по американской экономике обострил ожидания более скорого сворачивания QE, как следствие доходность UST10 была отправлена на новые локальные максимумы, в моменте YTM десятилетки почти достигала 2,85%. Рынок евробондов на рост доходностей американских облигаций ответил достаточно ощутимой коррекцией. Последние сделки в суверенных евробондах РФ Россия-30 и Россия-42 проходили на уровнях 116,52 и 98,48% от номинала.

На рынке ОФЗ торги вчера проходили на немного более высоких уровнях, чем днем ранее. Однако вечером бумаги немного скорректировались и последние сделки в ОФЗ 26207 проходили чуть выше 102-й фигуры. В целом недостаточно сильная коррекция рублевых долговых инструментов стала результатом поддержки со стороны укрепляющегося рубля: курс российской валюты изменился за вчерашнюю сессию на 13 копеек, последнее значение – 33,15 руб. за долл. США.

Сегодня торговая сессия также как и вчерашняя обещает быть очень интересной. Снова по экономике США выйдет большая порция макроданных. В первую очередь интересны будут данные по ВВП США. Кроме этого, будет опубликована статистика по заявкам за пособиями по безработице, личному потреблению и промышленным заказам.

До момента выхода статистики мы ожидаем еще некоторую коррекцию в евробондах, которые, по нашему, мнению недостаточно просели после выхода вчерашних статданных. В то же время рынок ОФЗ может продолжить торговаться выше 102-й фигуры. Существенную поддержку сегодня будет оказывать укрепляющийся рубль

На денежном рынке ставки немного снизились, однако все равно продолжают находиться на очень высоких для посленалового периода уровнях. Mosprime o/n по состоянию на вчера - 6,54%, при этом мы не ожидаем, что ставки покажут заметное снижение в ближайшие дни.

Артур Копышев
Ведущий аналитик



Контактная информация

Копышев Артур

Ведущий аналитик

тел.: +7 (495) 755 55 07, доб. 206

e-mail: Kopyshev@mfc.ru

119049, Москва, ул. Коровий Вал, дом 9 тел.: +7 (495) 755 55 07 факс: +7 (495) 755 55 03 e-mail: info@mfc.ru

Настоящий бюллетень предназначен исключительно для информационных целей и является выражением частного мнения специалистов аналитического управления ОАО "МФЦ". Содержащаяся здесь информация и выводы не являются офертой или приглашением делать оферты на покупку или продажу каких-либо ценных бумаг, опционов, фьючерсов, других инструментов или производных на какой-либо из них. ОАО "МФЦ" не дает никаких гарантий в отношении достоверности и полноты содержащейся в бюллетене информации. Ни ОАО "МФЦ", ни ее агенты, ни аффилированные лица не несут никакой ответственности за любые убытки или расходы, связанные прямо или косвенно с использованием информации, содержащейся в бюллетене. Распространение, копирование, изменение, а также иное использование бюллетеня или какой-либо его части без письменного согласия ОАО "МФЦ" не допускается. Инвесторам необходимо принять во внимание, что доход от операций с ценными бумагами или других инвестиций может меняться, и цена или стоимость ценных бумаг и инвестиций может, как расти, так и падать. Соответственно, результаты инвестирования могут оказаться меньше первоначально инвестированных средств. Результаты инвестирования в прошлом не гарантируют доходов в будущем. ОАО "МФЦ" предупреждает, что операции с ценными бумагами связаны с различными рисками и требуют соответствующих знаний и опыта. ОАО "МФЦ" рекомендует получать регулярные консультации по вопросам финансов, налогов и права у специалистов соответствующей квалификации.

Открытое акционерное общество «Московский Фондовый Центр». ОГРН 1027739035796 Лицензии, выданные Федеральной службой по финансовым рынкам России: профессионального участника рынка ценных бумаг на осуществление брокерской деятельности от 17.10.2003 № 077-06554-100000, профессионального участника рынка ценных бумаг на осуществление дилерской деятельности от 17.10.2003 № 077-06564-010000, профессионального участника рынка ценных бумаг на осуществление деятельности по управлению ценными бумагами от 07.09.2010. № 077-13305-001000.