

Комментарий

14 февраля, в четверг, на рынке российских облигаций как в рублевом, так и валютном сегменте наблюдалось падение цен на фоне эскалации санкционных рисков. Торговые обороты также выросли. Среди государственных рублевых облигаций под давлением были ОФЗ по всей длине кривой, но в особенности просели бумаги с дюрацией от 5 лет. Так, котировки выпуска ОФЗ-26221 упали на 1,1%, бумаги ОФЗ-26223 потеряли 0,5%, котировки выпуск ОФЗ-26225 снизились на 0,9%. ОФЗ с дюрацией от 7 лет упали на 1%: бумаги серии ОФЗ-26218 и ОФЗ-26224.

На рынке корпоративных рублевых облигаций наблюдалось падение котировок. В лидерах по темпам снижения оказался нефтегазовый сектор. Среди наиболее ликвидных бумаг под давлением оказались выпуск РоснфтБ7, цена которых упала на 0,7%. Котировки бумаг РоснфтБ1 и Роснфт2Р5 потеряли 0,3%. В пределах 25 б.п. упали цены выпусков РЖД1Р-12R, РСХБ БО-3Р, ГТЛК 1Р-13.

Сегмент российских валютных облигаций также испытал распродажи. Пятилетние CDS взлетели до максимальных значений в этом году и превысили 147 б.п. Кривая доходности суверенных выпусков выросла примерно на 10 б.п. В лидерах по темпам снижения были выпуски отечественных банков.

Динамика доходности индекса государственных облигаций RGBITR и объема торгов (млн. руб.)



Источник: Bloomberg, ПАО Московская биржа

Итоги торгов российскими рублевыми облигациями

Выпуск	Цена закрытия	Изм. цены за день (%)	Объем торгов (млн. руб.)	Выпуск	Цена закрытия	Изм. цены за день (%)	Объем торгов (млн. руб.)
ОФЗ 26207	99,764	-0,68%	8 454	СИБУРХол11	100,77	-0,02%	86
ОФЗ 26223	93,58	-0,50%	4 894	КраснодКр1	100,45	-0,05%	86
ОФЗ 26221	94,699	-1,06%	3 066	ВЭБ ПБО1Р9	100,01	-0,49%	72
ОФЗ 26225	90,2	-0,88%	1 973	СберБ БО18	100,54	-0,01%	72
ОФЗ 26218	101,25	-0,98%	1 240	ОФЗ 26215	96,208	-0,51%	67
ОФЗ 26224	90,35	-0,97%	1 192	ОФЗ 26217	99,383	-0,19%	67
РоснефтьБ7	100,05	-0,69%	995	Новсиб 8об	104,7	0,14%	50
ОФЗ 26210	99,369	-0,05%	862	ОФЗ 26219	97,46	-0,86%	50
ОФЗ 26208	99,978	0%	841	РЖД 1Р-07R	93,15	-0,47%	48
ОФЗ 26216	99,76	-0,03%	766	СберБ БО3R	99,9	-0,09%	46
ОФЗ 26226	98,698	-0,61%	666	АЛЬФА-Б2Р2	100,75	-0,30%	42
ОФЗ 26212	92,801	-0,56%	579	ОФЗ 29006	103,277	-0,11%	38
ОФЗ 26211	96,55	-0,67%	570	КрасЯрКр16	100,04	-1,00%	35
ВБРР Б1Р1	100,1	0,20%	537	ДОМ 1Р-3R	99,82	0,12%	32
ОФЗ 26222	95,583	-0,64%	454	РЖД-19 обл	99,7	0%	30
Роснфт2Р5	93,33	-0,28%	335	ВЭБ ПБО1Р7	100,67	0,02%	29
КОБР-18	100	0%	250	РСХБ БО-6Р	100	0%	28
РЖД 1Р-12R	99,75	-0,25%	229	СберБ Б12R	98,03	-0,06%	25
ПромсвбБП1	101,8	-0,20%	203	ГПБ 1Р-05Р	100,7	-0,15%	22
РоснефтьБ1	100,2	-0,30%	200	Росбанк2Р4	100,3	-0,40%	21
ОФЗ 52002	94,76	-0,25%	187	СберБ БО4R	96,95	-0,42%	21
РСХБ БО-5Р	95,97	-0,01%	176	Газпнф1Р6R	93,53	-0,29%	17
ГТЛК 1Р-13	100,25	-0,25%	173	ВЭБ 1Р-12	101,21	-0,09%	16
ОФЗ 25083	97,999	-0,25%	170	УрКаПБО4Р	93,6	-0,20%	16
ОФЗ 29012	99,909	-0,07%	168	ОФЗ 24019	99,88	-0,09%	16
ОФЗ 26214	98,469	-0,03%	164	РЖД Б01Р1R	100,15	-0,45%	16
ОФЗ 26209	99,075	-0,28%	149	НафттрнБО1	100,97	0,07%	15
ЯрОбл 2017	99,99	0%	143	Роснфт2Р4	95,24	-0,23%	15
РСХБ БО 3Р	99,1	-0,29%	122	РЖД Б01Р4R	97	0,21%	14
КОБР-16	100,01	0%	100	Мордовия03	102	-0,39%	14
ОФЗ 29011	100,621	-0,01%	98	ГазпромБ22	96,3	0,84%	14
ОФЗ 26220	98,231	-0,28%	97	ГПБ БО-16	101,15	-0,34%	14
ФолксвБ1Р3	100,1	-0,20%	93	РЖД-28 обл	100,28	-0,07%	13
ОФЗ 26205	99,8	-0,11%	88	МежИнБ01Р1	99,8	-0,10%	12

Источник: Bloomberg, ПАО Московская биржа

Календарь событий долговых рынков на 15 февраля

- ВТБ-КС-3-138 75 000 000 000 руб.
- ВЭБ-лизингБО-05 (оферта) 5 000 000 000 руб.
- ВЭБ.РФПБО-001Р-К118 20 000 000 000 руб.
- Русфинанс БанкБО-001Р-01 (оферта) 4 000 000 000 руб.

Заявление об ограничении ответственности. Настоящие обзоры подготовлены в информационных целях, Они ни в коем случае не являются и не должны рассматриваться как предложение купить или продать соответствующие ценные бумаги, Информация, содержащаяся в данных обзорах, получена из вызывающих доверия открытых источников, Несмотря на то, что при подготовке обзоров были предприняты необходимые меры для получения достоверной информации, ПАО "ИК РУСС-ИНВЕСТ" не исключает возможность включения в обзор ошибочной информации, предоставленной соответствующими источниками, и не несет за это ответственности, ПАО "ИК РУСС-ИНВЕСТ", его работники и клиенты могут быть заинтересованы в покупке или продаже ценных бумаг, упомянутых в обзорах.

ПАО "ИК РУСС-ИНВЕСТ"

<http://www.russ-invest.com>

Москва

Тел: +7(495) 363-93-80

Факс: +7(495) 363-93-90

E-mail: mail@russ-invest.com

Адрес: Москва, 119019, 5-3/12 Нащокинский переулок

© 2007 | ПАО "ИК РУСС-ИНВЕСТ"

Лицензия № 045-11769-001000

Лицензия № 045-08757-000100

Лицензия № 045-06310-100000

Лицензия № 045-06312-010000