Рубль падает на оттоке капитала

Аналитик Альпари Михаил Крылов

Центральный банк сегодня бережёт свои резервы. После открытия рубль побалансировал около вчерашнего закрытия. Но снижение цен на нефть на 2 доллара за баррель привело к росту доллара. Пара доллар/рубль подскочила к вчерашнему курсу рубля по фьючерсам на бирже CME 31,2.

На 15:54 пара доллар США/российский рубль растёт до 31,2250 против 30,8075 в понедельник расчётами "сегодня" и до 31,3805 против 30,9050 расчётами "завтра". Пара евро/рубль дорожает до 42,75 против 42,51 расчётами "сегодня" и до 42,9146 против 42,57 расчётами "завтра". Бивалютная корзина растёт до 36,5725 против 36,1543.

К 15:49 ноябрьские фьючерсы на нефть марки WTI на бирже Nymex падали на 39 центов до 85,99 доллара за баррель. Декабрьские фьючерсы на нефть марки Brent на бирже ICE падали на 87 центов до 109,21 доллара за баррель.



Курс рубля во фьючерсах на CME на 81% взаимосвязан с индексом MSCI Russia – показателем капитализации фондового рынка и ориентиром для инвесторов с активами нескольких триллионов долларов. На момент написания индекс падает на 1,54% по сравнению с предыдущим днём.

Вес акции в индексе зависит среди прочего от её доступности. Количество акций также служит ориентиром для выбора веса. Чуть меньше чем на треть индекс зависит от Газпрома, на втором месте по весу Лукойл, а на третьем

Сбербанк.

Ставки привлечения межбанковского кредита в рублях на рынке МИБИД сегодня выросли на 8 сотых процентного пункта. Они имеют позитивную корреляцию с курсом доллара 45%. Если взять курс рубля в день t и ставку MIBID в день (t-10), корреляция увеличивается до 47%, а в день (t-20) – до 50%. Трёхмесячный межбанковский кредит в рублях дорожает с 3,6% летом до 5,9% сейчас. Это отражает неуверенность банков в перспективах валюты РФ.

На 15:24 по статье наиболее активных на CME декабрьских фьючерсах торгуется 127 контрактов. Курс доллара к рублю в них находится на уровне 31,5756, что на девять десятых процента выше уровня предыдущего закрытия. При этом курс в ноябрьских фьючерсах находится на отметке 31,3972, и это тоже выше вчерашнего.