

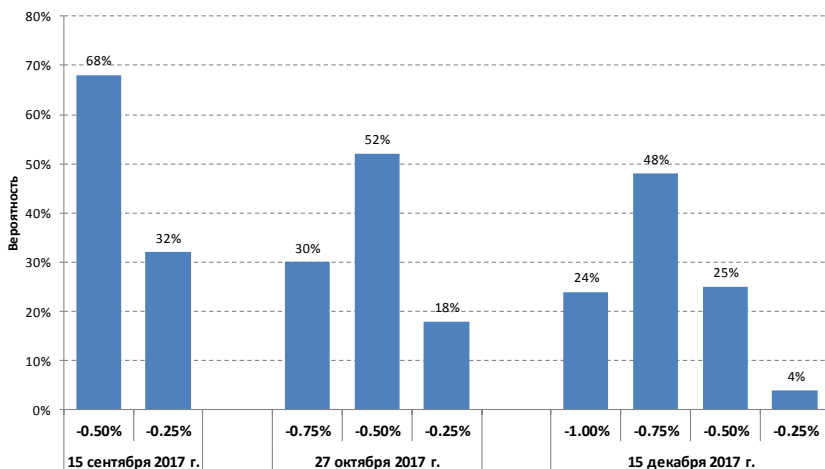
КОРОТКИЕ СТАВКИ WEEKLY

MOEX.COM/RU/RUONIA

14.09.2017

Ожидания по ставкам из котировок фьючерсов RUONIA

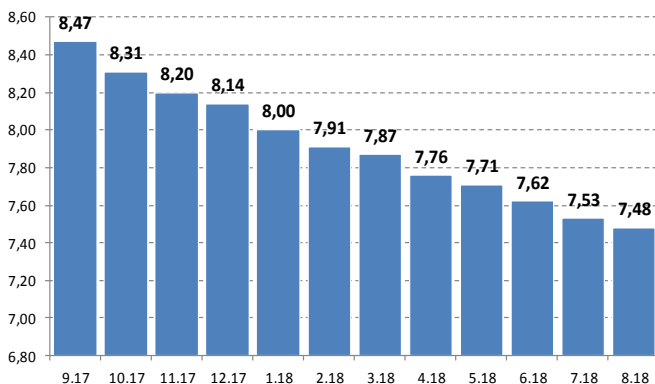
Изменение ключевой ставки относительно текущего значения - вероятности



Изменения ставки на каждом заседании - вероятности

Дата заседания	Фьючерс	Котировка	Ожидаемая RUONIA после заседания	Спред RUONIA к Ключевой	Ключевая после заседания	Ключевая до заседания	Изменение	Вариант 1	Вариант 2	Вер-ть 1	Вер-ть 2
15 сентября	RUON-10.17	91,70	8,31	-0,28	8,58	9	-42	-25	-50	32%	68%
27 октября	RUON-11.17	91,80	8,20	-0,28	8,48	8,58	-11	0	-25	56%	44%
15 декабря	RUON-1.18	92,00	8,00	-0,28	8,28	8,48	-20	0	-25	20%	80%

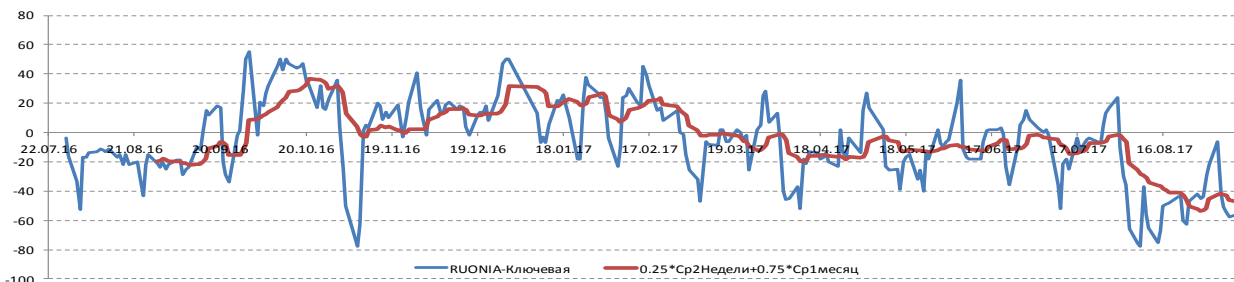
Ожидания по средней ставке RUONIA на год вперед



Прогноз купонов по ОФЗ-ПК

Выпуск	Дата купона0	Купон0	Купон1 (прогноз)	Купон2 (прогноз)
24018	27.12.17	10,46		
24019	18.10.17	10,35	9,13	8,27
29011	31.01.18	10,44	9,19	8,65
29012	22.11.17	10,32	9	8,27
29006	07.02.18	10,61	9,4	8,87

Спред между RUONIA и ключевой ставкой



Команда Срочного рынка по развитию фьючерсов на процентные ставки

elena.shigaeva@moex.com
+7 (495) 363-32-32
доб. 26057

vadim.zakroyschikov@moex.com
+7 (495) 363-32-32
доб. 26064

alexander.ezhov@moex.com
+7 (495) 363-32-32
доб. 26061

irina.bukharina@moex.com
+7 (495) 363-32-32
доб. 26062