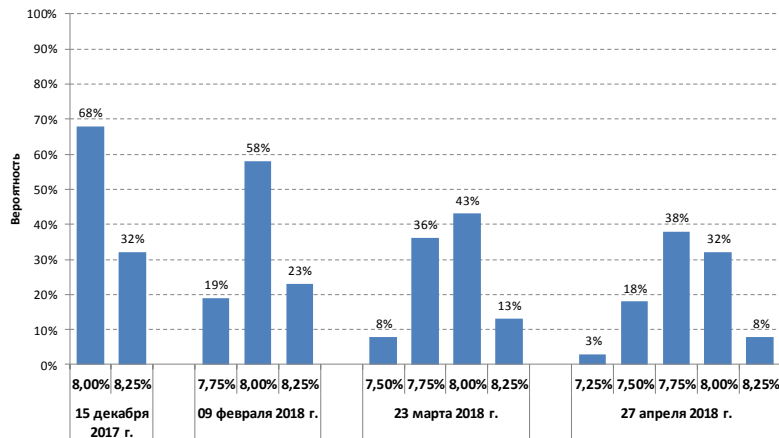


ВЕРОЯТНОСТИ БУДУЩИХ КОРОТКИХ СТАВОК

MOEX.COM/RU/RUONIA
06.11.2017

Ожидания по ставкам из котировок фьючерсов RUONIA

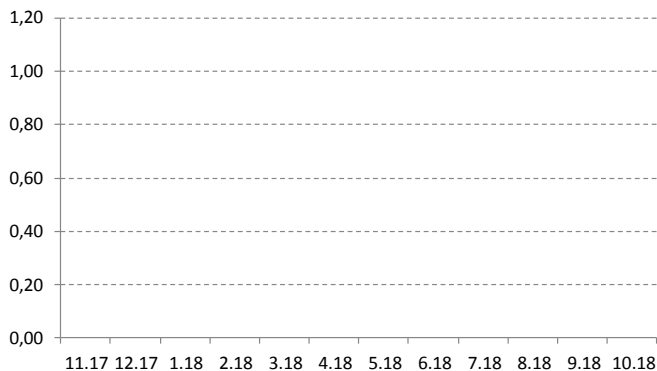
Ожидания по ключевой ставке - вероятности



Изменения ставки на каждом заседании - вероятности

Вероятно	Вероятность	Фьючерс, отражающий ставку после заседания	Котировка	Ожидаемая ср. RUONIA за месяц	Ожидаемый спред ключевая-RUONIA	Ожидаемая ключевая после заседания	Ожидаемая
		RUON-1.18					
		RUON-3.18					
		RUON-4.18					
		RUON-5.18					
		RUON-7.18					
		RUON-8.18					
		RUON-10.18					

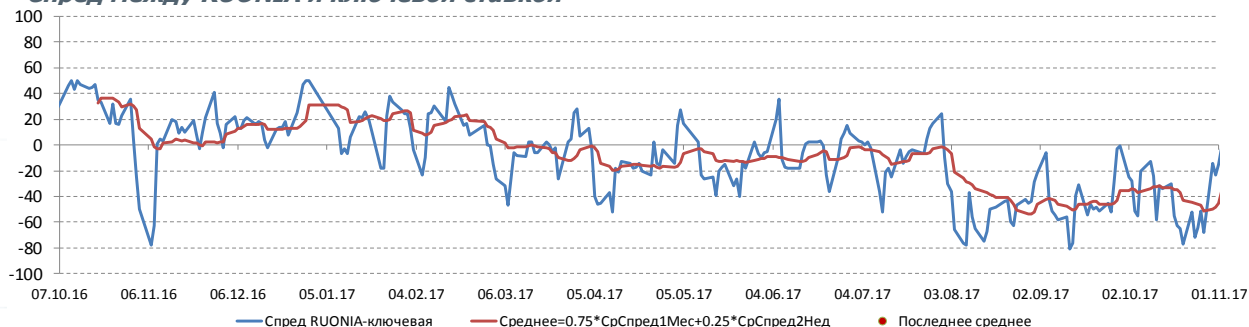
Ожидания по средней ставке RUONIA на год вперед



Прогноз купонов по ОФЗ-ПК

Дата купона	Купон0	Купон1 (прогноз)	Купон2 (прогноз)
27.12.17	10,46		
18.04.18	9,12		
31.01.18	10,44		
22.11.17	10,32		
07.02.18	10,61		

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