

РОССИЙСКИЕ ЕВРООБЛИГАЦИИ

Экономические показатели и данные квартальных отчетов корпораций, поступающие с начала недели, воспринимались участниками рынка нейтрально. Фондовые индексы в Европе и США продолжили колебания в районе значений, достигнутых ранее, с незначительными изменениями по итогам дня.

Данные по жилищному строительству в США за сентябрь вышли хуже ожиданий: показатели числа домов, начатых строительством, и числа полученных разрешений на строительство снизились к августу примерно на 5% против прогноза снижения соответственно на 0,4% и на 2,1%.

Мировые цены на нефть подросли, с 57,9 до 58,2 долл. за барр. по фьючерсам на Brent, после публикации данных Министерства энергетики США о сокращении запасов сырой нефти четвертую неделю подряд, на 5,7 млн. барр. против прогноза сокращения на 3,3 млн. барр.

Рынок UST отреагировал на заявление пресс-секретаря Белого дома С. Сандерс о том, что президент США Д. Трамп может назвать имя рекомендуемого им кандидата на пост председателя ФРС в ближайшие дни. Поскольку в начале недели СМИ сообщали о «благоприятном впечатлении», которое в качестве одного из кандидатов произвел на Д. Трампа профессор Стэнфордского университета Дж. Тейлор, известный как сторонник более «жесткой» денежно-кредитной политики, доходность UST повысилась – на 5 б.п., до 2,35% по 10-летним облигациям.

Спред по доходности еврооблигаций развивающихся стран к UST, определяемый через индекс JP Morgan EMBI+ сузился с 318 б.п. до 314 б.п.

Спред по доходности РФ-42 к 30Y UST расширился со 202 б.п. до 203 б.п.

Состояние рынка за **18.10.2017**



Цены закрытия и доходности российских еврооблигаций (bid и ask)

Russia 18	106,715	2,054	106,885	1,841
Russia 19	101,267	2,453	101,662	2,132
Russia 20	105,783	2,618	106,174	2,463
Russia 22	106,677	2,892	107,075	2,800
Russia 23	108,840	3,219	109,025	3,186
Russia 26	105,620	3,972	105,870	3,938
Russia 27	101,719	4,033	102,050	3,992
Russia 28	175,355	4,005	175,840	3,967
Russia 30	117,725	2,761	117,955	2,707
Russia 42	110,829	4,863	111,549	4,816
Russia 43	114,898	4,858	115,643	4,812
Russia 47	102,201	5,105	102,752	5,069