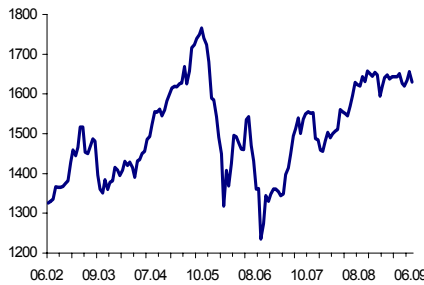




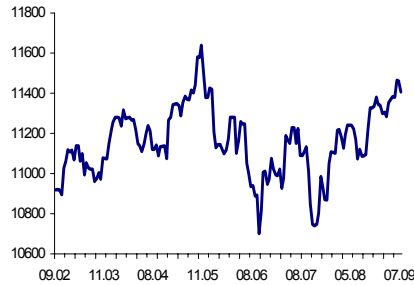
Утренний обзор рынка акций

7 сентября 2006 г.

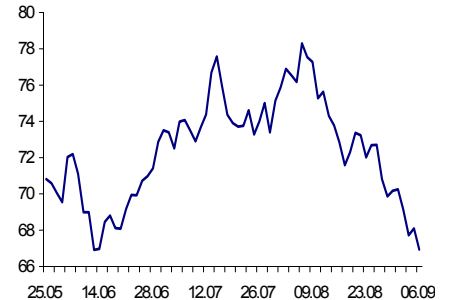
Индекс РТС



Индекс DOW



IPE Crude Future



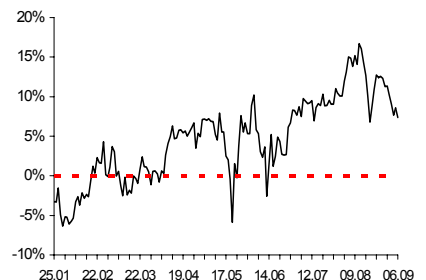
MSCI Emerging Markets



MSCI Russia (относительно 01.01.1999 г.)



Превышение фактического MSCI RUS над модельным (перекупленность/перепроданность)



Вклад факторов в изменение индекса MSCI Rus

темпы роста	факт MSCI RUS	Вклад фактора MSCI EMF	Вклад фактора доходности к погашению по евробондам	Вклад прочих событий
06.09	-2,147%	-1,072%	0,014%	-1,101%

Среда стала неудачным днём для мировых рынков.

Индекс РТС упал на 1,5% до уровня 1630,27 пункта, в течение торговой сессии продемонстрировав ещё более уверенное движение вниз, чем позавчера вверх.

Индекс DOW упал на 0,47% по причине усиления беспокойства инвесторов, что ФРС поднимет учётную ставку на следующем заседании. На европейские акции также повлияло заявление МВФ о том, что риски для экономического роста усиливаются.

Индекс MSCI Emerging Markets упал на 1,07%. Исходя из модели MSCI Russia, на российский рынок в наибольшей степени повлияли случайные события, к которым, кроме вышеупомянутых, можно причислить и продолжающую дешеветь нефть, а в несколько меньшей – поведение развивающихся рынков.

Архипов Андрей



Результаты работы механических торговых систем

7 сентября 2006 г.

МТС «Сто хастиков». Акции РАО «ЕЭС».

позиции на 05.09 18:45 покупка 2000 шт.

сделки за 06.09

тип	цена исполнения	объём (акций)	время
покупка закрытие	21,06	2000	12:00
продажа открытие	21,06	2000	12:00

позиции на 06.09 18:45 продажа 2000 шт.



МТС «Прорыв». Акции РАО «ЕЭС».

позиции на 05.09 18:45 покупка 2000 шт.

сделки за 06.09

тип	цена исполнения	объём (акций)	время
покупка закрытие	21,07	2000	12:00

позиции на 06.09 18:45 нет позиций





Результаты работы механических торговых систем 7 сентября 2006 г.

МТС «Отскок». Акции РАО «ЕЭС».

позиции на 05.09 18:45 покупка 2000 шт.

сделки за 06.09

тип	цена исполнения	объём (акций)	время
нет сделок			

позиции на 06.09 18:45 покупка 2000 шт.



МТС «МакДи возвращается». Акции РАО «ЕЭС».

позиции на 05.09 18:45 покупка 2000 шт.

сделки за 06.09

тип	цена исполнения	объём (акций)	время
нет сделок			

позиции на 06.09 18:45 покупка 2000 шт.





Результаты работы механических торговых систем 7 сентября 2006 г.

МТС «Банда Боллинджера». Акции РАО «ЕЭС».

позиции на 05.09 18:45 покупка 6000 шт.

сделки за 06.09

тип	цена исполнения	объём (акций)	время
покупка закрытие	20,88	6000	14:00

позиции на 06.09 18:45 нет позиций



www.reflexivity.ru

Исследовательский Центр ООО «Рефлексивность ру»
Адрес: Санкт-Петербург, Лиговский пр. д. 50 кор. 6, офис 34.
Телефон/Факс: +7 (812) 331-89-29

Генеральный директор: **Ичкидидзе Юрий Роландович** (ichkitidze@reflexivity.ru)
Специалист по развитию: **Рыбин Александр Сергеевич** (rybin@reflexivity.ru)
Аналитик: **Архипов Андрей Анатольевич** (arhipov@reflexivity.ru)