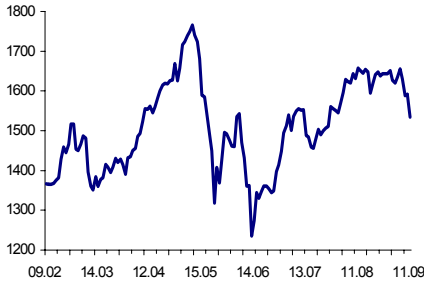




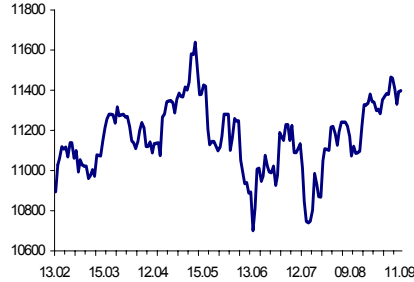
## Утренний обзор рынка акций

12 сентября 2006 г.

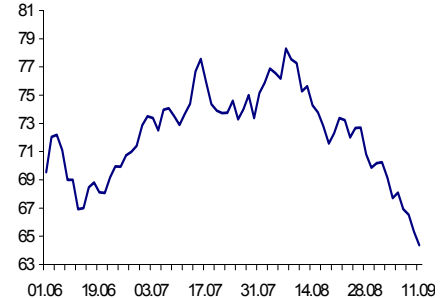
Индекс РТС



Индекс DOW



IPE Crude Future



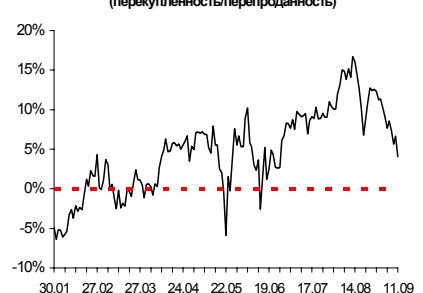
MSCI Emerging Markets



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
11.09	-4,345%	-1,999%	0,018%	-2,412%

Индекс РТС завершил второй торговый день этой недели значительным снижением значения до отметки 1534,68 пункта, показав темпы роста на уровне -3,55%. Падение проходило на фоне как снижения цен на сырьё, в частности на нефть, которая

продолжила серию трёхдневного падения и опустилась на 1,47% до отметки 64,37 доллара за баррель, так и падения акций европейских компаний.

Индекс MSCI Emerging Markets потерял 2% в своём значении, тогда как фактическое значение индекса MSCI Russia потеряло все 4,35%. Зона перекупленности сократилась до 4,07% и, вполне возможно, сократится ещё больше.

Американский индекс DOW неоднозначно отреагировал на снижение цен на нефть и на момент закрытия торговой сессии вырос только на 0,04%, в течение дня не продемонстрировав единого направления движения.

Архипов Андрей



## Результаты работы механических торговых систем

12 сентября 2006 г.

### МТС «Сто хастиков». Акции РАО «ЕЭС».

позиции на 08.09 18:45 нет позиций

сделки за 11.09

тип	цена исполнения	объём (акций)	время
продажа открытие	19,73	2000	11:00

позиции на 11.09 18:45 продажа 2000 шт.



### МТС «Прорыв». Акции РАО «ЕЭС».

позиции на 08.09 18:45 нет позиций

сделки за 11.09

тип	цена исполнения	объём (акций)	время
продажа открытие	19,73	2000	11:00
продажа закрытие	19,81	2000	13:00
продажа открытие	19,53	2000	18:00

позиции на 11.09 18:45 продажа 2000 шт.





## Результаты работы механических торговых систем 12 сентября 2006 г.

### МТС «Отскок». Акции РАО «ЕЭС».

позиции на 08.09 18:45 покупка 2000 шт.

сделки за 11.09

тип	цена исполнения	объём (акций)	время
<span style="color: green;">покупка</span> закрытие	19,73	2000	11:00
<span style="color: red;">продажа</span> открытие	19,73	2000	11:00
<span style="color: red;">продажа</span> закрытие	19,77	2000	14:00
<span style="color: green;">покупка</span> открытие	19,77	2000	14:00
<span style="color: green;">покупка</span> закрытие	19,86	2000	17:00
<span style="color: red;">продажа</span> открытие	19,86	2000	17:00

позиции на 11.09 18:45 продажа 2000 шт.



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

позиции на 08.09 18:45 нет позиций

сделки за 11.09

тип	цена исполнения	объём (акций)	время
нет сделок			

позиции на 11.09 18:45 нет позиций





## Результаты работы механических торговых систем 12 сентября 2006 г.

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

позиции на 08.09 18:45

нет позиций

сделки за 11.09

тип	цена исполнения	объём (акций)	время
продажа открытие	19,73	2000	11:00
продажа закрытие	19,84	2000	12:00
продажа открытие	19,67	2000	15:00
продажа открытие	19,73	2000	16:00

позиции на 11.09 18:45

продажа 4000 шт.



[www.reflexivity.ru](http://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](mailto:ichkitidze@reflexivity.ru))  
Специалист по развитию: **Рыбин Александр Сергеевич** ([rybin@reflexivity.ru](mailto:rybin@reflexivity.ru))  
Аналитик: **Архипов Андрей Анатольевич** ([arhipov@reflexivity.ru](mailto:arhipov@reflexivity.ru))