



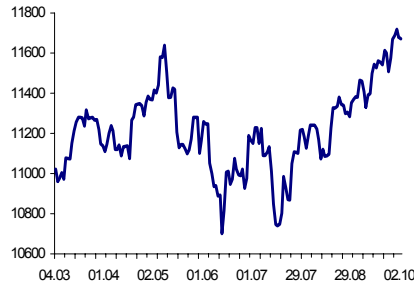
Утренний обзор рынка акций

3 октября 2006 г.

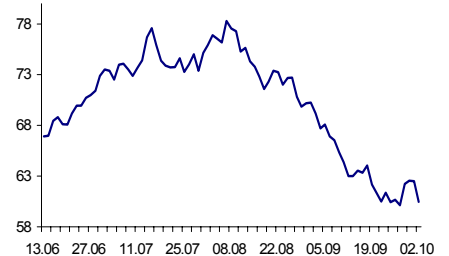
Индекс РТС



Индекс DOW



IPE Crude Future



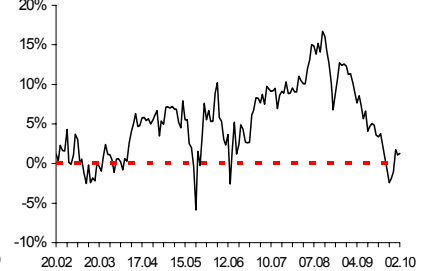
MSCI Emerging Markets



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
02.10	0,518%	0,376%	0,013%	1,129%

Индекс РТС в понедельник вырос на 0,53% до отметки 1557,23 пункта. После утреннего роста, индекс начал терять в значении, после того как в Европе начали преобладать ожидания роста процентных ставок, решение по которым будет оглашено в четверг.

Однако, по итогам торговой сессии значение индекса РТС на момент закрытия оказалось выше значения открытия.

Несмотря на заявление руководства Венесуэлы о сокращении объёмов добычи нефти, цена на «чёрное золото» не только не продолжила рост, но и упала до отметки 60,45 долларов за баррель, в течение дня показав темпы роста на уровне -3,25%.

Исходя из модели MSCI Russia, наибольшее влияние на российский фондовый рынок произвели развивающиеся рынки. Индекс MSCI Emerging Markets вырос на 0,38%, тогда как влияние неучтённых в модели факторов ограничилось 13%.

Архипов Андрей



Результаты работы механических торговых систем

3 октября 2006 г.

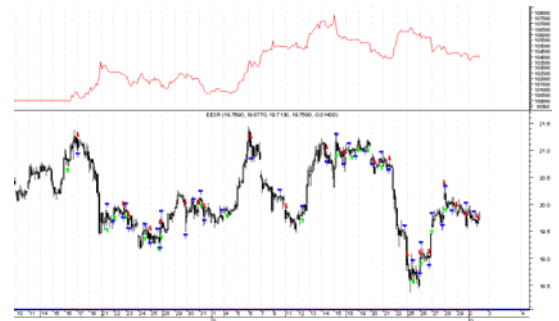
МТС «Сто хастиков». Акции РАО «ЕЭС».

позиции на 29.09 18:45 продажа 2000 шт.

сделки за 02.10

тип	цена исполнения	объём (акций)	время
продажа закрытие	19,72	2000	14:00
продажа открытие	19,67	2000	16:00

позиции на 02.10 18:45 продажа 2000 шт.



МТС «Прорыв». Акции РАО «ЕЭС».

позиции на 29.09 18:45 продажа 2000 шт.

сделки за 02.10

тип	цена исполнения	объём (акций)	время
продажа закрытие	19,91	2000	11:00

позиции на 02.10 18:45 нет позиций





Результаты работы механических торговых систем 3 октября 2006 г.

МТС «Отскок». Акции РАО «ЕЭС».

позиции на 29.09 18:45 продажа 2000 шт.

сделки за 02.10

тип	цена исполнения	объём (акций)	время
продажа закрытие	19,91	2000	11:00
покупка открытие	19,91	2000	11:00
покупка закрытие	19,80	2000	12:00
продажа открытие	19,80	2000	12:00
продажа закрытие	19,74	2000	13:00
покупка открытие	19,74	2000	13:00

позиции на 02.10 18:45 покупка 2000 шт.



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

позиции на 29.09 18:45 нет позиций .

сделки за 02.10

тип	цена исполнения	объём (акций)	время
нет сделок			

позиции на 02.10 18:45 нет позиций





Результаты работы механических торговых систем 3 октября 2006 г.

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

позиции на 29.09 18:45 продажа 2000 шт.

сделки за 02.10

тип	цена исполнения	объём (акций)	время
продажа открытие	19,84	2000	10:30
продажа закрытие	19,91	4000	11:00
продажа открытие	19,67	2000	16:00
продажа закрытие	19,65	2000	17:00

позиции на 02.10 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)