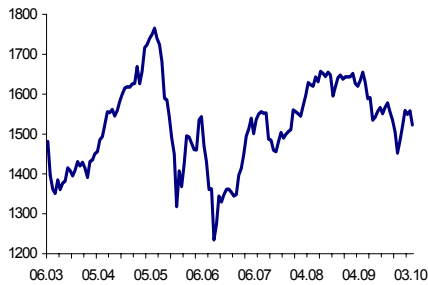




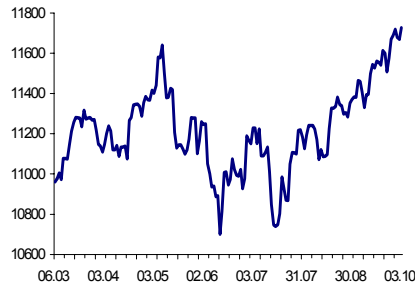
Утренний обзор рынка акций

4 октября 2006 г.

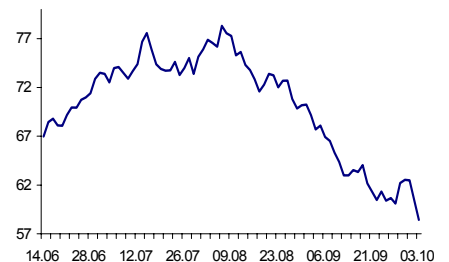
Индекс РТС



Индекс DOW



IPE Crude Future



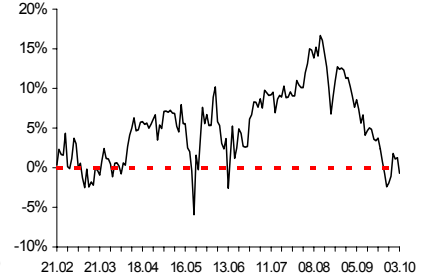
MSCI Emerging Markets



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 еврообондам	Вклад прочих событий
03.10	-2,574%	-0,683%	0,016%	-1,919%

Фактор, позитивно повлиявший на крупнейшую мировую экономику, негативно отразился на российском рынке.

В связи с тем, что эксперты прогнозируют увеличение запасов нефти в США, а значит и снижение спроса на

«чёрное золото» на мировых рынках, нефтяные фьючерсы с поставкой в ноябре упали ниже отметки 60 долларов за баррель и, к моменту окончания торгов на ICE, цена остановилась на уровне 58,43 доллара за баррель. Таким образом, дневные темпы роста составили -3,34%. Индекс DOW обновил 5-летний максимум и на момент закрытия составил 11727,34 пункта.

Индекс РТС продемонстрировал стабильное падение в течение всего торгового дня, потеряв в значении 2,21% и достигнув отметки 1522,75 пункта.

Развивающиеся рынки не проявили потенциала движения в какую-либо сторону, индекс MSCI Emerging Markets показал снижение на уровне -0,68%. Исходя из модели MSCI Russia видно, что на движение российского фондового рынка повлияли внешние факторы, а в данном случае это цена на нефть.

Архипов Андрей



Результаты работы механических торговых систем

4 октября 2006 г.

МТС «Сто хастиков». Акции РАО «ЕЭС».

позиции на 02.10 18:45 продажа 2000 шт.

сделки за 03.10

тип	цена исполнения	объём (акций)	время
продажа закрытие	19,59	2000	10:30
продажа открытие	19,55	2000	11:00

позиции на 03.10 18:45 продажа 2000 шт.



МТС «Прорыв». Акции РАО «ЕЭС».

позиции на 02.10 18:45 нет позиций

сделки за 03.10

тип	цена исполнения	объём (акций)	время
продажа открытие	19,52	2000	13:00
продажа закрытие	19,56	2000	15:00
продажа открытие	19,39	2000	18:00

позиции на 03.10 18:45 продажа 2000 шт.





Результаты работы механических торговых систем 4 октября 2006 г.

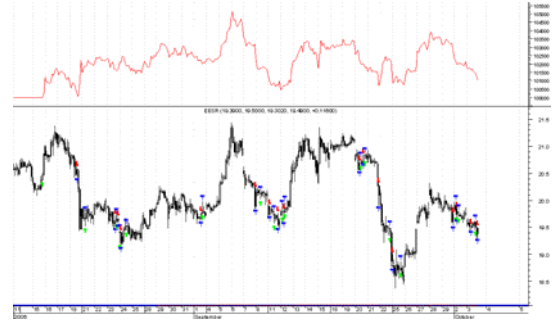
МТС «Отскок». Акции РАО «ЕЭС».

позиции на 02.10 18:45 покупка 2000 шт.

сделки за 03.10

тип	цена исполнения	объём (акций)	время
покупка закрытие	19,52	2000	13:00
продажа открытие	19,52	2000	13:00
продажа закрытие	19,60	2000	16:00
покупка открытие	19,60	2000	16:00
покупка закрытие	19,39	2000	18:00
продажа открытие	19,39	2000	18:00

позиции на 03.10 18:45 продажа 2000 шт.



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

позиции на 02.10 18:45 нет позиций .

сделки за 03.10

тип	цена исполнения	объём (акций)	время
нет сделок			

позиции на 03.10 18:45 нет позиций





Результаты работы механических торговых систем 4 октября 2006 г.

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

позиции на 02.10 18:45 нет позиций

сделки за 03.10

тип	цена исполнения	объём (акций)	время
продажа открытие	19,55	2000	11:00
продажа открытие	19,59	2000	12:00
продажа открытие	19,52	2000	13:00
продажа закрытие	19,56	6000	15:00
продажа открытие	19,51	2000	17:00
продажа открытие	19,39	2000	18:00

позиции на 03.10 18:45 продажа 2000 шт.



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)