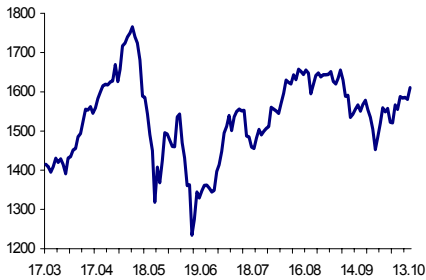




Утренний обзор рынка акций

16 октября 2006 г.

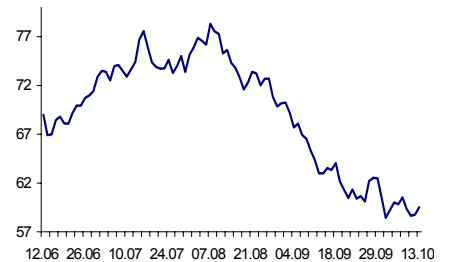
Индекс РТС



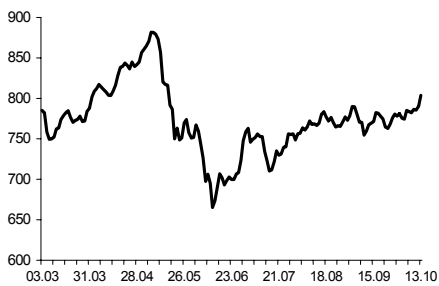
Индекс DOW



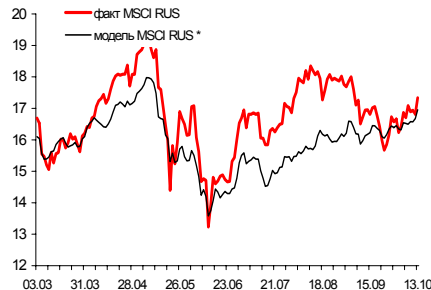
IPE Crude Future



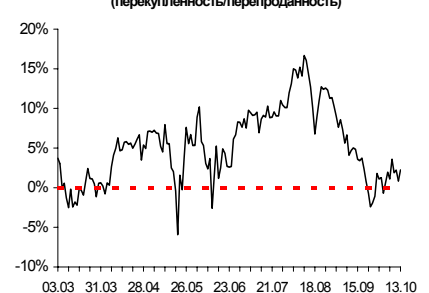
MSCI Emerging Markets



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
13.10	3,068%	1,666%	0,018%	1,361%

В пятницу индекс РТС отметился стабильным ростом в течение всей торговой сессии, показав темпы роста на уровне 1,82% до отметки 1610,44 пункта.

В течение прошедшей недели индекс мало изменялся, оставаясь на уровне 1585 пунктов. Основной рост

проходил в понедельник и пятницу, в последний день недели протолкнув индекс за уровень 1600 пунктов.

Сдерживающим фактором роста индекса была цена на нефть, которая в течение недели колебалась в диапазоне 58,5 – 60,5 доллара за баррель. Отсутствие ярко выраженной тенденции можно объяснить тем, что участники ОПЕК не могли прийти к консенсусу по поводу сокращения квот на добычу нефти.

Факторами, которые позволили российскому фондовому рынку развиваться оказались рост американской экономики и развивающихся рынков. Индекс DOW показал новый исторический максимум на уровне 11960,51 пункта, а индекс MSCI Emerging Markets впервые с мая этого года поднялся выше отметки 800 пунктов.

Для российского рынка потенциал к росту сохраняется, однако если члены ОПЕК не договорятся о снижении квот на добычу нефти, то возможен некоторый спад.

Архипов Андрей



Результаты работы механических торговых систем

16 октября 2006 г.

МТС «Сто хастиков». Акции РАО «ЕЭС».

позиции на 12.10 18:45 нет позиций

сделки за 13.10

тип	цена исполнения	объём (акций)	время
покупка открытие	20,25	2000	12:00
покупка закрытие	20,10	2000	17:00
продажа открытие	20,10	2000	17:00

позиции на 13.10 18:45 продажа 2000 шт.



МТС «Прорыв». Акции РАО «ЕЭС».

позиции на 12.10 18:45 нет позиций

сделки за 13.10

тип	цена исполнения	объём (акций)	время
нет сделок			

позиции на 13.10 18:45 нет позиций





Результаты работы механических торговых систем 16 октября 2006 г.

МТС «Отскок». Акции РАО «ЕЭС».

позиции на 12.10 18:45 покупка 2000 шт.

сделки за 13.10

тип	цена исполнения	объём (акций)	время
нет сделок			

позиции на 13.10 18:45 покупка 2000 шт.



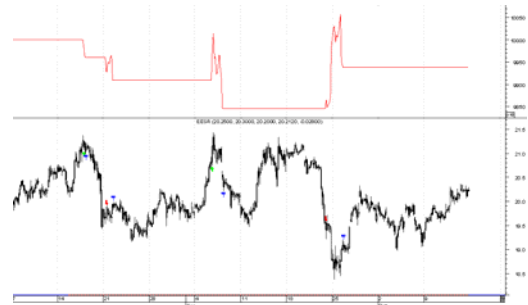
МТС «МакДи возвращается». Акции РАО «ЕЭС».

позиции на 12.10 18:45 нет позиций

сделки за 13.10

тип	цена исполнения	объём (акций)	время
нет сделок			

позиции на 13.10 18:45 нет позиций





Результаты работы механических торговых систем 16 октября 2006 г.

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

позиции на 12.10 18:45 нет позиций

сделки за 13.10

тип	цена исполнения	объём (акций)	время
покупка открытие	20,23	2000	11:00
покупка закрытие	20,25	2000	12:00

позиции на 13.10 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)