



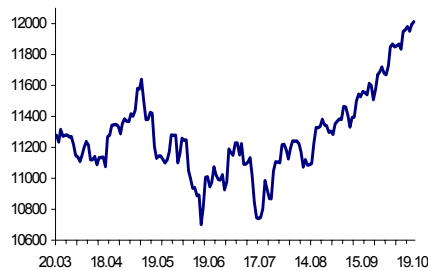
Утренний обзор рынка акций

20 октября 2006 г.

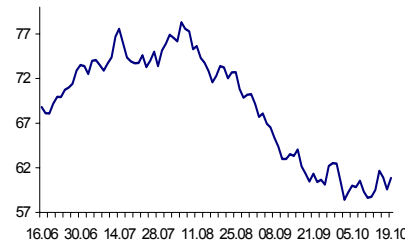
Индекс РТС



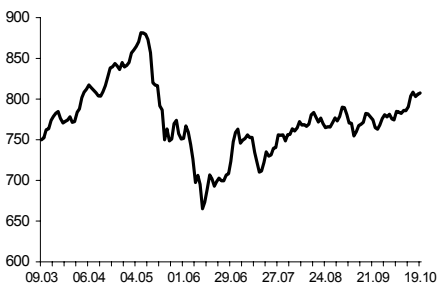
Индекс DOW



IPE Crude Future



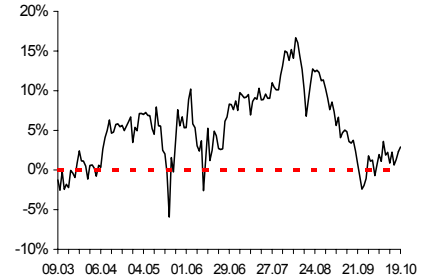
MSCI Emerging Markets



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
19.10	0,766%	0,183%	0,016%	0,566%

В четверг индекс РТС продолжил свой рост, за день показав темпы роста на уровне 0,78% и к моменту окончания торгов остановившись на отметке 1638,7 пункта.

Несмотря на утреннюю неготовность рынка брать новые высоты,

ближе к концу торгового дня ситуация нормализовалась и на хорошем новостном фоне индекс продемонстрировал рост.

Во-первых, свершилось то, чего с замиранием сердца ждали нефтяные трейдеры – состоялась встреча членов ОПЕК. Результат оказался значительно лучше прогнозов – ОПЕК сократил квоту на добычу нефти на 1,2 млн. баррелей в день, что на 0,2 млн. барреля оказалось выше ожидаемого. По итогам торгового дня цена на нефть выросла на 2,17% до уровня 60,87 доллара за баррель.

Во-вторых, американский фондовый рынок продолжает чувствовать себя достаточно хорошо, подтвердив это закреплением индекса DOW на уровне выше 12000 пунктов. В итоге, индекс DOW за день вырос на 0,16% и закрылся на отметке 12011,73 пункта.

Архипов Андрей



**Результаты работы
механических торговых систем**

20 октября 2006 г.

МТС «Сто хастиков». Акции РАО «ЕЭС».

позиции на 18.10 18:45 **покупка** **2000 шт.**

сделки за 19.10

тип	цена исполнения	объём (акций)	время
покупка закрытие	19,98	2000	14:00
продажа открытие	19,98	2000	14:00

позиции на 19.10 18:45 **продажа** **2000 шт.**



МТС «Прорыв». Акции РАО «ЕЭС».

позиции на 18.10 18:45 **нет позиций**

сделки за 19.10

тип	цена исполнения	объём (акций)	время
нет сделок			

позиции на 19.10 18:45 **нет позиций**





Результаты работы механических торговых систем 20 октября 2006 г.

МТС «Отскок». Акции РАО «ЕЭС».

позиции на 18.10 18:45 покупка 2000 шт.

сделки за 19.10

тип	цена исполнения	объём (акций)	время
нет сделок			

позиции на 19.10 18:45 покупка 2000 шт.



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

позиции на 18.10 18:45 нет позиций

сделки за 19.10

тип	цена исполнения	объём (акций)	время
нет сделок			

позиции на 19.10 18:45 нет позиций





Результаты работы механических торговых систем 20 октября 2006 г.

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

позиции на 18.10 18:45 нет позиций

сделки за 19.10

тип	цена исполнения	объём (акций)	время
нет сделок			

позиции на 19.10 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)