



Утренний обзор рынка акций

31 октября 2006 г.

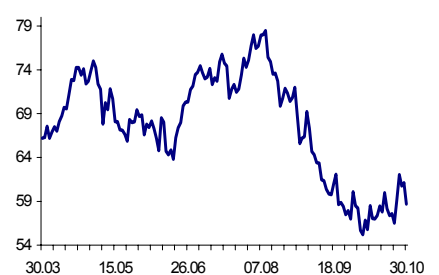
Индекс РТС



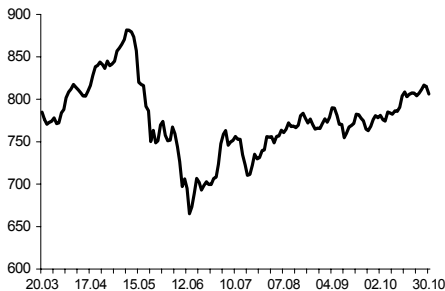
Индекс DOW



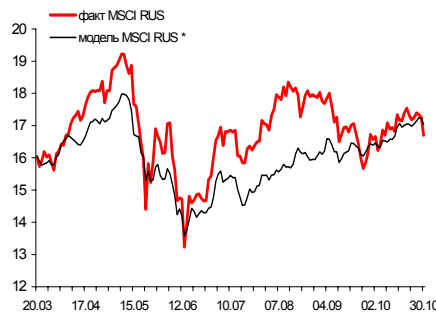
ICE Brent Oil Price



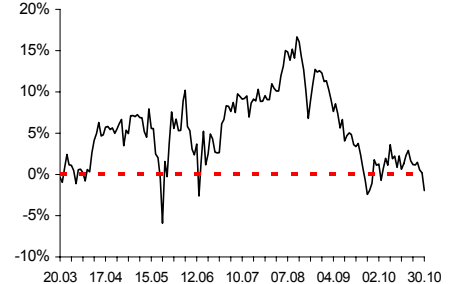
MSCI Emerging Markets



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
30.10	-3,174%	-1,064%	0,015%	-2,147%

Понедельник стал для российского фондового рынка тяжёлым днём. Индекс РТС падал в течение всего дня, показав в течение дня темпы роста $-2,27\%$, опустившись ниже отметки 1600 пунктов и к моменту завершения торгов достигнув отметки 1590,33 пункта.

Такое положение сложилось под влиянием падения развивающихся рынков, а также цен на нефть.

Индекс MSCI Emerging Markets снизился на 1,06%, показав таким образом самый сильный темп падения в течение прошедшего месяца и достигнув отметки 806,17 пункта. Цена на нефть упала на 3,93%, к моменту закрытия торгов на ICE остановившись на отметке 58,68 доллара за баррель. Такое резкое падение было обусловлено прогнозами метеорологов, которые ожидают тёплую зиму в США, что, соответственно, может привести к снижению спроса на нефть со стороны крупнейшего мирового импортёра нефти - США.

Индекс DOW в течение торговой сессии не продемонстрировал однозначного направления движения и по итогам дня снизился на 0,03% до уровня 12086,5 пункта.

Архипов Андрей



**Результаты работы
механических торговых систем**

31 октября 2006 г.

МТС «Сто хастиков». Акции РАО «ЕЭС».

позиции на 27.10 18:45 **покупка** 2000 шт.

сделки за 30.10

тип	цена исполнения	объём (акций)	время
покупка закрытие	20,04	2000	14:00
продажа открытие	20,04	2000	14:00

позиции на 30.10 18:45 **продажа** 2000 шт.



МТС «Прорыв». Акции РАО «ЕЭС».

позиции на 27.10 18:45 **покупка** 2000 шт.

сделки за 30.10

тип	цена исполнения	объём (акций)	время
покупка открытие	20,16	2000	13:00

позиции на 30.10 18:45 нет позиций





Результаты работы механических торговых систем 31 октября 2006 г.

МТС «Отскок». Акции РАО «ЕЭС».

позиции на 27.10 18:45 покупка 2000 шт.

сделки за 30.10

тип	цена исполнения	объём (акций)	время
нет сделок			

позиции на 30.10 18:45 покупка 2000 шт.



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

позиции на 27.10 18:45 нет позиций

сделки за 30.10

тип	цена исполнения	объём (акций)	время
нет сделок			

позиции на 30.10 18:45 нет позиций





Результаты работы механических торговых систем 31 октября 2006 г.

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

позиции на 27.10 18:45 **покупка** 4000 шт.

сделки за 30.10

тип	цена исполнения	объём (акций)	время
покупка закрытие	20,04	4000	14:00

позиции на 30.10 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)