



Утренний обзор рынка акций

16 ноября 2006 г.

Индекс РТС



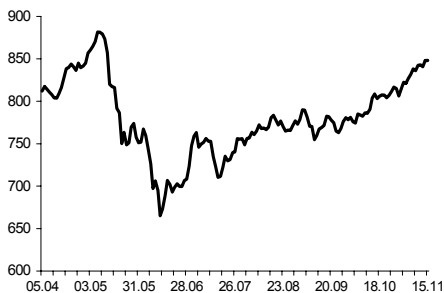
Индекс DOW



ICE Brent Oil Price



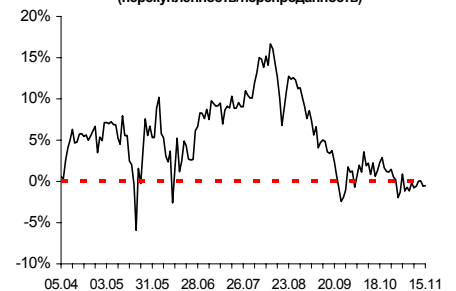
MSCI Emerging Markets



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 евробондам	Вклад прочих событий
15.11	0,126%	0,039%	0,016%	0,070%

Вчерашний день не принёс российскому рынку значительных перемен. Индекс РТС вырос на 0,36%, отыграв падение во вторник, и завершил торговую сессию на отметке 1705,84 пункта.

Утренний рывок не был поддержан и индекс начал новый виток роста только во второй половине дня после выхода статистических данных в США. Именно американский рынок, а также рост цен на нефть оказали значительное влияние на индекс во второй половине дня. По итогам дня индекс DOW вырос на 0,28%, продолжив трёхдневную серию повышений.

Цена на нефть в среду выросла на 3,01% до уровня 60,61 доллара за баррель. Причиной роста послужило сокращение запасов нефти в США.

Развивающиеся рынки росли медленно, но верно, неизбежно приближаясь к историческому максимуму 881,5 пункта. По итогам среды индекс MSCI Emerging Markets вырос на 0,04% до уровня 848,249 пункта.

Архипов Андрей



Результаты работы механических торговых систем

16 ноября 2006 г.

МТС «Сто хастиков». Акции РАО «ЕЭС».

позиции на 14.11 18:45 покупка 2000 шт.

сделки за 15.11

тип	цена исполнения	объём (акций)	время
покупка закрытие	22,70	2000	12:00
продажа открытие	22,50	2000	14:00

позиции на 15.11 18:45 продажа 2000 шт.



МТС «Прорыв». Акции РАО «ЕЭС».

позиции на 14.11 18:45 покупка 2000 шт.

сделки за 15.11

тип	цена исполнения	объём (акций)	время
покупка открытие	22,68	2000	10:30

позиции на 15.11 18:45 нет позиций





Результаты работы механических торговых систем 16 ноября 2006 г.

МТС «Отскок». Акции РАО «ЕЭС».

позиции на 14.10 18:45 покупка 2000 шт.

сделки за 15.11

тип	цена исполнения	объём (акций)	время
нет сделок			

позиции на 15.11 18:45 покупка 2000 шт.



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

позиции на 14.10 18:45 нет позиций

сделки за 15.11

тип	цена исполнения	объём (акций)	время
нет позиций			

позиции на 15.11 18:45 нет позиций





Результаты работы механических торговых систем 16 ноября 2006 г.

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

позиции на 14.10 18:45 покупка 4000 шт.

сделки за 15.11

тип	цена исполнения	объём (акций)	время
покупка закрытие	22,50	4000	14:00

позиции на 15.11 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)