



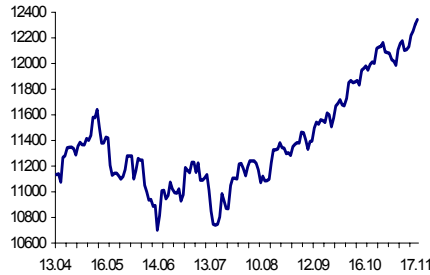
Утренний обзор рынка акций

20 ноября 2006 г.

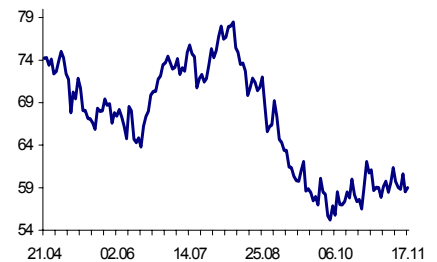
Индекс РТС



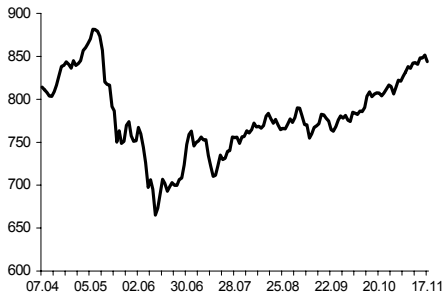
Индекс DOW



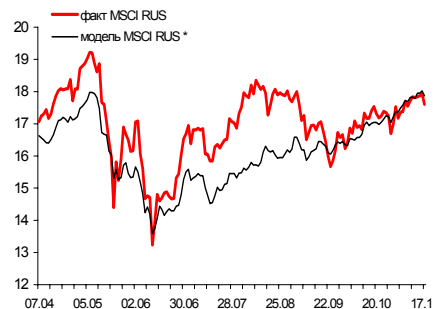
ICE Brent Oil Price



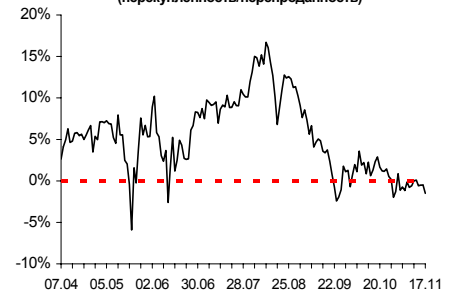
MSCI Emerging Markets



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
17.11	-1,824%	-0,870%	0,016%	-0,979%

В последний день прошедшей недели индекс РТС переживал сильное снижение. Темпы падения были максимальными за весь ноябрь. По итогам торгового дня, значение индекса опустилось на 1,43% и составило 1688,97 пункта. Таким образом, свелись на нет

все попытки индекса укрепиться выше уровня 1700 пунктов.

Основным фактором, негативно сказавшимся на российском рынке, оказалось падение цена на нефть в четверг. В пятницу цена на «чёрное золото» изменилась незначительно, завершив торговый день на уровне 58,99 пункта, в течение дня изменившись на 0,77%.

Негативное влияние на российский рынок оказали также развивающиеся рынки. В пятницу индекс MSCI Emerging Markets упал на 0,87% и составил 843,768 пункта.

Несмотря на обвал показателя по новым жилищным строительствам в США, индекс DOW на момент закрытия установил новый исторический максимум 12342,55 пункта, отреагировав положительно на снижение цен на нефть, а также корпоративные новости.

Архипов Андрей



Результаты работы механических торговых систем

20 ноября 2006 г.

МТС «Сто хастиков». Акции РАО «ЕЭС».

позиции на 16.11 18:45 **покупка** 2000 шт.

сделки за 17.11

тип	цена исполнения	объём (акций)	время
покупка закрытие	23,09	2000	14:00
продажа открытие	23,09	2000	14:00

позиции на 17.11 18:45 **продажа** 2000 шт.



МТС «Прорыв». Акции РАО «ЕЭС».

позиции на 16.11 18:45 нет позиций

сделки за 17.11

тип	цена исполнения	объём (акций)	время
покупка открытие	22,68	2000	10:30
покупка закрытие	23,16	2000	15:00

позиции на 17.11 18:45 нет позиций





Результаты работы механических торговых систем 20 ноября 2006 г.

МТС «Отскок». Акции РАО «ЕЭС».

позиции на 16.10 18:45 покупка 2000 шт.

сделки за 17.11

тип	цена исполнения	объём (акций)	время
нет сделок			

позиции на 17.11 18:45 покупка 2000 шт.



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

позиции на 16.10 18:45 нет позиций

сделки за 17.11

тип	цена исполнения	объём (акций)	время
покупка открытие	22,08	2000	10:30

позиции на 17.11 18:45 покупка 2000 шт.





Результаты работы механических торговых систем 20 ноября 2006 г.

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

позиции на 16.10 18:45 **покупка** 2000 шт.

сделки за 17.11

тип	цена исполнения	объём (акций)	время
покупка открытие	22,68	2000	10:30
покупка закрытие	22,95	4000	17:00

позиции на 17.11 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)