



Утренний обзор рынка акций

21 ноября 2006 г.

Индекс РТС



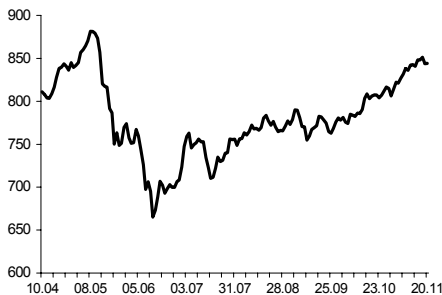
Индекс DOW



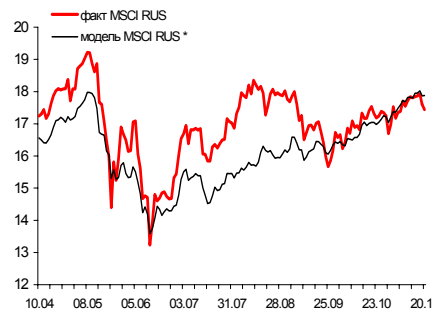
ICE Brent Oil Price



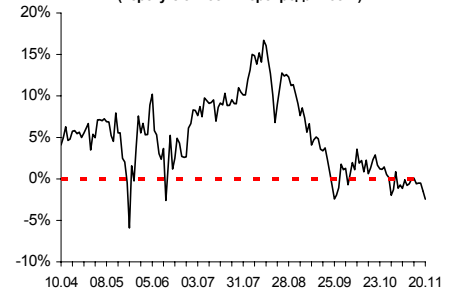
MSCI Emerging Markets



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
20.11	-0,925%	0,040%	0,013%	-0,978%

В понедельник 20 ноября индекс РТС переживал коррекцию. По итогам торгового дня, индекс опустился на 0,71% до уровня 1677 пунктов.

Неопределённая ситуация с ценами на нефть явно не играет российскому фондовому рынку на руку.

Несмотря на то, что в понедельник цены на нефть остались практически неизменными, игроки уже не воспринимают попытки ОПЕК, в рядах которого нет единства, вновь поднять цены на «чёрное золото» всерьёз. В лидерах негативного влияния на индекс РТС, которое было преобладающим, оказались компании нефтегазовой промышленности.

По итогам торгов на ICE, цены на нефтяные фьючерсы марки Brent ближайшей поставки остались на уровне 58,98 долларов за баррель, за день изменившись всего на -0,02%.

Американский фондовый рынок во второй половине торговой сессии также показал тенденцию к снижению, к моменту завершения торгов опустившись до отметки 12316,54 пункта, что на 0,21% ниже значения закрытия предыдущей сессии.

Архипов Андрей



Результаты работы механических торговых систем

21 ноября 2006 г.

МТС «Сто хастиков». Акции РАО «ЕЭС».

позиции на 17.11 18:45 покупка 2000 шт.

сделки за 20.11

тип	цена исполнения	объём (акций)	время
продажа закрытие	23,50	2000	11:00
покупка открытие	23,50	2000	11:00
покупка закрытие	23,46	2000	12:00
покупка открытие	23,68	2000	13:00
покупка закрытие	23,58	2000	15:00
продажа открытие	23,58	2000	15:00
продажа закрытие	23,60	2000	17:00
покупка открытие	23,98	2000	18:00



позиции на 20.11 18:45 покупка 2000 шт.

МТС «Прорыв». Акции РАО «ЕЭС».

позиции на 17.11 18:45 нет позиций

сделки за 20.11

тип	цена исполнения	объём (акций)	время
покупка открытие	23,50	2000	11:00
покупка закрытие	23,48	4000	15:00
покупка открытие	23,98	2000	18:00



позиции на 20.11 18:45 покупка 2000 шт.



Результаты работы механических торговых систем 21 ноября 2006 г.

МТС «Отскок». Акции РАО «ЕЭС».

позиции на 17.10 18:45 покупка 2000 шт.

сделки за 20.11

тип	цена исполнения	объём (акций)	время
нет сделок			

позиции на 20.11 18:45 покупка 2000 шт.



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

позиции на 17.10 18:45 покупка 2000 шт.

сделки за 20.11

тип	цена исполнения	объём (акций)	время
нет сделок			

позиции на 20.11 18:45 покупка 2000 шт.





Результаты работы механических торговых систем 21 ноября 2006 г.

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

позиции на 17.10 18:45 нет позиций

сделки за 20.11

тип	цена исполнения	объём (акций)	время
покупка открытие	23,50	2000	11:00
покупка открытие	23,46	2000	12:00
покупка закрытие	23,48	4000	15:00
покупка открытие	23,98	2000	18:00

позиции на 20.11 18:45 покупка 2000 шт.



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: **Ичкитидзе Юрий Роландович** (ichkitidze@reflexivity.ru)
Специалист по развитию: **Рыбин Александр Сергеевич** (rybin@reflexivity.ru)
Аналитик: **Архипов Андрей Анатольевич** (arhipov@reflexivity.ru)