



Утренний обзор рынка акций

23 ноября 2006 г.

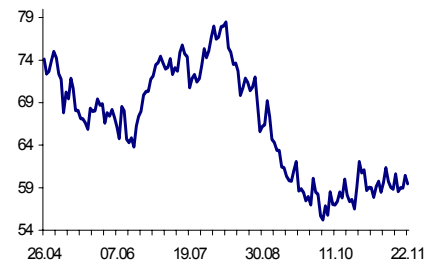
Индекс РТС



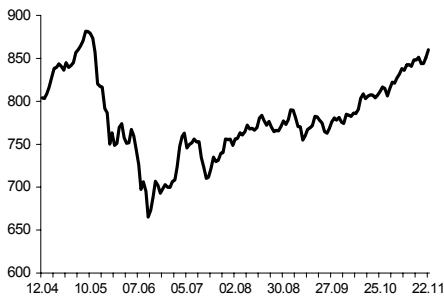
Индекс DOW



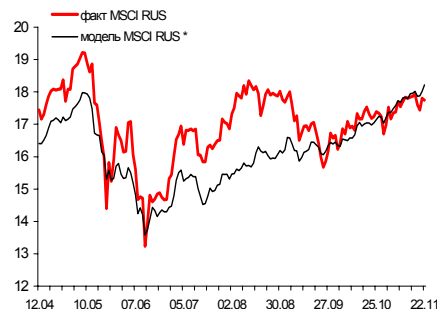
ICE Brent Oil Price



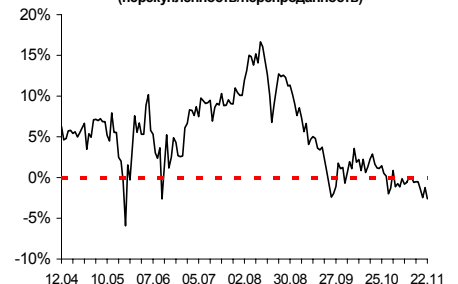
MSCI Emerging Markets



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
22.11	-0,305%	1,078%	0,016%	-1,384%

Торги в среду ничем особенным не отметились, разве что повышенной волатильностью. Таким образом, по итогам торгового дня индекс РТС вырос на 0,22% и остановился на отметке 1703,13 пункта.

Основное влияние на российский фондовый рынок произвели факторы, не учтённые в модели MSCI Russia. Тем не менее, говорить о каком-то одном факторе, который повлиял на рынок нельзя. Скорее, игроки временно действуют разнонаправленно и ещё не пришли к общему мнению по рынку.

Цена на нефть, как один из основных факторов движения российского фондового рынка, в течение торгов в среду продолжала оставаться в сформированном коридоре 58 – 61 доллар за баррель, снизившись на 1,49% до отметки 59,49 доллара за баррель.

Индекс MSCI Emerging Markets медленно, но верно приближается к своему историческому максимуму на уровне 881,519 пункта. В среду индекс показал максимальные за последний месяц темпы роста 1,08% и достиг уровня 859,935 пункта.

Архипов Андрей



Результаты работы механических торговых систем

23 ноября 2006 г.

МТС «Сто хастиков». Акции РАО «ЕЭС».

позиции на 21.11 18:45 продажа 2000 шт.

сделки за 22.11

тип	цена исполнения	объём (акций)	время
нет сделок			

позиции на 22.11 18:45 продажа 2000 шт.



МТС «Прорыв». Акции РАО «ЕЭС».

позиции на 21.11 18:45 нет позиций

сделки за 22.11

тип	цена исполнения	объём (акций)	время
нет сделок			

позиции на 22.11 18:45 нет позиций





Результаты работы механических торговых систем 23 ноября 2006 г.

МТС «Отскок». Акции РАО «ЕЭС».

позиции на 21.11 18:45 покупка 2000 шт.

сделки за 22.11

тип	цена исполнения	объём (акций)	время
нет сделок			

позиции на 22.11 18:45 покупка 2000 шт.



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

позиции на 21.10 18:45 покупка 2000 шт.

сделки за 22.11

тип	цена исполнения	объём (акций)	время
покупка закрытие	24,02	2000	11:00

позиции на 22.11 18:45 нет позиций





Результаты работы механических торговых систем 23 ноября 2006 г.

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

позиции на 21.11 18:45 нет позиций

сделки за 22.11

тип	цена исполнения	объём (акций)	время
продажа открытие	23,52	2000	14:00
продажа закрытие	23,65	2000	15:00

позиции на 22.11 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)