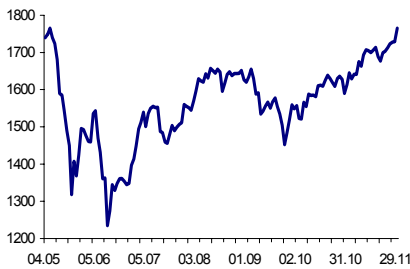




## Утренний обзор рынка акций

30 ноября 2006 г.

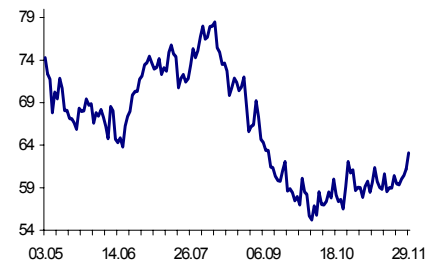
Индекс РТС



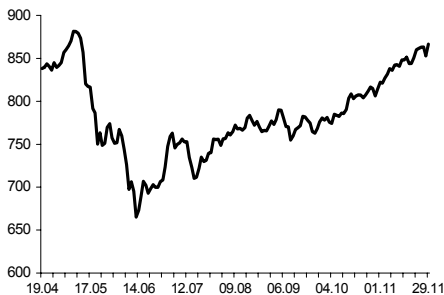
Индекс DOW



ICE Brent Oil Price



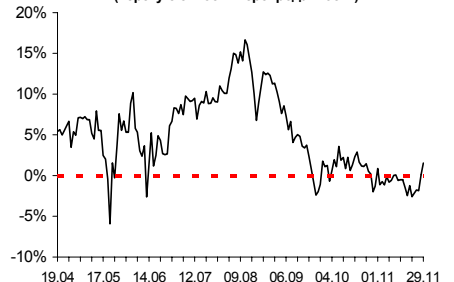
MSCI Emerging Markets



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 еврооблигациям | Вклад прочих событий |
|-------------|---------------|------------------------|--|----------------------|
| 28.11       | 3,027%        | 1,583%                 | 0,016%   | 1,406%               |

В среду мировые рынки продемонстрировали однозначный рост. Повышение значений индексов происходило как в Америке и Европе, так и в Азии.

Индекс РТС, ведомый «Газпромом» и «Лукойлом», вырос на

2,09% до уровня 1765,2 пункта, показав максимальные за последние полтора месяца темпы роста.

На российский рынок благоприятно повлиял рост цен на нефть, связанный как с намерением ОПЕК сократить квоты на добычу нефти, так и ожиданиями роста спроса со стороны США в связи с приближающимися холодами. По итогам торгов на ICE, цена на нефтяные фьючерсы ближайшей поставки выросла на 3,04% до уровня 63,07 доллара за баррель.

Несмотря на рост цен на нефть, индекс DOW вырос на 0,74% до отметки 12226,73 пункта. В центре внимания американских инвесторов оказались предварительные данные по ВВП США, рост которого оказался как выше прогноза, так и показателя за предыдущий период.

Архипов Андрей



**Результаты работы  
механических торговых систем**

**30 ноября 2006 г.**

**МТС «Сто хастиков». Акции РАО «ЕЭС».**

позиции на 28.11 18:45                      нет позиций

сделки за 29.11

| тип              | цена исполнения | объём (акций) | время |
|------------------|-----------------|---------------|-------|
| покупка открытие | 24,52           | 2000          | 10:30 |

позиции на 29.11 18:45                      покупка                      2000 шт.



**МТС «Прорыв». Акции РАО «ЕЭС».**

позиции на 28.11 18:45                      нет позиций

сделки за 29.11

| тип        | цена исполнения | объём (акций) | время |
|------------|-----------------|---------------|-------|
| нет сделок |                 |               |       |

позиции на 29.11 18:45                      нет позиций





## Результаты работы механических торговых систем 30 ноября 2006 г.

### МТС «Отскок». Акции РАО «ЕЭС».

позиции на 28.11 18:45 покупка 2000 шт.

сделки за 29.11

| тип        | цена исполнения | объём (акций) | время |
|------------|-----------------|---------------|-------|
| нет сделок |                 |               |       |

позиции на 29.11 18:45 покупка 2000 шт.



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

позиции на 28.10 18:45 нет позиций

сделки за 29.11

| тип        | цена исполнения | объём (акций) | время |
|------------|-----------------|---------------|-------|
| нет сделок |                 |               |       |

позиции на 29.11 18:45 нет позиций





## Результаты работы механических торговых систем 30 ноября 2006 г.

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

позиции на 28.11 18:45      продажа      4000 шт.

#### сделки за 29.11

| тип              | цена исполнения | объём (акций) | время |
|------------------|-----------------|---------------|-------|
| продажа закрытие | 24,52           | 4000          | 10:30 |
| покупка открытие | 24,56           | 2000          | 11:00 |
| покупка открытие | 24,54           | 2000          | 12:00 |
| покупка закрытие | 24,51           | 4000          | 13:00 |
| покупка открытие | 24,62           | 2000          | 17:00 |
| покупка закрытие | 24,55           | 2000          | 18:00 |

позиции на 29.11 18:45      нет позиций



[www.reflexivity.ru](http://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](mailto:ichkitidze@reflexivity.ru) )  
Специалист по развитию: **Рыбин Александр Сергеевич** ( [rybin@reflexivity.ru](mailto:rybin@reflexivity.ru) )  
Аналитик: **Архипов Андрей Анатольевич** ( [arhipov@reflexivity.ru](mailto:arhipov@reflexivity.ru) )