



## Утренний обзор рынка акций

4 декабря 2006 г.

Индекс РТС



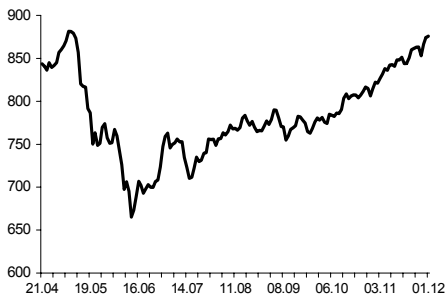
Индекс DOW



ICE Brent Oil Price



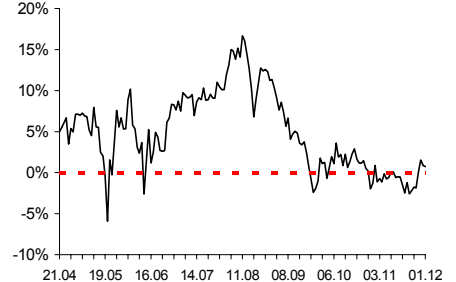
MSCI Emerging Markets



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
01.11	0,053%	0,186%	0,014%	-0,148%

В пятницу индекс РТС не достиг своего исторического максимума 0,67 пункта. Для этого было несколько причин. Во-первых, в конце недели многие трейдеры закрывают открытые позиции. Во-вторых, индекс практически достиг исторического максимума и началась фиксация прибыли. И наконец, в-третьих, вышедший в 18:00 МСК американский индекс ISM упал ниже 50 пунктов впервые за три года. Таким образом, многие участники решили не рисковать и зафиксировали прибыль.

По итогам торгового дня, индекс РТС вырос на 0,22% до отметки 1780,51 пункта, показав максимум на уровне 1794,43 пункта.

Цена на нефть в пятницу продолжила свой рост. На момент завершения торгов на ICE нефтяные фьючерсы торговались по цене 64,62 доллара за баррель. Американский индекс DOW снизился на 0,23% до отметки 12194,13 пунктов под давлением роста цен на нефть и низким значением индекса ISM.

В понедельник возможно начало коррекции российского рынка вплоть до уровня 1700 пунктов. По крайней мере, исторический максимум индекса РТС не будет преодолен сразу.

Архипов Андрей



**Результаты работы  
механических торговых систем**

**4 декабря 2006 г.**

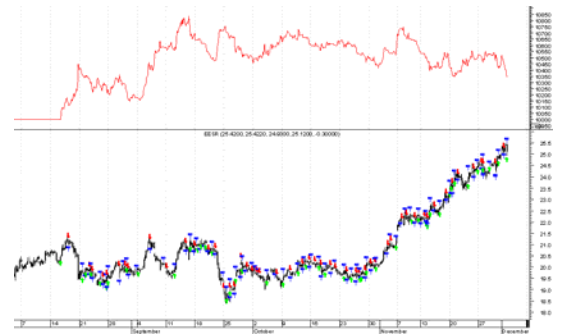
**МТС «Сто хастиков». Акции РАО «ЕЭС».**

**позиции на 30.11 18:45**      **покупка**      **2000 шт.**

**сделки за 01.11**

тип	цена исполнения	объём (акций)	время
покупка закрытие	25,07	2000	14:00
продажа открытие	25,07	2000	14:00
продажа закрытие	25,42	2000	18:00
покупка открытие	25,42	2000	18:00

**позиции на 01.11 18:45**      **покупка**      **2000 шт.**



**МТС «Прорыв». Акции РАО «ЕЭС».**

**позиции на 30.11 18:45**      **нет позиций**

**сделки за 01.11**

тип	цена исполнения	объём (акций)	время
покупка открытие	25,32	2000	11:00
покупка закрытие	25,24	2000	13:00
покупка открытие	25,40	2000	17:00

**позиции на 01.11 18:45**      **покупка**      **2000 шт.**





## Результаты работы механических торговых систем 4 декабря 2006 г.

### МТС «Отскок». Акции РАО «ЕЭС».

позиции на 30.11 18:45 покупка 2000 шт.

сделки за 01.11

тип	цена исполнения	объём (акций)	время
нет сделок			

позиции на 01.11 18:45 покупка 2000 шт.



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

позиции на 30.11 18:45 нет позиций

сделки за 01.11

тип	цена исполнения	объём (акций)	время
<span style="color: green;">покупка</span> открытие	25,42	2000	17:00

позиции на 01.11 18:45 покупка 2000 шт.





## Результаты работы механических торговых систем 4 декабря 2006 г.

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

позиции на 30.11 18:45      покупка      2000 шт.

#### сделки за 01.11

тип	цена исполнения	объём (акций)	время
покупка открытие	25,00	2000	10:30
покупка закрытие	25,07	4000	14:00
покупка открытие	25,32	4000	16:00
покупка открытие	25,04	2000	17:00

позиции на 01.11 18:45      покупка      2000 шт.



[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))