

POSIZIONE DEL TREND E LIVELLI SETTIMANALI

Change of Trend Automatic Model - genetic algorithm

LIVELLI DI CAMBIAMENTO DEL TREND

TREND settimanale	posizione al :	20.02.2011	validi per la settimana in corso		
		Ultima quotaz.	ENTRY LONG	EXIT POSITION	ENTRY SHORT
.Benchmark 50-50	LONG	103.56		103.27	102.35
a.ISH FTSE BRIC 50	NEUTRALE	23.36	23.93		22.99
a.ISH FTSE CHINA25	NEUTRALE	88.87	93.06		87.24
a.ISH FTSE100	LONG	7.22		7.16	6.87
a.ISH MSCI EAST EUROPE	NEUTRALE	25.79	27.05		25.73
a.ISH MSCI EM MKTS	SHORT	32.31	32.78	32.78	
a.ISH MSCI EUROPE EX UK	LONG	23.13		22.91	22.58
a.ISH MSCI FAR EAST	NEUTRALE	33.45	35.16		33.13
a.ISH MSCI JAPAN	NEUTRALE	8.50	8.67		8.31
a.ISH MSCI LATIN AM	NEUTRALE	21.32	21.57		20.78
a.ISH MSCI NORTH AM	LONG	21.29		21.17	20.33
a.ISH SP500	LONG	9.82		9.79	9.39
a.ISH STXX600	LONG	29.40		28.81	28.77
a.LYX DAX	LONG	72.67		70.69	69.46
a.LYX HONG KONG	NEUTRALE	22.17	23.21		21.79
a.LYX MSCI WORLD	LONG	100.40		99.67	95.91
a.LYX NSDQ100	LONG	7.04		7.02	6.71
a.LYX SP/MIB	LONG	23.22		22.71	21.88
aa.CAC 40	LONG	4157		4086	4047
aa.DAX	LONG	7427		7216	7106
aa.DJ EU STOXX50	LONG	3068		3003	2990
aa.DJ STOXX 600	LONG	291		288	285
aa.DOW JONES	LONG	12391		12193	11822
aa.FTSE 100 (UK)	LONG	6083		5997	5997
aa.FTSEMIB40	LONG	23059		22578	21764
aa.HONG KONG HS	NEUTRALE	23595	24748		22809
aa.NASDAQ	LONG	2834		2799	2722
aa.S&P 500	LONG	1343		1325	1283
aa.SMI	LONG	6717		6663	6576
aa.TOKYO TOPIX	LONG	974		954	909
b.JPM GBI EMU GLOBAL	SHORT	115.07	115.76	115.22	
b.LYX EMTS 01-03Y	NEUTRALE	116.95	117.21		116.58
b.LYX EMTS 03-05Y	SHORT	127.45	127.98	127.85	
b.LYX EMTS 05-07Y	SHORT	119.54	120.06	119.89	
b.LYX EMTS 07-10Y	SHORT	116.92	117.77	117.23	
b.LYX EMTS 10-15Y	SHORT	131.66	132.31	132.31	
b.LYX EMTS 15+Y	SHORT	119.22	121.58	119.78	
b.LYX EMTS GLOBAL	NEUTRALE	130.70	131.79		130.01
b.LYX EMTS INF LINK	LONG	117.54		116.30	116.00
b.LYX EU CORP BOND A	LONG	114.73		114.26	113.85
bb.EUR 02Y SCHATZ	NEUTRALE	108.13	108.27		107.95
bb.EUR 05Y BOBL	NEUTRALE	117.08	117.44		116.09
bb.EUR 10Y BUND	NEUTRALE	123.28	124.00		122.34
bb.US 02Y T-NOTE	SHORT	109.21	109.63	109.23	
bb.US 05Y T-NOTE	SHORT	116.91	118.42	117.05	
bb.US 10Y T-NOTE	SHORT	119.06	120.89	119.19	
c.ETF CRB	LONG	24.12		23.92	23.37
c.ETFS AGRIC	LONG	7.18		7.10	6.64
c.ETFS COPPER	LONG	36.73		36.20	34.49
c.ETFS CRUDE OIL	SHORT	19.20	19.90	19.90	
c.ETFS ENERGY	SHORT	8.44	9.07	8.76	
c.ETFS GRAINS	NEUTRALE	5.22	5.50		4.75
c.ETFS INDMETALS	LONG	15.86		15.54	14.44
c.ETFS NATURAL GAS	SHORT	0.21	0.24	0.23	
c.ETFS PH GOLD	NEUTRALE	100.17	101.06		95.88
c.ETFS PH PALLADIUM	LONG	61.30		59.59	57.58
c.ETFS PH PLATINUM	LONG	132.74		132.14	129.45
c.ETFS PH SILVER	LONG	23.37		22.05	18.56
c.ETFS SOFTS	LONG	8.04		7.79	7.41
cc.CRB CASH INDEX	LONG	341.78		335.23	324.80
cc.GOLD	LONG	1388.70		1356.38	1314.48
cc.LIGHT CRUDE	NEUTRALE	89.81	90.96		85.86
v.EUR/CHF	NEUTRALE	1.2949	1.3204		1.2787
v.EUR/JPY	LONG	113.81		111.76	111.76
v.EUR/USD	NEUTRALE	1.3698	1.3822		1.3334
v.USD/CHF	NEUTRALE	0.945	0.975		0.940
v.USD/JPY	LONG	83.07		82.21	82.17

POSIZIONE DEL TREND E LIVELLI MENSILI VALIDI FINO AL 28.02

Change of Trend Automatic Model - genetic algorithm

LIVELLI DI CAMBIAMENTO DEL TREND

TREND mensile		posizione al :		validi per il mese in corso		
		RRR	Ultima quotaz.	ENTRY LONG	EXIT POSITION	ENTRY SHORT
.Benchmark 50-50	LONG	0.3	103.56		101.22	100.20
a.ISH FTSE BRIC 50	EXIT - NEUTRALE	2.3	23.36			20.47
a.ISH FTSE CHINA25	ENTRY SHORT	-3.8	88.87			
a.ISH FTSE100	LONG	4.0	7.22		6.70	6.08
a.ISH MSCI EAST EUROPE	EXIT - NEUTRALE	0.2	25.79			21.12
a.ISH MSCI EM MKTS	NEUTRALE	1.8	32.31	35.40		27.98
a.ISH MSCI EUROPE EX UK	LONG	3.3	23.13		20.75	20.67
a.ISH MSCI FAR EAST	NEUTRALE	-0.3	33.45	36.82		29.47
a.ISH MSCI JAPAN	EXIT - NEUTRALE	2.5	8.50			6.96
a.ISH MSCI LATIN AM	ENTRY SHORT	-0.7	21.32			
a.ISH MSCI NORTH AM	LONG	5.0	21.29		19.77	17.81
a.ISH SP500	LONG	4.8	9.82		9.03	7.96
a.ISH STXX600	LONG	3.5	29.40		26.85	26.46
a.LYX DAX	LONG	3.0	72.67		66.06	61.86
a.LYX HONG KONG	EXIT - NEUTRALE	-2.2	22.17			20.01
a.LYX MSCI WORLD	LONG	5.0	100.40		95.47	84.30
a.LYX NSDQ100	EXIT - NEUTRALE	5.0	7.04			5.58
a.LYX SP/MB	LONG	5.0	23.22		20.38	19.28
aa.CAC 40	LONG	4.0	4157		3621	3581
aa.DAX	LONG	3.0	7427		6737	6324
aa.DJ EU STOXX50	LONG	4.0	3068		2757	2651
aa.DJ STOXX 600	LONG	3.5	291		264	258
aa.DOW JONES	LONG	2.8	12391		11574	10801
aa.FTSE 100 (UK)	LONG	4.2	6083		5528	5519
aa.FTSEMIB40	LONG	5.0	23059		20208	19106
aa.HONG KONG HS	EXIT - NEUTRALE	-2.8	23595			21504
aa.NASDAQ	LONG	3.5	2834		2664	2415
aa.S&P 500	LONG	3.5	1343		1258	1151
aa.SMI	LONG	5.5	6717		6335	6282
aa.TOKYO TOPIX	LONG	4.5	974		904	815
b.JPM GBI EMU GLOBAL	SHORT	-3.7	115.07	120.69	116.14	
b.LYX EMTS 01-03Y	NEUTRALE	-2.5	116.95	118.42		116.59
b.LYX EMTS 03-05Y	SHORT	-3.7	127.45	132.43	128.79	
b.LYX EMTS 05-07Y	SHORT	-4.3	119.54	125.44	120.83	
b.LYX EMTS 07-10Y	SHORT	-3.7	116.92	123.39	118.25	
b.LYX EMTS 10-15Y	EXIT - NEUTRALE	-4.3	131.66	140.83		
b.LYX EMTS 15+Y	SHORT	-3.5	119.22	133.38	123.05	
b.LYX EMTS GLOBAL	SHORT	-5.0	130.70	139.14	132.44	
b.LYX EMTS INF LINK	EXIT - NEUTRALE	-2.0	117.54	121.30		
b.LYX EU CORP BOND A	NEUTRALE	-3.5	114.73	119.22		112.20
bb.EUR 02Y SCHATZ	ENTRY SHORT	-4.5	108.13			
bb.EUR 05Y BOBL	SHORT	-3.7	117.08	122.07	119.82	
bb.EUR 10Y BUND	SHORT	-2.5	123.28	131.87	127.90	
bb.US 02Y T-NOTE	ENTRY SHORT	-6.0	109.21			
bb.US 05Y T-NOTE	SHORT	-6.0	116.91	122.76	119.14	
bb.US 10Y T-NOTE	SHORT	-5.8	119.06	128.02	122.48	
c.ETF CRB	LONG	2.5	24.12		22.85	19.12
c.ETF AGRIC	LONG	2.5	7.18		6.31	5.59
c.ETF COPPER	LONG	2.0	36.73		33.81	27.97
c.ETF CRUDE OIL	NEUTRALE	-1.5	19.20	21.60		17.35
c.ETF ENERGY	EXIT - NEUTRALE	-1.5	8.44			7.39
c.ETF GRAINS	LONG	2.3	5.22		4.58	4.12
c.ETF INDMETALS	ENTRY LONG	2.8	15.86			
c.ETF NATURAL GAS	ENTRY SHORT	-3.2	0.21			
c.ETF PH GOLD	NEUTRALE	1.2	100.17	105.42		92.63
c.ETF PH PALLADIUM	LONG	2.5	61.30		53.22	40.38
c.ETF PH PLATINUM	LONG	3.0	132.74		127.63	112.54
c.ETF PH SILVER	LONG	3.2	23.37		19.06	15.20
c.ETF SOFTS	LONG	2.5	8.04		6.87	5.26
cc.CRB CASH INDEX	LONG	1.2	341.78		301.41	282.72
cc.GOLD	NEUTRALE	1.2	1388.70	1431.14		1309.80
cc.LIGHT CRUDE	LONG	1.8	89.81		84.10	76.89
v.EUR/CHF	EXIT - NEUTRALE	-0.8	1.2949	1.3931		
v.EUR/JPY	NEUTRALE	2.5	113.81	116.10		106.83
v.EUR/USD	EXIT - NEUTRALE	-0.2	1.3698	1.4151		
v.USD/CHF	SHORT	-2.0	0.945	1.004	1.004	
v.USD/JPY	ENTRY LONG	0.5	83.07			

Legenda

Situazione relativa all'arco temporale in esame (trimestre)

LONG	Posizione al rialzo già in essere. I livelli EXIT e SHORT indicano i punti dove cambia il trend.
NEUTRALE	Posizione neutrale già in essere. I livelli LONG e SHORT indicano i punti dove il trend inizia.
SHORT	Posizione al ribasso già in essere. I livelli EXIT e LONG indicano i punti dove cambia il trend.
ENTRY LONG	Posizione al rialzo entrata nel periodo in corso.
EXIT - NEUTRALE	Posizione neutrale entrata nel periodo. I livelli LONG o SHORT indicano dove il trend si ribalta.
ENTRY SHORT	Posizione al ribasso entrata nel periodo in corso.

N.B. - Questo modello era stato originariamente creato per il trading automatizzato di breve su futures e valute. I livelli si intendono MIT (Market If Touched); il segnale di cambiamento del trend pertanto entra appena il livello è toccato nel periodo di riferimento (sett, mese, trim), senza alcuna necessità di altre conferme.