

POSIZIONE DEL TREND E LIVELLI SETTIMANALI

Change of Trend Automatic Model - genetic algorithm

LIVELLI DI CAMBIAMENTO DEL TREND

TREND settimanale	posizione al :	13/02/2011	validi per la settimana in corso		
		Ultima quotaz.	ENTRY LONG	EXIT POSITION	ENTRY SHORT
.Benchmark 50-50	LONG	103.09		102.50	102.35
a.ISH FTSE BRIC 50	SHORT	22.94	24.58	23.21	
a.ISH FTSE CHINA25	SHORT	87.56	95.56	88.29	
a.ISH FTSE100	NEUTRALE	7.13	7.20		6.84
a.ISH MSCI EAST EUROPE	NEUTRALE	26.26	27.25		25.55
a.ISH MSCI EM MKTS	SHORT	31.77	33.62	32.96	
a.ISH MSCI EUROPE EX UK	LONG	22.71		22.54	22.45
a.ISH MSCI FAR EAST	NEUTRALE	33.12	36.56		32.67
a.ISH MSCI JAPAN	NEUTRALE	8.36	8.71		8.08
a.ISH MSCI LATIN AM	SHORT	20.80	22.25	20.98	
a.ISH MSCI NORTH AM	LONG	21.11		20.44	20.38
a.ISH SP500	LONG	9.79		9.44	9.35
a.ISH STXX600	LONG	29.18		28.40	28.40
a.LYX DAX	LONG	72.26		70.69	68.52
a.LYX HONG KONG	NEUTRALE	21.95	24.33		21.38
a.LYX MSCI WORLD	LONG	99.45		96.35	95.50
a.LYX NSDQ100	NEUTRALE	7.00	7.01		6.74
a.LYX SP/MIB	LONG	22.89		22.19	21.80
aa.CAC 40	LONG	4095		4002	4002
aa.DAX	LONG	7340		7214	7028
aa.DJ EU STOXX50	LONG	3026		2954	2954
aa.DJ STOXX 600	LONG	287		280	280
aa.DOW JONES	LONG	12229		12092	11744
aa.FTSE 100 (UK)	NEUTRALE	6020	6091		5881
aa.FTSEMIB40	LONG	22695		22025	21661
aa.HONG KONG HS	NEUTRALE	22709	25154		22668
aa.NASDAQ	LONG	2790		2687	2687
aa.S&P 500	LONG	1322		1277	1276
aa.SMI	LONG	6612		6566	6528
aa.TOKYO TOPIX	LONG	947		920	919
b.JPM GBI EMU GLOBAL	SHORT	114.61	116.10	115.22	
b.LYX EMTS 01-03Y	NEUTRALE	116.90	117.32		116.72
b.LYX EMTS 03-05Y	NEUTRALE	127.34	128.81		127.19
b.LYX EMTS 05-07Y	SHORT	119.17	120.51	119.89	
b.LYX EMTS 07-10Y	SHORT	116.72	118.53	117.60	
b.LYX EMTS 10-15Y	SHORT	131.50	133.15	132.64	
b.LYX EMTS 15+Y	SHORT	118.34	122.55	119.82	
b.LYX EMTS GLOBAL	SHORT	130.52	132.28	131.11	
b.LYX EMTS INF LINK	NEUTRALE	116.32	117.72		115.96
b.LYX EU CORP BOND A	NEUTRALE	114.38	114.86		114.07
bb.EUR 02Y SCHATZ	SHORT	107.96	108.50	108.16	
bb.EUR 05Y BOBL	SHORT	116.40	117.53	116.90	
bb.EUR 10Y BUND	SHORT	122.33	124.20	123.75	
bb.US 02Y T-NOTE	SHORT	109.05	109.64	109.51	
bb.US 05Y T-NOTE	SHORT	116.30	118.55	118.08	
bb.US 10Y T-NOTE	SHORT	118.13	121.16	120.36	
c.ETF CRB	LONG	24.02		23.58	23.46
c.ETFS AGRIC	LONG	7.26		7.03	6.69
c.ETFS COPPER	LONG	37.20		36.14	35.15
c.ETFS CRUDE OIL	SHORT	19.33	20.93	19.95	
c.ETFS ENERGY	SHORT	8.57	9.78	8.76	
c.ETFS GRAINS	LONG	5.28		5.15	4.90
c.ETFS INDMETALS	NEUTRALE	15.77	16.12		14.67
c.ETFS NATURAL GAS	SHORT	0.21	0.27	0.23	
c.ETFS PH GOLD	NEUTRALE	99.23	101.23		95.94
c.ETFS PH PALLADIUM	NEUTRALE	59.24	61.52		58.56
c.ETFS PH PLATINUM	LONG	132.58		129.87	129.87
c.ETFS PH SILVER	LONG	21.79		21.07	19.81
c.ETFS SOFTS	NEUTRALE	7.97	8.18		7.05
cc.CRB CASH INDEX	NEUTRALE	339.95	342.06		331.71
cc.GOLD	NEUTRALE	1363.85	1381.33		1314.85
cc.LIGHT CRUDE	SHORT	87.56	92.71	89.54	
v.EUR/CHF	LONG	1.3179		1.2931	1.2795
v.EUR/JPY	LONG	113.33		111.24	109.86
v.EUR/USD	NEUTRALE	1.3594	1.3745		1.3308
v.USD/CHF	NEUTRALE	0.970	0.979		0.942
v.USD/JPY	NEUTRALE	83.36	83.38		81.47

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 :	13/02/2011	Ultima quotaz.	validi per il mese in corso		
		RRR		ENTRY LONG	EXIT POSITION	ENTRY SHORT
Benchmark 50-50	LONG	0.5	103.09		101.22	100.20
a.ISH FTSE BRIC 50	EXIT - NEUTRALE	1.7	22.94			20.47
a.ISH FTSE CHINA25	ENTRY SHORT	-3.5	87.56			
a.ISH FTSE100	LONG	2.0	7.13		6.70	6.08
a.ISH MSCI EAST EUROPE	EXIT - NEUTRALE	2.5	26.26			21.12
a.ISH MSCI EM MKTS	NEUTRALE	2.2	31.77	35.40		27.98
a.ISH MSCI EUROPE EX UK	LONG	2.7	22.71		20.75	20.67
a.ISH MSCI FAR EAST	NEUTRALE	2.5	33.12	36.82		29.47
a.ISH MSCI JAPAN	EXIT - NEUTRALE	2.5	8.36			6.96
a.ISH MSCI LATIN AM	ENTRY SHORT	-3.0	20.80			
a.ISH MSCI NORTH AM	LONG	3.3	21.11		19.77	17.81
a.ISH SP500	LONG	2.8	9.79		9.03	7.96
a.ISH STXX600	LONG	2.7	29.18		26.85	26.46
a.LYX DAX	LONG	3.2	72.26		66.06	61.86
a.LYX HONG KONG	EXIT - NEUTRALE	1.0	21.95			20.01
a.LYX MSCI WORLD	LONG	3.3	99.45		95.47	84.30
a.LYX NSDQ100	EXIT - NEUTRALE	2.8	7.00			5.58
a.LYX SP/MIB	LONG	5.0	22.89		20.38	19.28
aa.CAC 40	LONG	3.8	4095		3621	3581
aa.DAX	LONG	3.2	7340		6737	6324
aa.DJ EU STOXX50	LONG	3.8	3026		2757	2651
aa.DJ STOXX 600	LONG	2.7	287		264	258
aa.DOW JONES	LONG	2.3	12229		11574	10801
aa.FTSE 100 (UK)	LONG	3.2	6020		5528	5519
aa.FTSEMIB40	LONG	5.0	22695		20208	19106
aa.HONG KONG HS	EXIT - NEUTRALE	0.7	22709			21504
aa.NASDAQ	LONG	2.7	2790		2664	2415
aa.S&P 500	LONG	2.8	1322		1258	1151
aa.SMI	LONG	3.0	6612		6335	6282
aa.TOKYO TOPIX	LONG	4.7	947		904	815
b.JPM GBI EMU GLOBAL	SHORT	-2.8	114.61	120.69	116.14	
b.LYX EMTS 01-03Y	NEUTRALE	-1.5	116.90	118.42		116.59
b.LYX EMTS 03-05Y	SHORT	-3.7	127.34	132.43	128.79	
b.LYX EMTS 05-07Y	SHORT	-4.0	119.17	125.44	120.83	
b.LYX EMTS 07-10Y	SHORT	-1.3	116.72	123.39	118.25	
b.LYX EMTS 10-15Y	EXIT - NEUTRALE	-3.0	131.50	140.83		
b.LYX EMTS 15+Y	SHORT	-2.2	118.34	133.38	123.05	
b.LYX EMTS GLOBAL	SHORT	-4.8	130.52	139.14	132.44	
b.LYX EMTS INF LINK	EXIT - NEUTRALE	-0.3	116.32	121.30		
b.LYX EU CORP BOND A	NEUTRALE	-3.7	114.38	119.22		112.20
bb.EUR 02Y SCHATZ	ENTRY SHORT	-4.5	107.96			
bb.EUR 05Y BOBL	SHORT	-4.5	116.40	122.07	119.82	
bb.EUR 10Y BUND	SHORT	-3.2	122.33	131.87	127.90	
bb.US 02Y T-NOTE	ENTRY SHORT	-3.3	109.05			
bb.US 05Y T-NOTE	SHORT	-2.8	116.30	122.76	119.14	
bb.US 10Y T-NOTE	SHORT	-4.0	118.13	128.02	122.48	
c.ETF CRB	LONG	1.5	24.02		22.85	19.12
c.ETFS AGRIC	LONG	2.5	7.26		6.31	5.59
c.ETFS COPPER	LONG	2.7	37.20		33.81	27.97
c.ETFS CRUDE OIL	NEUTRALE	0.0	19.33	21.60		17.35
c.ETFS ENERGY	EXIT - NEUTRALE	1.2	8.57			7.39
c.ETFS GRAINS	LONG	2.3	5.28		4.58	4.12
c.ETFS INDMETALS	NEUTRALE	2.7	15.77	16.20		11.88
c.ETFS NATURAL GAS	NEUTRALE	-1.5	0.21	0.26		0.21
c.ETFS PH GOLD	NEUTRALE	-0.7	99.23	105.42		92.63
c.ETFS PH PALLADIUM	LONG	2.0	59.24		53.22	40.38
c.ETFS PH PLATINUM	LONG	3.7	132.58		127.63	112.54
c.ETFS PH SILVER	LONG	0.0	21.79		19.06	15.20
c.ETFS SOFTS	LONG	2.8	7.97		6.87	5.26
cc.CRB CASH INDEX	LONG	1.5	339.95		301.41	282.72
cc.GOLD	NEUTRALE	-0.7	1363.85	1431.14		1309.80
cc.LIGHT CRUDE	LONG	1.3	87.56		84.10	76.89
v.EUR/CHF	EXIT - NEUTRALE	0.2	1.3179	1.3931		
v.EUR/JPY	NEUTRALE	1.5	113.33	116.10		106.83
v.EUR/USD	EXIT - NEUTRALE	1.3	1.3594	1.4151		
v.USD/CHF	EXIT - NEUTRALE	-1.5	0.970	1.004		
v.USD/JPY	NEUTRALE	-3.0	83.36	83.68		80.68
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.					
RRR	Il Reward/Risk Rating (RRR) VA DA +6 A -6 ED esprime il mix fra TREND e QUADRO TECNICO di MT					

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.