

POSIZIONE DEL TREND E LIVELLI **SETTIMANALI** VALIDI PER LA SETTIMANA 15/11 – 19/11

Change of Trend Automatic Model - genetic algorithm

TREND settimanale - posizione al 13/11/2010		LIVELLI DI CAMBIAMENTO DEL TREND validi fino alla fine della settimana in corso			
	Ultima quotaz.	ENTRY LONG	EXIT (NEUTRAL)	ENTRY SHORT	
00-S&P FUT	LONG	1195.40		1188.01	1153.40
01-MSCI WORLD	LONG	874.87		866.01	852.69
02-MSCI EUROPE	LONG	1159.76		1154.25	1147.33
03-MSCI USA	LONG	1158.37		1147.70	1117.45
04-MSCI EMERG	LONG	47926.08		47678.07	46128.44
05-DJ STOXX 600	LONG	270.18		266.40	260.52
06-DJ EU STOXX50	LONG	2822.43		2824.28	2765.65
07-DAX	LONG	6734.61		6601.37	6431.05
08-CAC 40	NEUTRALE	3831.12	3961.70		3764.47
09-FTSE 100 (UK)	NEUTRALE	5796.87	5902.11		5643.15
10-FTSEMIB40	SHORT	20829.83	22494.52	21183.37	
11-SMI	NEUTRALE	6505.29	6615.43		6379.45
12-DOW JONES	NEUTRALE	11192.58	11439.61		10905.85
13-S&P 500	LONG	1199.21		1191.84	1156.43
14-NASDAQ	NEUTRALE	2518.21	2592.94		2395.60
15-TOKYO TOPIX	LONG	846.98		810.91	810.91
16-HONG KONG HS	LONG	24222.58		23963.18	23096.32
17-CRB CASH INDEX	NEUTRALE	303.60	320.38		282.86
18-LIGHT CRUDE	LONG	84.73		82.94	79.17
19-GOLD	LONG	1367.20		1368.61	1302.15
20-EUR SCHATZ 2Y	NEUTRALE	108.85	109.10		108.75
21-EUR BOBL 5Y	NEUTRALE	119.92	120.93		119.31
22-EUR BUND 10Y	SHORT	129.17	130.95	130.87	
23-T-NOTE 2Y	SHORT	109.64	110.29	109.83	
24-T-NOTE 5Y	SHORT	121.02	122.45	122.06	
25-T-NOTE 10Y	SHORT	125.94	127.83	127.52	
26-EUR/USD	SHORT	1.3687	1.4074	1.4039	
27-EUR/JPY	NEUTRALE	112.95	114.19		110.30
28-EUR/CHF	SHORT	1.3431	1.3730	1.3702	
29-USD/JPY	LONG	82.49		81.07	79.82
30-USD/CHF	LONG	0.9804		0.9587	0.9577

Legenda

Situazione relativa all'arco temporale in esame (settimana)

LONG	Posizione al rialzo. I livelli NEUTRAL e SHORT indicano i punti dove cambia il trend.
NEUTRALE	Posizione neutrale. I livelli LONG e SHORT indicano i punti dove il trend diventa direzionale.
SHORT	Posizione al ribasso. I livelli NEUTRAL e LONG indicano i punti dove cambia il trend.

POSIZIONE DEL TREND E LIVELLI **MENSILI** VALIDI FINO AL 30 NOVEMBRE - AGGIORNAMENTO

Change of Trend Automatic Model - genetic algorithm

		TREND mensile - posizione al : 13/11/2010	LIVELLI DI CAMBIAMENTO DEL TREND validi fino alla fine del mese in corso		
		Ultima quotaz.	ENTRY LONG	EXIT (NEUTRAL)	ENTRY SHORT
00-S&P FUT	LONG	1195.40		1050.90	1048.30
01-MSCI WORLD	LONG	874.87		828.11	779.26
02-MSCI EUROPE	LONG	1159.76		1107.78	1048.28
03-MSCI USA	LONG	1158.37		1083.41	998.28
04-MSCI EMERG	LONG	47926.08		45913.47	42136.41
05-DJ STOXX 600	LONG	270.18		251.31	248.00
06-DJ EU STOXX50	LONG	2822.43		2622.95	2578.81
07-DAX	LONG	6734.61		6153.21	5653.97
08-CAC 40	LONG	3831.12		3490.79	3464.06
09-FTSE 100 (UK)	LONG	5796.87		5225.22	5164.69
10-FTSEMIB40	LONG	20829.83		19734.57	19268.39
11-SMI	ENTRY LONG	6505.29			
12-DOW JONES	LONG	11192.58		10016.01	10014.72
13-S&P 500	LONG	1199.21		1049.72	1049.33
14-NASDAQ	LONG	2518.21		2141.95	2114.03
15-TOKYO TOPIX	EXIT - NEUTRALE	846.98	871.46		
16-HONG KONG HS	LONG	24222.58		22504.05	19836.73
17-CRB CASH INDEX	LONG	303.60		283.53	255.97
18-LIGHT CRUDE	LONG	84.73		79.70	71.80
19-GOLD	LONG	1367.20		1306.55	1162.34
20-EUR SCHATZ 2Y	SHORT	108.85	109.81	109.81	
21-EUR BOBL 5Y	NEUTRALE	119.92	122.67		118.08
22-EUR BUND 10Y	NEUTRALE	129.17	134.49		124.13
23-T-NOTE 2Y	EXIT - NEUTRALE	109.64			109.45
24-T-NOTE 5Y	LONG	121.02		120.32	119.08
25-T-NOTE 10Y	LONG	125.94		125.20	121.24
26-EUR/USD	LONG	1.3687		1.2690	1.2569
27-EUR/JPY	LONG	112.95		106.53	106.53
28-EUR/CHF	ENTRY LONG	1.3431			
29-USD/JPY	SHORT	82.49	89.61	83.99	
30-USD/CHF	SHORT	0.9804	1.0828	1.0143	

Legenda

Situazione relativa all'arco temporale in esame (mese)

LONG	Posizione al rialzo già in essere. I livelli NEUTRAL 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 diventa direzionale.
SHORT	Posizione al ribasso già in essere. I livelli NEUTRAL 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 in corso. Il livello LONG o SHORT indica 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 sulle 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.

POSIZIONE DEL TREND E LIVELLI **TRIMESTRALI** VALIDI FINO AL 31 DICEMBRE – AGGIORNAMENTO

Change of Trend Automatic Model - genetic algorithm

LIVELLI DI CAMBIAMENTO DEL TREND

TREND trimestrale - posizione al : 13/11/2010

validi per il trimestre in corso

		Ultima quotaz.	ENTRYLONG	EXIT POSITION	ENTRYSHORT
00-S&P FUT	ENTRY LONG	1195.40			
01-MSCI WORLD	ENTRY LONG	874.87			
02-MSCI EUROPE	ENTRY LONG	1159.76			
03-MSCI USA	ENTRY LONG	1158.37			
04-MSCI EMERG	LONG	47926.08		40516.32	39531.07
05-DJ STOXX 600	ENTRY LONG	270.18			
06-DJ EU STOXX50	NEUTRALE	2822.43	3095.15		2502.50
07-DAX	LONG	6734.61		5809.37	5449.09
08-CAC 40	NEUTRALE	3831.12	3974.01		3321.35
09-FTSE 100 (UK)	ENTRY LONG	5796.87			
10-FTSEMIB40	NEUTRALE	20829.83	24982.61		18807.18
11-SMI	NEUTRALE	6505.29	6873.37		5912.26
12-DOW JONES	ENTRY LONG	11192.58			
13-S&P 500	ENTRY LONG	1199.21			
14-NASDAQ	ENTRY LONG	2518.21			
15-TOKYO TOPIX	SHORT	846.98	978.81	978.81	
16-HONG KONG HS	ENTRY LONG	24222.58			
17-CRB CASH INDEX	LONG	303.60		253.48	248.53
18-LIGHT CRUDE	ENTRY LONG	84.73			
19-GOLD	LONG	1367.20		1113.35	1002.10
20-EUR SCHATZ 2Y	EXIT - NEUTRALE	108.85			107.59
21-EUR BOBL 5Y	LONG	119.92		117.60	113.72
22-EUR BUND 10Y	EXIT - NEUTRALE	129.17			116.66
23-T-NOTE 2Y	LONG	109.64		108.48	108.48
24-T-NOTE 5Y	LONG	121.02		117.93	113.89
25-T-NOTE 10Y	LONG	125.94		121.59	113.63
26-EUR/USD	NEUTRALE	1.3687	1.6025		1.2194
27-EUR/JPY	SHORT	112.95	136.14	124.314	
28-EUR/CHF	SHORT	1.3431	1.5972	1.4032	
29-USD/JPY	SHORT	82.49	93.46	89.155	
30-USD/CHF	NEUTRALE	0.9804	1.0789		0.9213

Legenda

Situazione relativa all'arco temporale in esame (trimestre)

LONG	Posizione al rialzo già in essere. I livelli NEUTRAL 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 diventa direzionale.
SHORT	Posizione al ribasso già in essere. I livelli NEUTRAL 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 in corso. Il livello LONG o SHORT indica il punto dove il trend si ribalta.
ENTRY SHORT	Posizione al ribasso entrata nel periodo in corso.