

POSIZIONE DEL TREND E LIVELLI **SETTIMANALI** VALIDI PER LA SETTIMANA 01/11 – 05/11

Change of Trend Automatic Model - genetic algorithm

TREND settimanale - posizione al 01/11/2010		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	1179.70		1138.80
01-MSCI WORLD	LONG	855.30		840.69
02-MSCI EUROPE	NEUTRALE	1150.80	1162.38	1118.91
03-MSCI USA	LONG	1128.92		1107.21
04-MSCI EMERG	LONG	46685.41		45661.87
05-DJ STOXX 600	LONG	265.96		259.86
06-DJ EU STOXX50	LONG	2844.99		2743.14
07-DAX	LONG	6601.37		6206.50
08-CAC 40	LONG	3833.50		3712.60
09-FTSE 100 (UK)	NEUTRALE	5675.16	5794.31	5590.67
10-FTSEMIB40	LONG	21450.61		20388.33
11-SMI	LONG	6472.23		6311.59
12-DOW JONES	LONG	11118.49		10805.39
13-S&P 500	LONG	1183.26		1143.29
14-NASDAQ	LONG	2507.41		2359.29
15-TOKYO TOPIX	SHORT	810.91	844.73	826.44
16-HONG KONG HS	NEUTRALE	23096.32	23781.88	22534.39
17-CRB CASH INDEX	LONG	300.67		290.63
18-LIGHT CRUDE	NEUTRALE	81.45	84.46	80.52
19-GOLD	NEUTRALE	1359.20	1368.40	1318.80
20-EUR SCHATZ 2Y	SHORT	108.86	109.24	109.08
21-EUR BOBL 5Y	SHORT	119.71	121.01	120.63
22-EUR BUND 10Y	SHORT	129.43	132.60	129.99
23-T-NOTE 2Y	NEUTRALE	109.93	110.01	109.81
24-T-NOTE 5Y	NEUTRALE	121.30	122.27	120.75
25-T-NOTE 10Y	SHORT	126.28	128.03	126.48
26-EUR/USD	LONG	1.3947		1.3652
27-EUR/JPY	SHORT	112.04	115.98	113.86
28-EUR/CHF	LONG	1.3699		1.3287
29-USD/JPY	NEUTRALE	80.37	83.38	80.33
30-USD/CHF	NEUTRALE	0.9820	0.9930	0.9553

Legenda

Situazione relativa all'arco temporale in esame (settimana)

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

Change of Trend Automatic Model - genetic algorithm

		TREND mensile - posizione al : 01/11/2010	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	1179.70		1050.90	1048.30
01-MSCI WORLD	LONG	855.30		828.11	779.26
02-MSCI EUROPE	LONG	1150.80		1107.78	1048.28
03-MSCI USA	LONG	1128.92		1083.41	998.28
04-MSCI EMERG	LONG	46685.41		45913.47	42136.41
05-DJ STOXX 600	LONG	265.96		251.31	248.00
06-DJ EU STOXX50	LONG	2844.99		2622.95	2578.81
07-DAX	LONG	6601.37		6153.21	5653.97
08-CAC 40	LONG	3833.50		3490.79	3464.06
09-FTSE 100 (UK)	LONG	5675.16		5225.22	5164.69
10-FTSEMIB40	LONG	21450.61		19734.57	19268.39
11-SMI	NEUTRALE	6472.23	6537.35		6055.70
12-DOW JONES	LONG	11118.49		10016.01	10014.72
13-S&P 500	LONG	1183.26		1049.72	1049.33
14-NASDAQ	LONG	2507.41		2141.95	2114.03
15-TOKYO TOPIX	SHORT	810.91	871.46	850.13	
16-HONG KONG HS	LONG	23096.32		22504.05	19836.73
17-CRB CASH INDEX	LONG	300.67		283.53	255.97
18-LIGHT CRUDE	LONG	81.45		79.70	71.80
19-GOLD	LONG	1359.20		1306.55	1162.34
20-EUR SCHATZ 2Y	SHORT	108.86	109.81	109.81	
21-EUR BOBL 5Y	NEUTRALE	119.71	122.67		118.08
22-EUR BUND 10Y	NEUTRALE	129.43	134.49		124.13
23-T-NOTE 2Y	LONG	109.93		109.70	109.45
24-T-NOTE 5Y	LONG	121.30		120.32	119.08
25-T-NOTE 10Y	LONG	126.28		125.20	121.24
26-EUR/USD	LONG	1.3947		1.2690	1.2569
27-EUR/JPY	LONG	112.04		106.53	106.53
28-EUR/CHF	NEUTRALE	1.3699	1.3738		1.2872
29-USD/JPY	SHORT	80.37	89.62	83.99	
30-USD/CHF	SHORT	0.9820	1.0828	1.0143	

Legenda

Situazione relativa all'arco temporale in esame (mese)

<b>LONG</b>	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.
<b>SHORT</b>	Posizione al ribasso già in essere. I livelli NEUTRAL e LONG indicano i punti dove cambia il trend.
<b>ENTRY LONG</b>	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.
<b>ENTRY SHORT</b>	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.