

POSIZIONE DEL TREND E LIVELLI **SETTIMANALI** VALIDI PER LA SETTIMANA 08/11 – 12/11

Change of Trend Automatic Model - genetic algorithm

TREND settimanale - posizione al 08/11/2010			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	1221.90		1188.01	1130.60
01-MSCI WORLD	LONG	879.84		866.01	829.78
02-MSCI EUROPE	LONG	1171.78		1154.25	1131.82
03-MSCI USA	LONG	1168.86		1147.70	1083.41
04-MSCI EMERG	LONG	48329.87		47678.07	45662.27
05-DJ STOXX 600	LONG	271.97		266.40	261.00
06-DJ EU STOXX50	NEUTRALE	2875.94	2896.52		2787.72
07-DAX	LONG	6754.20		6596.01	6323.62
08-CAC 40	LONG	3916.73		3812.37	3720.09
09-FTSE 100 (UK)	LONG	5875.35		5719.49	5585.74
10-FTSEMIB40	LONG	21194.74		21108.94	20784.21
11-SMI	LONG	6587.72		6475.30	6335.19
12-DOW JONES	LONG	11444.08		11149.08	10766.03
13-S&P 500	LONG	1225.85		1191.84	1134.95
14-NASDAQ	LONG	2578.98		2509.69	2378.05
15-TOKYO TOPIX	NEUTRALE	834.98	844.73		799.64
16-HONG KONG HS	LONG	24876.82		23963.18	22643.66
17-CRB CASH INDEX	LONG	313.56		305.13	290.03
18-LIGHT CRUDE	LONG	87.40		82.94	78.72
19-GOLD	LONG	1393.45		1343.44	1311.50
20-EUR SCHATZ 2Y	SHORT	108.97	109.30	109.05	
21-EUR BOBL 5Y	NEUTRALE	120.45	121.31		119.56
22-EUR BUND 10Y	NEUTRALE	130.30	131.81		129.16
23-T-NOTE 2Y	NEUTRALE	109.94	110.06		109.92
24-T-NOTE 5Y	LONG	121.94		121.39	121.01
25-T-NOTE 10Y	NEUTRALE	127.42	127.94		126.08
26-EUR/USD	LONG	1.4033		1.3899	1.3709
27-EUR/JPY	NEUTRALE	114.17	115.43		111.49
28-EUR/CHF	LONG	1.3489		1.3438	1.3285
29-USD/JPY	SHORT	81.28	82.11	81.58	
30-USD/CHF	LONG	0.9614		0.9584	0.9462

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

Change of Trend Automatic Model - genetic algorithm

TREND mensile - posizione al : 08/11/2010			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	1221.90		1050.90	1048.30
01-MSCI WORLD	LONG	879.84		828.11	779.26
02-MSCI EUROPE	LONG	1171.78		1107.78	1048.28
03-MSCI USA	LONG	1168.86		1083.41	998.28
04-MSCI EMERG	LONG	48329.87		45913.47	42136.41
05-DJ STOXX 600	LONG	271.97		251.31	248.00
06-DJ EU STOXX50	LONG	2875.94		2622.95	2578.81
07-DAX	LONG	6754.20		6153.21	5653.97
08-CAC 40	LONG	3916.73		3490.79	3464.06
09-FTSE 100 (UK)	LONG	5875.35		5225.22	5164.69
10-FTSEMIB40	LONG	21194.74		19734.57	19268.39
11-SMI	ENTRY LONG	6587.72			
12-DOW JONES	LONG	11444.08		10016.01	10014.72
13-S&P 500	LONG	1225.85		1049.72	1049.33
14-NASDAQ	LONG	2578.98		2141.95	2114.03
15-TOKYO TOPIX	SHORT	834.98	871.46	850.13	
16-HONG KONG HS	LONG	24876.82		22504.05	19836.73
17-CRB CASH INDEX	LONG	313.56		283.53	255.97
18-LIGHT CRUDE	LONG	87.40		79.70	71.80
19-GOLD	LONG	1393.45		1306.55	1162.34
20-EUR SCHATZ 2Y	SHORT	108.97	109.81	109.81	
21-EUR BOBL 5Y	NEUTRALE	120.45	122.67		118.08
22-EUR BUND 10Y	NEUTRALE	130.30	134.49		124.13
23-T-NOTE 2Y	LONG	109.94		109.70	109.45
24-T-NOTE 5Y	LONG	121.94		120.32	119.08
25-T-NOTE 10Y	LONG	127.42		125.20	121.24
26-EUR/USD	LONG	1.4033		1.2690	1.2569
27-EUR/JPY	LONG	114.17		106.53	106.53
28-EUR/CHF	ENTRY LONG	1.3489			
29-USD/JPY	SHORT	81.28	89.61	83.99	
30-USD/CHF	SHORT	0.9614	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.