

POSIZIONE DEL TREND E LIVELLI **SETTIMANALI** VALIDI PER LA SETTIMANA 11/10 – 15/10

Change of Trend Automatic Model - genetic algorithm			LIVELLI DI CAMBIAMENTO DEL TREND		
TREND settimanale - p 11/10/2010			validi fino alla fine della settimana in corso		
		Ultima quotaz.	ENTRY LONG	EXIT (NEUTRAL)	ENTRY SHORT
00-S&P FUT	LONG	1160.60		1127.00	1095.70
01-MSCI WORLD	LONG	846.58		834.04	809.74
02-MSCI EUROPE	LONG	1132.98		1117.14	1105.45
03-MSCI USA	LONG	1109.80		1090.86	1043.67
04-MSCI EMERG	LONG	46330.73		46140.17	44315.38
05-DJ STOXX 600	SHORT	262.27	269.61	263.97	
06-DJ EU STOXX50	SHORT	2785.43	2876.02	2805.30	
07-DAX	SHORT	6291.67	6449.44	6321.79	
08-CAC 40	SHORT	3763.18	3873.33	3799.71	
09-FTSE 100 (UK)	LONG	5657.61		5550.57	5508.91
10-FTSEMIB40	SHORT	20750.74	21360.91	20813.47	
11-SMI	NEUTRALE	6363.16	6559.36		6228.33
12-DOW JONES	LONG	11006.48		10711.12	10329.11
13-S&P 500	LONG	1165.15		1131.87	1095.61
14-NASDAQ	LONG	2401.91		2332.46	2259.81
15-TOKYO TOPIX	SHORT	839.44	866.50	850.13	
16-HONG KONG HS	LONG	22944.18		22605.81	21399.15
17-CRB CASH INDEX	LONG	295.11		286.97	268.97
18-LIGHT CRUDE	LONG	82.84		76.96	73.16
19-GOLD	LONG	1346.85		1324.20	1229.63
20-EUR SCHATZ 2Y	SHORT	109.19	109.31	109.28	
21-EUR BOBL 5Y	LONG	120.97		120.51	119.98
22-EUR BUND 10Y	NEUTRALE	131.61	132.17		129.72
23-T-NOTE 2Y	LONG	109.91		109.80	109.33
24-T-NOTE 5Y	LONG	121.66		120.95	119.28
25-T-NOTE 10Y	LONG	127.31		126.41	123.34
26-EUR/USD	LONG	1.3946		1.3639	1.2768
27-EUR/JPY	LONG	114.21		113.67	110.96
28-EUR/CHF	LONG	1.3427		1.3263	1.3064
29-USD/JPY	SHORT	81.93	86.38	83.63	
30-USD/CHF	SHORT	0.9628	1.0169	0.9791	

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 31 OTTOBRE

Change of Trend Automatic Model - genetic algorithm			LIVELLI DI CAMBIAMENTO DEL TREND		
TREND mensile - posi: 11/10/2010			validi fino alla fine del mese in corso		
		Ultima quotaz.	ENTRY LONG	EXIT (NEUTRAL)	ENTRY SHORT
00-S&P FUT	LONG	1160.60		1050.90	1035.50
01-MSCI WORLD	ENTRY LONG	846.58			
02-MSCI EUROPE	LONG	1132.98		1087.64	1084.72
03-MSCI USA	ENTRY LONG	1109.80			
04-MSCI EMERG	LONG	46330.73		43215.84	40140.93
05-DJ STOXX 600	LONG	262.27		250.88	244.68
06-DJ EU STOXX50	NEUTRALE	2785.43	2827.44		2549.74
07-DAX	LONG	6291.67		5876.43	5743.10
08-CAC 40	LONG	3763.18		3478.85	3396.74
09-FTSE 100 (UK)	LONG	5657.61		5225.22	5094.81
10-FTSEMIB40	NEUTRALE	20837.71	21142.49		19033.38
11-SMI	NEUTRALE	6363.16	6537.73		6196.64
12-DOW JONES	LONG	11006.48		10016.01	9791.64
13-S&P 500	LONG	1165.15		1049.72	1030.93
14-NASDAQ	LONG	2401.91		2141.95	2093.61
15-TOKYO TOPIX	SHORT	839.44	893.99	858.77	
16-HONG KONG HS	LONG	22944.18		20529.87	19047.77
17-CRB CASH INDEX	LONG	295.11		265.28	244.89
18-LIGHT CRUDE	ENTRY LONG	82.84			
19-GOLD	LONG	1346.85		1236.45	1181.05
20-EUR SCHATZ 2Y	ENTRY SHORT	109.19			
21-EUR BOBL 5Y	NEUTRALE	120.97	122.71		118.45
22-EUR BUND 10Y	NEUTRALE	131.61	134.37		124.13
23-T-NOTE 2Y	ENTRY LONG	109.91			
24-T-NOTE 5Y	ENTRY LONG	121.66			
25-T-NOTE 10Y	ENTRY LONG	127.31			
26-EUR/USD	LONG	1.3946		1.2641	1.1424
27-EUR/JPY	ENTRY LONG	114.21			
28-EUR/CHF	SHORT	1.3427	1.3810	1.3582	
29-USD/JPY	SHORT	81.93	91.35	86.47	
30-USD/CHF	SHORT	0.9628	1.1324	1.0280	

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 il punto 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.