

POSIZIONE DEL TREND E LIVELLI **SETTIMANALI** VALIDI PER LA SETTIMANA 13/12 – 17/12

Change of Trend Automatic Model - genetic algorithm			LIVELLI DI CAMBIAMENTO DEL TREND		
TREND settimanale	posizione al :	14/12/2010	validi fino alla fine della settimana in corso		
		Ultima quotaz.	ENTRY LONG	EXIT (NEUTRAL)	ENTRY SHORT
00-S&P FUT	LONG	1236.20		1186.56	1183.20
01-MSCI WORLD	LONG	892.43		861.81	857.93
02-MSCI EUROPE	NEUTRALE	1175.24	1187.38		1137.52
03-MSCI USA	LONG	1183.87		1143.60	1129.16
04-MSCI EMERG	NEUTRALE	47606.61	47722.12		46366.86
05-DJ STOXX 600	ENTRY LONG	276.99			
06-DJ EU STOXX50	NEUTRALE	2855.37	2936.79		2736.96
07-DAX	LONG	7029.39		6848.98	6737.99
08-CAC 40	NEUTRALE	3892.44	3937.03		3723.16
09-FTSE 100 (UK)	NEUTRALE	5860.75	5924.72		5668.70
10-FTSEMIB40	NEUTRALE	20708.58	21678.72		19833.65
11-SMI	SHORT	6519.08	6712.27	6565.22	
12-DOW JONES	LONG	11428.56		11092.00	11082.65
13-S&P 500	LONG	1240.46		1189.40	1183.39
14-NASDAQ	LONG	2624.91		2534.56	2493.81
15-TOKYO TOPIX	LONG	897.40		866.81	860.93
16-HONG KONG HS	NEUTRALE	23317.61	24002.28		22877.25
17-CRB CASH INDEX	LONG	319.87		304.13	295.39
18-LIGHT CRUDE	LONG	88.72		84.45	81.47
19-GOLD	LONG	1394.05		1362.92	1316.60
20-EUR SCHATZ 2Y	SHORT	108.64	109.48	109.02	
21-EUR BOBL 5Y	SHORT	118.11	120.75	119.15	
22-EUR BUND 10Y	SHORT	124.98	129.78	126.35	
23-T-NOTE 2Y	ENTRY SHORT	109.32			
24-T-NOTE 5Y	SHORT	117.88	122.16	119.05	
25-T-NOTE 10Y	SHORT	120.66	126.80	122.60	
26-EUR/USD	EXIT - NEUTRALE	1.3387	1.3880		
27-EUR/JPY	NEUTRALE	111.73	115.64		109.57
28-EUR/CHF	SHORT	1.2964	1.3554	1.3284	
29-USD/JPY	ENTRY LONG	83.47			
30-USD/CHF	ENTRY SHORT	0.9685			

Legenda

Situazione relativa all'arco temporale in esame (settimana)

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.

POSIZIONE DEL TREND E LIVELLI **MENSILI** VALIDI FINO AL 31 DICEMBRE - AGGIORNAMENTO

Change of Trend Automatic Model - genetic algorithm			LIVELLI DI CAMBIAMENTO DEL TREND		
TREND mensile	posizione al :	14/12/2010	validi fino alla fine del mese in corso		
		Ultima quotaz	ENTRY LONG	EXIT (NEUTRAL)	ENTRY SHORT
00-S&P FUT	LONG	1236.20		1136.70	1074.00
01-MSCI WORLD	LONG	892.43		850.44	797.24
02-MSCI EUROPE	LONG	1175.24		1108.73	1050.79
03-MSCI USA	LONG	1183.87		1124.51	1028.15
04-MSCI EMERG	LONG	47606.61		46347.19	41569.19
05-DJ STOXX 600	LONG	276.99		259.72	250.40
06-DJ EU STOXX50	LONG	2855.37		2635.08	2626.80
07-DAX	LONG	7029.39		6229.02	6018.37
08-CAC 40	LONG	3892.44		3591.78	3433.02
09-FTSE 100 (UK)	LONG	5860.75		5519.19	5035.66
10-FTSEMIB40	SHORT	20708.58	22100.95	21258.98	
11-SMI	LONG	6519.08		6296.33	6078.76
12-DOW JONES	LONG	11428.56		10788.05	10197.69
13-S&P 500	LONG	1240.46		1141.20	1075.16
14-NASDAQ	LONG	2624.91		2368.62	2183.68
15-TOKYO TOPIX	LONG	897.40		813.46	774.22
16-HONG KONG HS	EXIT - NEUTRALE	23317.61			19600.35
17-CRB CASH INDEX	LONG	319.87		298.12	254.26
18-LIGHT CRUDE	LONG	88.72		80.28	71.83
19-GOLD	LONG	1394.05		1307.65	1150.60
20-EUR SCHATZ 2Y	EXIT - NEUTRALE	108.64	109.75		
21-EUR BOBL 5Y	ENTRY SHORT	118.11			
22-EUR BUND 10Y	ENTRY SHORT	124.98			
23-T-NOTE 2Y	ENTRY SHORT	109.32			
24-T-NOTE 5Y	ENTRY SHORT	117.88			
25-T-NOTE 10Y	ENTRY SHORT	120.66			
26-EUR/USD	LONG	1.3387		1.2969	1.2796
27-EUR/JPY	LONG	111.73		108.35	108.35
28-EUR/CHF	ENTRY SHORT	1.2964			
29-USD/JPY	NEUTRALE	83.47	87.24		80.34
30-USD/CHF	EXIT - NEUTRALE	0.9685	1.0602		

Legenda	Situazione relativa all'arco temporale in esame (mese)
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.

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 **solo** appena il livello è toccato nel periodo di riferimento (sett, mese, trim), **senza alcuna necessità di altre conferme**. Per i mercati che hanno solo chiusura giornaliera (es.: indici MSCI) il livello da considerare è ovviamente la chiusura giornaliera stessa.