

POSIZIONE DEL TREND E LIVELLI **SETTIMANALI** VALIDI PER LA SETTIMANA 18/10 – 22/10

Change of Trend Automatic Model - genetic algorithm			LIVELLI DI CAMBIAMENTO DEL TREND		
TREND settimanale - posizione al : 18/10/2010			validi fino alla fine della settimana in corso		
		Ultima quotaz	ENTRY LONG	EXIT (NEUTRAL)	ENTRY SHORT
00-S&P FUT	LONG	1174.90		1142.30	1115.50
01-MSCI WORLD	LONG	854.02		834.04	829.34
02-MSCI EUROPE	LONG	1149.55		1133.24	1104.34
03-MSCI USA	LONG	1118.15		1092.17	1080.94
04-MSCI EMERG	LONG	47076.96		46523.50	44245.32
05-DJ STOXX 600	NEUTRALE	265.83	267.96		257.38
06-DJ EU STOXX50	NEUTRALE	2841.65	2859.96		2723.50
07-DAX	LONG	6492.30		6288.63	6108.75
08-CAC 40	NEUTRALE	3827.37	3845.36		3689.17
09-FTSE 100 (UK)	LONG	5703.37		5592.90	5462.26
10-FTSEMIB40	NEUTRALE	21062.18	21255.69		20349.80
11-SMI	NEUTRALE	6443.01	6486.03		6274.73
12-DOW JONES	LONG	11062.78		10829.68	10624.39
13-S&P 500	LONG	1176.19		1146.24	1120.23
14-NASDAQ	LONG	2468.77		2391.73	2305.49
15-TOKYO TOPIX	SHORT	826.38	863.14	844.85	
16-HONG KONG HS	LONG	23757.63		23264.46	21397.88
17-CRB CASH INDEX	LONG	296.06		294.91	277.05
18-LIGHT CRUDE	LONG	82.12		81.41	73.38
19-GOLD	LONG	1368.40		1344.31	1252.84
20-EUR SCHATZ 2Y	NEUTRALE	109.09	109.34		109.06
21-EUR BOBL 5Y	LONG	120.63		120.52	120.13
22-EUR BUND 10Y	LONG	130.50		130.80	130.34
23-T-NOTE 2Y	LONG	109.86		109.80	109.54
24-T-NOTE 5Y	LONG	121.33		120.95	120.17
25-T-NOTE 10Y	NEUTRALE	126.23	127.58		124.84
26-EUR/USD	LONG	1.3975		1.3775	1.3111
27-EUR/JPY	NEUTRALE	113.86	114.79		111.76
28-EUR/CHF	LONG	1.3395		1.3266	1.3067
29-USD/JPY	SHORT	81.47	85.59	83.22	
30-USD/CHF	SHORT	0.9584	1.0045	0.9738	
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 - posizione al : 18/10/2010			validi fino alla fine del mese in corso		
		Ultima quotaz.	ENTRY LONG	EXIT (NEUTRAL)	ENTRY SHORT
00-S&P FUT	LONG	1174.90		1050.90	1035.50
01-MSCI WORLD	ENTRY LONG	854.02			
02-MSCI EUROPE	LONG	1149.55		1087.64	1084.72
03-MSCI USA	ENTRY LONG	1118.15			
04-MSCI EMERG	LONG	47076.96		43215.84	40140.93
05-DJ STOXX 600	LONG	265.83		250.88	244.68
06-DJ EU STOXX50	ENTRY LONG	2841.65			
07-DAX	LONG	6492.30		5876.43	5743.10
08-CAC 40	LONG	3827.37		3478.85	3396.74
09-FTSE 100 (UK)	LONG	5703.37		5225.22	5094.81
10-FTSEMIB40	ENTRY LONG	21062.18			
11-SMI	NEUTRALE	6443.01	6537.73		6196.64
12-DOW JONES	LONG	11062.78		10016.01	9791.64
13-S&P 500	LONG	1176.19		1049.72	1030.93
14-NASDAQ	LONG	2468.77		2141.95	2093.61
15-TOKYO TOPIX	SHORT	826.38	893.99	858.77	
16-HONG KONG HS	LONG	23757.63		20529.87	19047.77
17-CRB CASH INDEX	LONG	296.06		265.28	244.89
18-LIGHT CRUDE	ENTRY LONG	82.12			
19-GOLD	LONG	1368.40		1236.45	1181.05
20-EUR SCHATZ 2Y	ENTRY SHORT	109.09			
21-EUR BOBL 5Y	NEUTRALE	120.63	122.71		118.45
22-EUR BUND 10Y	NEUTRALE	130.50	134.37		124.13
23-T-NOTE 2Y	ENTRY LONG	109.86			
24-T-NOTE 5Y	ENTRY LONG	121.33			
25-T-NOTE 10Y	ENTRY LONG	126.23			
26-EUR/USD	LONG	1.3975		1.2641	1.1424
27-EUR/JPY	ENTRY LONG	113.86			
28-EUR/CHF	SHORT	1.3395	1.3810	1.3582	
29-USD/JPY	SHORT	81.47	91.35	86.47	
30-USD/CHF	SHORT	0.9584	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 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.