

POSIZIONE DEL TREND E LIVELLI **SETTIMANALI** VALIDI PER LA SETTIMANA 20/12 – 24/12

Change of Trend Automatic Model - genetic algorithm			LIVELLI DI CAMBIAMENTO DEL TREND		
TREND settimanale	posizione al :	19/12/2010	validi fino alla fine della settimana in corso		
		Ultima quotaz.	ENTRY LONG	EXIT (NEUTRAL)	ENTRY SHORT
00-S&P FUT	LONG	1232.90		1186.56	1183.20
01-MSCI WORLD	LONG	889.64		861.81	857.93
02-MSCI EUROPE	NEUTRALE	1168.58	1187.38		1137.52
03-MSCI USA	LONG	1183.87		1143.60	1129.16
04-MSCI EMERG	NEUTRALE	47362.05	47722.12		46366.86
05-DJ STOXX 600	NEUTRALE	275.93	277.27		266.60
06-DJ EU STOXX50	NEUTRALE	2840.71	2936.79		2736.96
07-DAX	LONG	6964.16		6848.98	6737.99
08-CAC 40	NEUTRALE	3858.05	3937.03		3723.16
09-FTSE 100 (UK)	NEUTRALE	5807.96	5924.72		5668.70
10-FTSEMIB40	NEUTRALE	20487.34	21678.72		19833.65
11-SMI	SHORT	6537.63	6712.27	6565.22	
12-DOW JONES	LONG	11370.06		11092.00	11082.65
13-S&P 500	LONG	1233.00		1189.40	1183.39
14-NASDAQ	LONG	2616.67		2534.56	2493.81
15-TOKYO TOPIX	LONG	891.60		866.81	860.93
16-HONG KONG HS	NEUTRALE	23171.80	24002.28		22877.25
17-CRB CASH INDEX	LONG	316.09		304.13	295.39
18-LIGHT CRUDE	LONG	88.59		84.45	81.47
19-GOLD	LONG	1385.64		1362.92	1316.60
20-EUR SCHATZ 2Y	SHORT	108.54	109.48	109.02	
21-EUR BOBL 5Y	SHORT	117.89	120.75	119.15	
22-EUR BUND 10Y	SHORT	124.70	129.78	126.35	
23-T-NOTE 2Y	NEUTRALE	109.30	109.97		109.23
24-T-NOTE 5Y	SHORT	117.57	122.16	119.05	
25-T-NOTE 10Y	SHORT	120.77	126.80	122.60	
26-EUR/USD	SHORT	1.3228	1.3880	1.3401	
27-EUR/JPY	NEUTRALE	111.02	115.64		109.57
28-EUR/CHF	SHORT	1.2978	1.3554	1.3284	
29-USD/JPY	NEUTRALE	83.94	84.34		82.35
30-USD/CHF	NEUTRALE	0.9812	1.0033		0.9726

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 :	19/12/2010	validi fino alla fine del mese in corso		
		Ultima quotaz	ENTRY LONG	EXIT (NEUTRAL)	ENTRY SHORT
00-S&P FUT	LONG	1238.40		1136.70	1074.00
01-MSCI WORLD	LONG	893.38		850.44	797.24
02-MSCI EUROPE	LONG	1175.77		1108.73	1050.79
03-MSCI USA	LONG	1186.38		1124.51	1028.15
04-MSCI EMERG	LONG	47239.38		46347.19	41569.19
05-DJ STOXX 600	LONG	276.42		259.72	250.40
06-DJ EU STOXX50	LONG	2821.77		2635.08	2626.80
07-DAX	LONG	6982.45		6229.02	6018.37
08-CAC 40	LONG	3867.35		3591.78	3433.02
09-FTSE 100 (UK)	LONG	5871.75		5519.19	5035.66
10-FTSEMIB40	SHORT	20069.18	22100.95	21258.98	
11-SMI	LONG	6538.16		6296.33	6078.76
12-DOW JONES	LONG	11491.91		10788.05	10197.69
13-S&P 500	LONG	1243.91		1141.20	1075.16
14-NASDAQ	LONG	2642.97		2368.62	2183.68
15-TOKYO TOPIX	LONG	903.14		813.46	774.22
16-HONG KONG HS	EXIT - NEUTRALE	22714.85			19600.35
17-CRB CASH INDEX	LONG	320.62		298.12	254.26
18-LIGHT CRUDE	LONG	88.77		80.28	71.83
19-GOLD	LONG	1375.04		1307.65	1150.60
20-EUR SCHATZ 2Y	EXIT - NEUTRALE	108.64	109.75		
21-EUR BOBL 5Y	ENTRY SHORT	117.96			
22-EUR BUND 10Y	ENTRY SHORT	124.90			
23-T-NOTE 2Y	ENTRY SHORT	109.19			
24-T-NOTE 5Y	ENTRY SHORT	117.08			
25-T-NOTE 10Y	ENTRY SHORT	120.25			
26-EUR/USD	LONG	1.3187		1.2969	1.2796
27-EUR/JPY	LONG	110.66		108.35	108.35
28-EUR/CHF	ENTRY SHORT	1.2792			
29-USD/JPY	NEUTRALE	83.90	87.24		80.34
30-USD/CHF	EXIT - NEUTRALE	0.9700	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.