

POSIZIONE DEL TREND E LIVELLI **SETTIMANALI** VALIDI PER LA SETTIMANA 22/11 – 29/11

Change of Trend Automatic Model - genetic algorithm

TREND settimanale - posizione al 21/11/2010			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	NEUTRALE	1198.20	1221.90		1160.30
01-MSCI WORLD	NEUTRALE	869.62	879.84		854.76
02-MSCI EUROPE	SHORT	1163.07	1171.78	1160.61	
03-MSCI USA	NEUTRALE	1142.32	1168.86		1119.05
04-MSCI EMERG	NEUTRALE	47130.36	48329.87		46559.63
05-DJ STOXX 600	NEUTRALE	269.50	272.74		260.52
06-DJ EU STOXX50	NEUTRALE	2845.75	2913.08		2775.84
07-DAX	LONG	6843.55		6653.57	6468.02
08-CAC 40	SHORT	3860.16	3916.73	3916.73	
09-FTSE 100 (UK)	NEUTRALE	5732.83	5875.35		5603.93
10-FTSE MIB40	SHORT	20773.12	21877.82	21183.37	
11-SMI	LONG	6590.84		6466.51	6397.68
12-DOW JONES	NEUTRALE	11203.55	11444.08		10939.91
13-S&P 500	NEUTRALE	1199.73	1225.85		1163.14
14-NASDAQ	NEUTRALE	2518.12	2578.98		2430.96
15-TOKYO TOPIX	LONG	869.52		846.77	789.55
16-HONG KONG HS	NEUTRALE	23605.71	24876.82		22980.58
17-CRB CASH INDEX	NEUTRALE	298.89	313.56		284.82
18-LIGHT CRUDE	NEUTRALE	81.86	87.40		79.17
19-GOLD	NEUTRALE	1353.24	1393.45		1294.65
20-EUR SCHATZ 2Y	SHORT	108.77	108.97	108.97	
21-EUR BOBL 5Y	SHORT	119.11	120.45	120.01	
22-EUR BUND 10Y	SHORT	127.47	130.30	129.07	
23-T-NOTE 2Y	SHORT	109.66	110.06	109.83	
24-T-NOTE 5Y	SHORT	120.21	121.94	121.94	
25-T-NOTE 10Y	SHORT	124.52	127.42	125.28	
26-EUR/USD	SHORT	1.3679	1.4033	1.3997	
27-EUR/JPY	LONG	114.12		112.34	111.33
28-EUR/CHF	NEUTRALE	1.3560	1.3847		1.3363
29-USD/JPY	LONG	83.44		81.28	80.23
30-USD/CHF	LONG	0.9911		0.9764	0.9614

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 - AGGIORNAMENTO

Change of Trend Automatic Model - genetic algorithm

TREND mensile - posizione al : 21/11/2010			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	1198.20		1050.90	1048.30
01-MSCI WORLD	LONG	869.62		828.11	779.26
02-MSCI EUROPE	LONG	1163.07		1107.78	1048.28
03-MSCI USA	LONG	1142.32		1083.41	998.28
04-MSCI EMERG	LONG	47130.36		45913.47	42136.41
05-DJ STOXX 600	LONG	269.50		251.31	248.00
06-DJ EU STOXX50	LONG	2845.75		2622.95	2578.81
07-DAX	LONG	6843.55		6153.21	5653.97
08-CAC 40	LONG	3860.16		3490.79	3464.06
09-FTSE 100 (UK)	LONG	5732.83		5225.22	5164.69
10-FTSEMIB40	LONG	20773.12		19734.57	19268.39
11-SMI	ENTRY LONG	6590.84			
12-DOW JONES	LONG	11203.55		10016.01	10014.72
13-S&P 500	LONG	1199.73		1049.72	1049.33
14-NASDAQ	LONG	2518.12		2141.95	2114.03
15-TOKYO TOPIX	ENTRY LONG	869.52			
16-HONG KONG HS	LONG	23605.71		22504.05	19836.73
17-CRB CASH INDEX	LONG	298.89		283.53	255.97
18-LIGHT CRUDE	LONG	81.86		79.70	71.80
19-GOLD	LONG	1353.24		1306.55	1162.34
20-EUR SCHATZ 2Y	SHORT	108.77	109.81	109.81	
21-EUR BOBL 5Y	NEUTRALE	119.11	122.67		118.08
22-EUR BUND 10Y	NEUTRALE	127.47	134.49		124.13
23-T-NOTE 2Y	EXIT - NEUTRALE	109.66			109.45
24-T-NOTE 5Y	EXIT - NEUTRALE	120.21			119.08
25-T-NOTE 10Y	EXIT - NEUTRALE	124.52			121.24
26-EUR/USD	LONG	1.3679		1.2690	1.2569
27-EUR/JPY	LONG	114.12		106.53	106.53
28-EUR/CHF	ENTRY LONG	1.3560			
29-USD/JPY	SHORT	83.44	89.61	83.99	
30-USD/CHF	SHORT	0.9911	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.