

POSIZIONE DEL TREND E LIVELLI **SETTIMANALI** VALIDI PER LA SETTIMANA 27/12 – 31/12

Change of Trend Automatic Model - genetic algorithm			LIVELLI DI CAMBIAMENTO DEL TREND		
TREND settimanale	posizione al :	26/12/2010	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 GENNAIO

LIVELLI PRELIMINARI (da confermare dopo il 31.12)

Change of Trend Automatic Model - genetic algorithm			LIVELLI DI CAMBIAMENTO DEL TREND		
TREND mensile	posizione al :	26/12/2010	validi fino alla fine del mese in corso		
		Ultima quotaz	ENTRY LONG	EXIT (NEUTRAL)	ENTRY SHORT
00-S&P FUT	LONG	1253.00		1177.70	1074.20
01-MSCI WORLD	LONG	902.95		866.62	800.46
02-MSCI EUROPE	LONG	1190.84		1133.87	1074.92
03-MSCI USA	LONG	1199.96		1151.80	1043.68
04-MSCI EMERG	LONG	47745.14		46690.21	44075.32
05-DJ STOXX 600	LONG	281.76		264.92	248.24
06-DJ EU STOXX50	LONG	2864.52		2665.66	2657.38
07-DAX	LONG	7057.69		6736.69	5988.82
08-CAC 40	LONG	3911.32		3620.64	3483.92
09-FTSE 100 (UK)	LONG	5996.07		5528.27	5178.05
10-FTSEMIB40	SHORT	20774.16	21450.61	21258.98	
11-SMI	LONG	6599.43		6334.72	6198.84
12-DOW JONES	LONG	11573.49		11007.23	10375.27
13-S&P 500	LONG	1256.77		1186.60	1084.37
14-NASDAQ	LONG	2665.60		2535.19	2259.99
15-TOKYO TOPIX	LONG	905.78		813.46	799.33
16-HONG KONG HS	NEUTRALE	22902.97	23612.25		20233.60
17-CRB CASH INDEX	LONG	329.38		300.67	261.70
18-LIGHT CRUDE	LONG	91.41		81.45	72.18
19-GOLD	LONG	1375.60		1359.20	1245.95
20-EUR SCHATZ 2Y	NEUTRALE	108.81	110.05		108.38
21-EUR BOBL 5Y	SHORT	118.48	122.36	119.76	
22-EUR BUND 10Y	SHORT	125.15	133.26	127.94	
23-T-NOTE 2Y	SHORT	109.21	110.06	109.61	
24-T-NOTE 5Y	SHORT	117.19	122.99	119.11	
25-T-NOTE 10Y	SHORT	119.59	128.77	122.41	
26-EUR/USD	LONG	1.3111		1.2971	1.2971
27-EUR/JPY	LONG	108.77		108.46	108.46
28-EUR/CHF	SHORT	1.2576	1.3702	1.3187	
29-USD/JPY	NEUTRALE	83.02	86.52		80.35
30-USD/CHF	NEUTRALE	0.9593	1.0236		0.9498

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 **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.