

POSIZIONE DEL TREND E LIVELLI **SETTIMANALI** VALIDI PER LA SETTIMANA 04/10 – 08/10

N.B.- Questo modello era stato originariamente creato per il trading automatizzato 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.

Change of Trend Automatic Model - genetic algorithm			LIVELLI DI CAMBIAMENTO DEL TREND		
TREND settimanale - posizione al : 04/10/2010			validi fino alla fine della settimana in corso		
		Ultima quotaz	ENTRY LONG	EXIT (NEUTRAL)	ENTRY SHORT
00-S&P FUT	LONG	1142.30		1119.70	1085.30
01-MSCI WORLD	NEUTRALE	831.82	836.96		810.08
02-MSCI EUROPE	NEUTRALE	1117.21	1123.68		1113.37
03-MSCI USA	LONG	1087.34		1073.82	1044.49
04-MSCI EMERG	LONG	45676.48		45295.14	43365.85
05-DJ STOXX 600	NEUTRALE	259.09	266.82		258.15
06-DJ EU STOXX50	NEUTRALE	2732.91	2813.97		2719.71
07-DAX	NEUTRALE	6211.34	6339.36		6155.39
08-CAC 40	NEUTRALE	3692.09	3800.87		3648.34
09-FTSE 100 (UK)	LONG	5592.90		5506.07	5420.04
10-SPMIB40	NEUTRALE	20391.27	20916.84		20199.55
11-SMI	SHORT	6284.17	6482.62	6393.28	
12-DOW JONES	LONG	10829.68		10608.08	10256.38
13-S&P 500	LONG	1146.24		1125.59	1085.81
14-NASDAQ	LONG	2370.75		2316.11	2191.42
15-TOKYO TOPIX	NEUTRALE	829.97	852.09		817.76
16-HONG KONG HS	LONG	22358.17		22091.13	21087.52
17-CRB CASH INDEX	LONG	285.69		282.45	269.09
18-LIGHT CRUDE	LONG	81.73		76.96	68.95
19-GOLD	LONG	1318.75		1286.25	1222.95
20-EUR SCHATZ 2Y	SHORT	109.08	109.62	109.36	
21-EUR BOBL 5Y	NEUTRALE	120.52	121.08		120.11
22-EUR BUND 10Y	NEUTRALE	131.28	132.20		129.82
23-T-NOTE 2Y	LONG	109.74		109.58	109.47
24-T-NOTE 5Y	LONG	120.87		119.91	119.57
25-T-NOTE 10Y	LONG	126.08		124.37	123.97
26-EUR/USD	LONG	1.3790		1.3402	1.2510
27-EUR/JPY	LONG	114.75		112.02	106.77
28-EUR/CHF	LONG	1.3426		1.3165	1.2741
29-USD/JPY	NEUTRALE	83.22	85.85		82.67
30-USD/CHF	SHORT	0.9736	1.0232	1.0059	

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 : 04/10/2010			validi fino alla fine del mese in corso		
		Ultima quotaz	ENTRY LONG	EXIT (NEUTRAL)	ENTRY SHORT
00-S&P FUT	LONG	1142.30		1050.90	1035.50
01-MSCI WORLD	NEUTRALE	831.82	837.26		786.67
02-MSCI EUROPE	LONG	1117.21		1087.64	1084.72
03-MSCI USA	NEUTRALE	1087.34	1093.73		1001.77
04-MSCI EMERG	LONG	45676.48		43215.84	40140.93
05-DJ STOXX 600	LONG	259.09		250.88	244.68
06-DJ EU STOXX50	NEUTRALE	2732.91	2827.44		2549.74
07-DAX	LONG	6211.34		5876.43	5743.10
08-CAC 40	LONG	3692.09		3478.85	3396.74
09-FTSE 100 (UK)	LONG	5592.90		5225.22	5094.81
10-SPMIB40	NEUTRALE	20391.27	21142.49		19033.38
11-SMI	NEUTRALE	6284.17	6537.73		6196.64
12-DOW JONES	LONG	10829.68		10016.01	9791.64
13-S&P 500	LONG	1146.24		1049.72	1030.93
14-NASDAQ	LONG	2370.75		2141.95	2093.61
15-TOKYO TOPIX	SHORT	829.97	893.99	858.77	
16-HONG KONG HS	LONG	22358.17		20529.87	19047.77
17-CRB CASH INDEX	LONG	285.69		265.28	244.89
18-LIGHT CRUDE	ENTRY LONG	81.73			
19-GOLD	LONG	1318.75		1236.45	1181.05
20-EUR SCHATZ 2Y	ENTRY SHORT	109.08			
21-EUR BOBL 5Y	NEUTRALE	120.52	122.71		118.45
22-EUR BUND 10Y	NEUTRALE	131.28	134.37		124.13
23-T-NOTE 2Y	NEUTRALE	109.74	109.75		109.22
24-T-NOTE 5Y	NEUTRALE	120.87	121.00		116.98
25-T-NOTE 10Y	NEUTRALE	126.08	126.44		119.19
26-EUR/USD	LONG	1.3790		1.2641	1.1424
27-EUR/JPY	NEUTRALE	114.75	115.68		105.81
28-EUR/CHF	SHORT	1.3426	1.3810	1.3582	
29-USD/JPY	SHORT	83.22	91.35	86.47	
30-USD/CHF	SHORT	0.9736	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 il punto dove il trend si ribalta.	
ENTRY SHORT	Posizione al ribasso entrata nel periodo in corso.	

POSIZIONE DEL TREND E LIVELLI **TRIMESTRALI** VALIDI FINO AL 31 DICEMBRE

N.B. – La posizione trimestrale, anche se ha scarsissima valenza sull’operatività di breve, è molto importante in quanto – quando è direzionale - determina il **TREND DI FONDO** del mercato, spesso perdurante (attraverso normali correzioni) per 6-15+ mesi.

Change of Trend Automatic Model - genetic algorithm

LIVELLI DI CAMBIAMENTO DEL TREND

TREND trimestrale - posizione al : 04/10/2010

validi per il trimestre in corso

		Ultima quotaz.	ENTRY LONG	EXIT POSITION	ENTRY SHORT
00-S&P FUT	NEUTRALE	1142.30	1165.20		934.70
01-MSCI WORLD	NEUTRALE	831.82	867.17		710.24
02-MSCI EUROPE	NEUTRALE	1117.21	1158.05		1005.45
03-MSCI USA	NEUTRALE	1087.34	1113.36		898.72
04-MSCI EMERG	LONG	45676.48		40516.32	39531.07
05-DJ STOXX 600	NEUTRALE	259.09	267.78		218.27
06-DJ EU STOXX50	NEUTRALE	2732.91	3095.15		2502.50
07-DAX	LONG	6211.34		5809.37	5449.09
08-CAC 40	NEUTRALE	3692.09	3974.01		3321.35
09-FTSE 100 (UK)	NEUTRALE	5592.90	5679.64		4735.43
10-SPMIB40	NEUTRALE	20391.27	24982.61		18807.18
11-SMI	NEUTRALE	6284.17	6873.37		5912.26
12-DOW JONES	NEUTRALE	10829.68	10948.88		9076.16
13-S&P 500	NEUTRALE	1146.24	1169.43		938.91
14-NASDAQ	NEUTRALE	2370.75	2400.06		1865.78
15-TOKYO TOPIX	SHORT	829.97	978.81	978.81	
16-HONG KONG HS	NEUTRALE	22358.17	23722.31		19777.83
17-CRB CASH INDEX	LONG	285.69		253.48	248.53
18-LIGHT CRUDE	NEUTRALE	81.73	83.76		65.50
19-GOLD	LONG	1318.75		1113.35	1002.10
20-EUR SCHATZ 2Y	LONG	109.08		108.77	107.59
21-EUR BOBL 5Y	LONG	120.52		117.60	113.72
22-EUR BUND 10Y	LONG	131.28		128.54	116.66
23-T-NOTE 2Y	LONG	109.74		108.48	108.48
24-T-NOTE 5Y	LONG	120.87		117.93	113.89
25-T-NOTE 10Y	LONG	126.08		121.59	113.63
26-EUR/USD	NEUTRALE	1.3790	1.6025		1.2194
27-EUR/JPY	SHORT	114.75	136.14	124.314	
28-EUR/CHF	SHORT	1.3426	1.5972	1.4032	
29-USD/JPY	SHORT	83.22	93.46	89.155	
30-USD/CHF	NEUTRALE	0.9736	1.0789		0.9213

Legenda

Situazione relativa all'arco temporale in esame (trimestre)

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 il punto dove il trend si ribalta.
ENTRY SHORT	Posizione al ribasso entrata nel periodo in corso.