

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

Change of Trend Automatic Model - genetic algorithm

		TREND mensile - posizione al : 02/12/2010	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	1204.50		1136.70	1074.00
01-MSCI WORLD	LONG	850.44		850.44	797.24
02-MSCI EUROPE	LONG	1108.73		1108.73	1050.79
03-MSCI USA	LONG	1127.50		1124.51	1028.15
04-MSCI EMERG	LONG	46160.77		46347.19	41569.19
05-DJ STOXX 600	LONG	267.11		259.72	250.40
06-DJ EU STOXX50	LONG	2721.87		2635.08	2626.80
07-DAX	LONG	6866.63		6229.02	6018.37
08-CAC 40	LONG	3669.29		3591.78	3433.02
09-FTSE 100 (UK)	LONG	5642.50		5519.19	5035.66
10-FTSEMIB40	SHORT	19566.06	22100.95	21258.98	
11-SMI	LONG	6409.70		6296.33	6078.76
12-DOW JONES	LONG	11255.78		10788.05	10197.69
13-S&P 500	LONG	1206.07		1141.20	1075.16
14-NASDAQ	LONG	2549.43		2368.62	2183.68
15-TOKYO TOPIX	LONG	866.07		813.46	774.22
16-HONG KONG HS	EXIT - NEUTRALE	23249.80			19600.35
17-CRB CASH INDEX	LONG	308.91		298.12	254.26
18-LIGHT CRUDE	LONG	86.81		80.28	71.83
19-GOLD	LONG	1387.55		1307.65	1150.60
20-EUR SCHATZ 2Y	EXIT - NEUTRALE	109.20	109.75		
21-EUR BOBL 5Y	NEUTRALE	119.32	121.74		118.95
22-EUR BUND 10Y	ENTRY SHORT	126.78			
23-T-NOTE 2Y	NEUTRALE	109.78	110.14		109.53
24-T-NOTE 5Y	NEUTRALE	120.63	122.93		119.87
25-T-NOTE 10Y	ENTRY SHORT	122.83			
26-EUR/USD	LONG	1.3061		1.2969	1.2796
27-EUR/JPY	LONG	110.01		108.35	108.35
28-EUR/CHF	EXIT - NEUTRALE	1.3113			1.2932
29-USD/JPY	NEUTRALE	84.24	87.24		80.34
30-USD/CHF	EXIT - NEUTRALE	1.0040	1.0602		

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.