

POSIZIONE DEL TREND E LIVELLI **SETTIMANALI** VALIDI PER LA SETTIMANA 06/12 – 10/12

Change of Trend Automatic Model - genetic algorithm

TREND settimanale - posizione al 05/12/2010		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	LONG	1223.50		1171.20
01-MSCI WORLD	SHORT	878.63	887.42	
02-MSCI EUROPE	NEUTRALE	1155.62	1206.64	1108.73
03-MSCI USA	SHORT	1166.29	1178.01	
04-MSCI EMERG	NEUTRALE	47429.36	49194.67	46160.77
05-DJ STOXX 600	SHORT	270.94	278.17	271.68
06-DJ EU STOXX50	SHORT	2782.39	2936.79	2825.45
07-DAX	NEUTRALE	6947.72	6977.91	6488.89
08-CAC 40	SHORT	3750.55	3953.56	3760.37
09-FTSE 100 (UK)	SHORT	5745.32	5976.80	5784.26
10-FTSEMIB40	SHORT	20120.80	21678.72	20025.15
11-SMI	SHORT	6440.90	6688.70	6590.84
12-DOW JONES	LONG	11382.09		10911.37
13-S&P 500	LONG	1224.71		1168.09
14-NASDAQ	LONG	2591.46		2468.70
15-TOKYO TOPIX	LONG	879.22		832.76
16-HONG KONG HS	SHORT	23320.52	24997.06	23611.04
17-CRB CASH INDEX	LONG	316.16		296.29
18-LIGHT CRUDE	LONG	89.44		81.86
19-GOLD	LONG	1413.69		1345.49
20-EUR SCHATZ 2Y	LONG	109.27		108.76
21-EUR BOBL 5Y	NEUTRALE	119.34	120.53	119.03
22-EUR BUND 10Y	SHORT	126.15	131.30	127.81
23-T-NOTE 2Y	SHORT	109.49	109.84	109.66
24-T-NOTE 5Y	SHORT	118.83	122.40	119.96
25-T-NOTE 10Y	SHORT	122.63	128.27	124.03
26-EUR/USD	SHORT	1.3421	1.4029	1.3421
27-EUR/JPY	SHORT	110.83	115.52	111.63
28-EUR/CHF	SHORT	1.3061	1.3582	1.3284
29-USD/JPY	NEUTRALE	82.57	84.41	81.40
30-USD/CHF	NEUTRALE	0.9730	1.0067	0.9607

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 DICEMBRE - AGGIORNAMENTO

Change of Trend Automatic Model - genetic algorithm

		TREND mensile - posizione al : 05/12/2010	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	1223.50		1136.70	1074.00
01-MSCI WORLD	LONG	878.63		850.44	797.24
02-MSCI EUROPE	LONG	1155.62		1108.73	1050.79
03-MSCI USA	LONG	1166.29		1124.51	1028.15
04-MSCI EMERG	LONG	47429.36		46347.19	41569.19
05-DJ STOXX 600	LONG	270.94		259.72	250.40
06-DJ EU STOXX50	LONG	2782.39		2635.08	2626.80
07-DAX	LONG	6947.72		6229.02	6018.37
08-CAC 40	LONG	3750.55		3591.78	3433.02
09-FTSE 100 (UK)	LONG	5745.32		5519.19	5035.66
10-FTSEMIB40	SHORT	20120.80	22100.95	21258.98	
11-SMI	LONG	6440.90		6296.33	6078.76
12-DOW JONES	LONG	11382.09		10788.05	10197.69
13-S&P 500	LONG	1224.71		1141.20	1075.16
14-NASDAQ	LONG	2591.46		2368.62	2183.68
15-TOKYO TOPIX	LONG	879.22		813.46	774.22
16-HONG KONG HS	EXIT - NEUTRALE	23320.52			19600.35
17-CRB CASH INDEX	LONG	316.16		298.12	254.26
18-LIGHT CRUDE	LONG	89.44		80.28	71.83
19-GOLD	LONG	1413.69		1307.65	1150.60
20-EUR SCHATZ 2Y	EXIT - NEUTRALE	109.27	109.75		
21-EUR BOBL 5Y	NEUTRALE	119.34	121.74		118.95
22-EUR BUND 10Y	ENTRY SHORT	126.15			
23-T-NOTE 2Y	ENTRY SHORT	109.49			
24-T-NOTE 5Y	ENTRY SHORT	118.83			
25-T-NOTE 10Y	ENTRY SHORT	122.63			
26-EUR/USD	LONG	1.3421		1.2969	1.2796
27-EUR/JPY	LONG	110.83		108.35	108.35
28-EUR/CHF	EXIT - NEUTRALE	1.3061			1.2932
29-USD/JPY	NEUTRALE	82.57	87.24		80.34
30-USD/CHF	EXIT - NEUTRALE	0.9730	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. Per i mercati che hanno solo chiusura giornaliera (es.: indici MSCI) il livello da considerare è ovviamente la chiusura giornaliera stessa.