

VIEW WEEKLY del 25 maggio 2014

Da questa settimana affrontiamo l'analisi quantitativa in modo ancora più dettagliato, abbracciando i listini principali europei come Francoforte, Parigi, Londra e Milano.

In fondo all'analisi quantitativa parleremo del trading system DAX2 del BUND 1, BUND 2 e DAX DAILY.

Rimandiamo alle view daily e alle prossime view weekly la parte discorsiva.

ANALISI QUANTITATIVA

ETF LONG

ISHARES EM MKT LOCAL GOVT BOND UCITS ET	63,52 (c)
SPDR BARCL EM MKTS LOCAL BOND UCITS ETF	69,05 (c)
ETFS NICKEL	15,470 (c)
AMUNDI GLOB EM BOND MARK IBX UCITS ETF	86,93 (c)
LYXOR UCITS ETF MSCI INDIA	11,800 (c)
LYXOR UCITS ETF TURKEY	47,760 (c)
LYXOR UCITS ETF EMTS 3-5Y INV GRADE DR	146,05 (c)
ETFS SOYBEANS	21,730 (c)
LYXOR UCITS ETF COMMODITIES CRB EX-ENER	18,745 (c)
ETFS BRENT 1MTH OIL SECURITIES	52,56 (c)
ETFS WTI CRUDE OIL	19,610 (c)
ISHARES MSCI KOREA UCITS ETF (INC)	30,480 (c)
ISHARES MSCI EMERG MKTS UCITS ETF (INC)	29,690 (c)
ETFS GASOLINE	40,150 (c)

ETF SHORT

Al momento non ci sono etf in posizione short fra quelli nella lista.

ANALISI SETTORI

SETTORI LONG

ESTX FOOD+BEVERAGE PR.EUR	467,79 (c)
---------------------------	------------

SETTORI SHORT

ESTX INSURANCE PR.EUR	206,52 (c)
-----------------------	------------

CLASSIFICA SETTORI

ESTX UTILITY PR.EUR	284,15 (c)
ESTX MEDIA PR.EUR	202,08 (c)
ESTX AUTOM.+PARTS PR.EUR	491,82 (c)
ESTX CHEMICAL PR.EUR	939,86 (c)
ESTX REAL EST.PR.EUR	187,41 (c)
ESTX OIL + GAS PR.EUR	363,99 (c)
ESTX FOOD+BEVERAGE PR.EUR	467,79 (c)
ESTX TECHNOLOGY PR.EUR	300,82 (c)
ESTX IND.GOODS+SER.PR.EUR	605,21 (c)
ESTX BASIC RESOURC.PR.EUR	197,10 (c)
ESTX BANKS PR.EUR	149,43 (c)
ESTX HEALTH CARE PR.EUR	655,67 (c)
ESTX INSURANCE PR.EUR	206,52 (c)
ESTX CONSTR.+MATER.PR.EUR	334,12 (c)
ESTX TELECOMMUNICA.PR.EUR	312,94 (c)
ESTX FIN.SERVICES PR.EUR	294,80 (c)

TITOLI DAX LONG

THYSSENKRUPP AG O.N.	22,140 (c)
HENKEL AG+CO.KGAA VZO	83,66 (c)
MERCK KGAA O.N.	125,35 (c)
LINDE AG O.N.	151,00 (c)
FRESENIUS SE+CO.KGAA O.N.	108,20 (c)

TITOLI DAX SHORT

COMMERZBANK AG	11,450 (c)
FRESEN.MED.CARE KGAA O.N.	47,775 (c)
SAP AG O.N.	54,54 (c)
DEUTSCHE BANK AG NA O.N.	29,935 (c)

TITOLI CAC40- LONG

UNIBAIL-RODAMCO	199,50 (c)
GDF SUEZ	20,290 (c)
PERNOD RICARD	89,22 (c)
DANONE	53,93 (c)
CAP GEMINI	52,47 (c)
LVMH	143,15 (c)

TITOLI CAC40 - SHORT

VALLOUREC	38,570 (c)
AXA	17,605 (c)

TITOLI FTSEMIB LONG

PARMALAT	2,500 (c)
----------	-----------

TITOLI FTSEMIB SHORT

AZIMUT	19,45 (c)
FINMECCANICA	5,720 (c)
A2A	0,8315 (c)
MEDIOLANUM	5,885 (c)
ANSALDO STS	7,525 (c)
PRYSMIAN	16,50 (c)
MEDIASET S.P.A	3,462 (c)
BCA POP EMIL ROMAGNA	7,320 (c)
GTECH	20,07 (c)
BUZZI UNICEM	12,47 (c)
TOD S	95,50 (c)

TITOLI SVIZZERA LONG

SONOVA N	136,10 (c)
NOVARTIS N	80,70 (c)
GVAUDAN N	1.456,00 (c)
RICHEMONT N	94,05 (c)
NESTLE N	70,00 (c)
SWISS PRIME SITE N	73,50 (c)
ZURICH INSURANCE N	265,80 (c)
HOLCIM N	79,05 (c)
ROCHE GS	268,40 (c)

TITOLI SVIZZERA SHORT

SULZER N	135,20 (c)
DUFREY N	145,80 (c)
TRANSOCEAN N	38,34 (c)

TITOLI UK LONG

UTD. UTILITIES	846,0 (c)
COMPASS GROUP	995,0 (c)
IMP.TOBACCO GRP	2.659 (c)
NATIONAL GRID	880,5 (c)
SEVERN TRENT	1.924 (c)
VEDANTA	1.078,0 (c)
PACE	370,0 (c)
DCC	3.405 (c)
BR.AMER.TOB.	3.515,5 (c)
UNILEVER	2.664 (c)
RECKITT BEN. GP	5.000 (c)
G4S	251,5 (c)
LEGAL&GEN.	225,1 (c)
IMI	1.519 (c)
3I GRP.	420,8 (c)
REXAM	528,5 (c)
TALKTALK	311,9 (c)
KAZAKHMYS	266,4 (c)

TITOLI UK SHORT

LANCASHIRE	611,0 (c)
BALFOUR B.	226,5 (c)
COCACOLA HBC AG	1.369 (c)
INMARSAT	699,0 (c)
PETROFAC	1.250 (c)
PEARSON	1.137 (c)
HOME RETAIL	191,8 (c)
SIG	182,0 (c)
BOOKER	137,1 (c)
BARRATT DEVEL.	358,3 (c)
TRAVIS PERKINS	1.670 (c)
INTL CONSOL AIR	379,4 (c)
VODAFONE GRP.	206,20 (c)
SAINSBURY(J)	343,7 (c)
ITV	178,5 (c)
LONMIN	261,4 (c)
RIGHTMOVE	2.331 (c)
QINETIQ	197,1 (c)
ASHMORE	345,0 (c)
EXPERIAN	1.022 (c)
INTERTEK GROUP	2.871 (c)
ICAP	394,4 (c)
THOMAS COOK	159,2 (c)
INT.CAP.GRP	399,0 (c)
BERKELEY GP.HLD	2.259 (c)
TULLOW OIL	841,0 (c)
PLAYTECH	632,0 (c)
ESSENTRA	782,0 (c)
DIXONS RETAIL	46,77 (c)
GREENE KING	849,0 (c)
ROLLS-ROYCE HLG	998 (c)
LADBROKES	143,9 (c)
OPHIR ENERGY	260,1 (c)
LLOYDS GRP.	75,96 (c)
WILLIAM HILL	335,5 (c)
BWIN.PARTY	118,5 (c)
TATE & LYLE	680,5 (c)
SMITHS GROUP	1.322 (c)

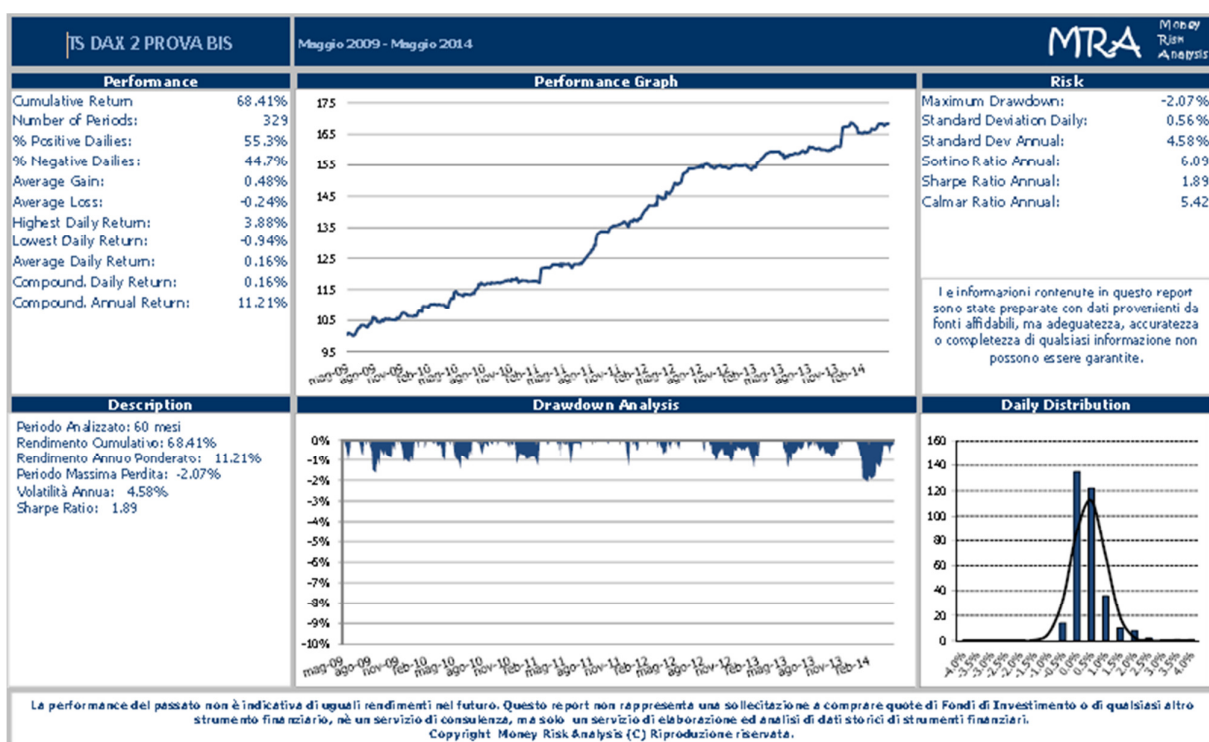
CROSS VALUTARI LONG

Spot EUR/DKK	7,4640 (c)
Spot AUD/CHF	0,8268 (c)
Spot AUD/USD	0,9231 (c)
Spot GBP/DKK	9,2172 (c)

CROSS VALUTARI SHORT

Spot EUR/NOK	8,1232 (c)
Spot EUR/AUD	1,4765 (c)
Spot EUR/GBP	0,8099 (c)

TRADING SYSTEM DAX2 (CAPITALE PARTENZA 200 MILA EURO)



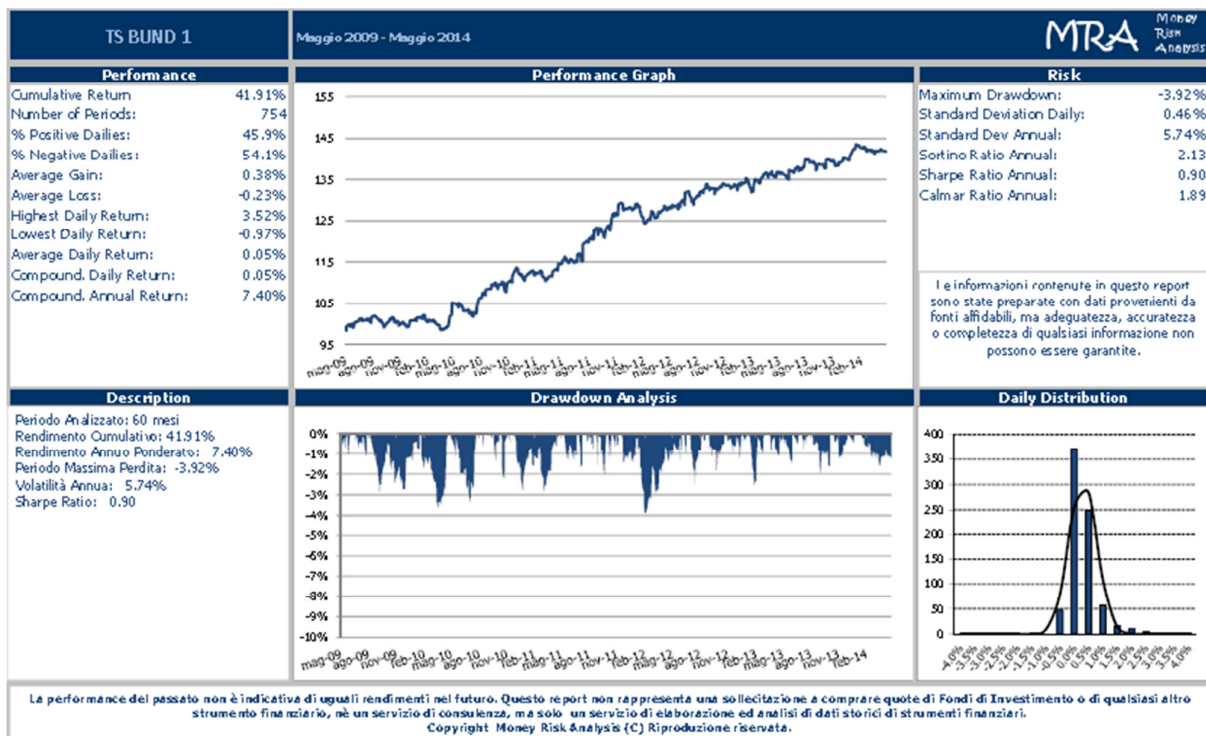
La scorsa settimana abbiamo affrontato il trading system DAX1. L'obiettivo del DAX1 è quello di cogliere al meglio la dinamica del mercato, sfruttando nella sua totalità i cicli più importanti senza trascurare le fasi semi laterali. Un trading system, per sua struttura soffre durante le fasi laterali. Il Dax1 è studiato al fine di limitare al massimo i danni anche in assenza di tendenza.

Il Dax2 invece, di fasi laterali non ne vuol sentir parlare. Esso entra in funzione solo ed esclusivamente durante situazioni ben manifeste di mercato, limitando al massimo i rischi dell'operazione. Confrontando il grafico di oggi, con quello della scorsa settimana, infatti possiamo vedere la differenza in termini di draw down e di massima perdita. Ovviamente ogni sistema ha i suoi pro e i suoi contro. Il Dax2 ad esempio può scartare anche quasi totalmente i movimenti più importanti, in quanto la sua funzione è quella di cavalcare il trend con il minor rischio possibile. Può capitare che questa condizione non si verifichi per tutti i trend

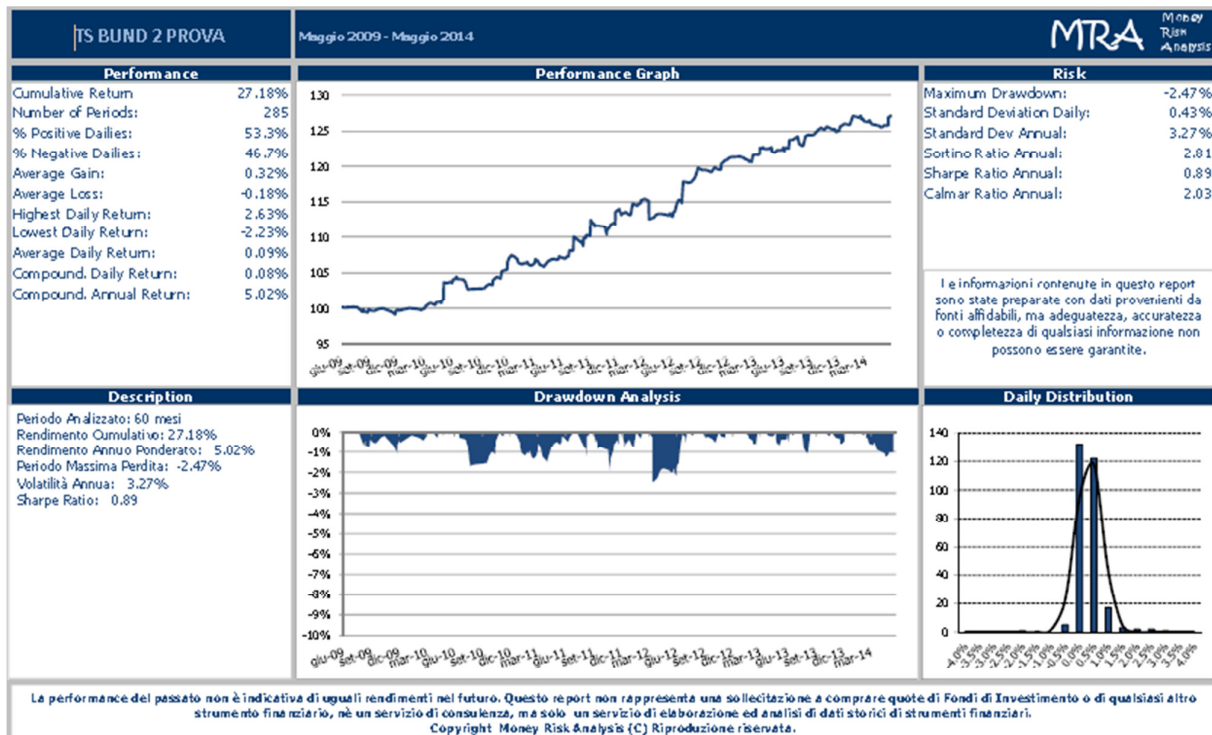
ben definiti. Pertanto esso viene utilizzato in supporto al Dax1, al fine di incrementare le posizioni là dove ci si presenti di fronte ad una situazione di rischio più contenuta con buone possibilità di gain.

Gli stessi concetti che abbiamo visto sia per il Dax1 che per il Dax2 vengono applicati al Bund con i seguenti risultati.

TRADING SYSTEM BUND1 (CAPITALE PARTENZA 100 MILA EURO)

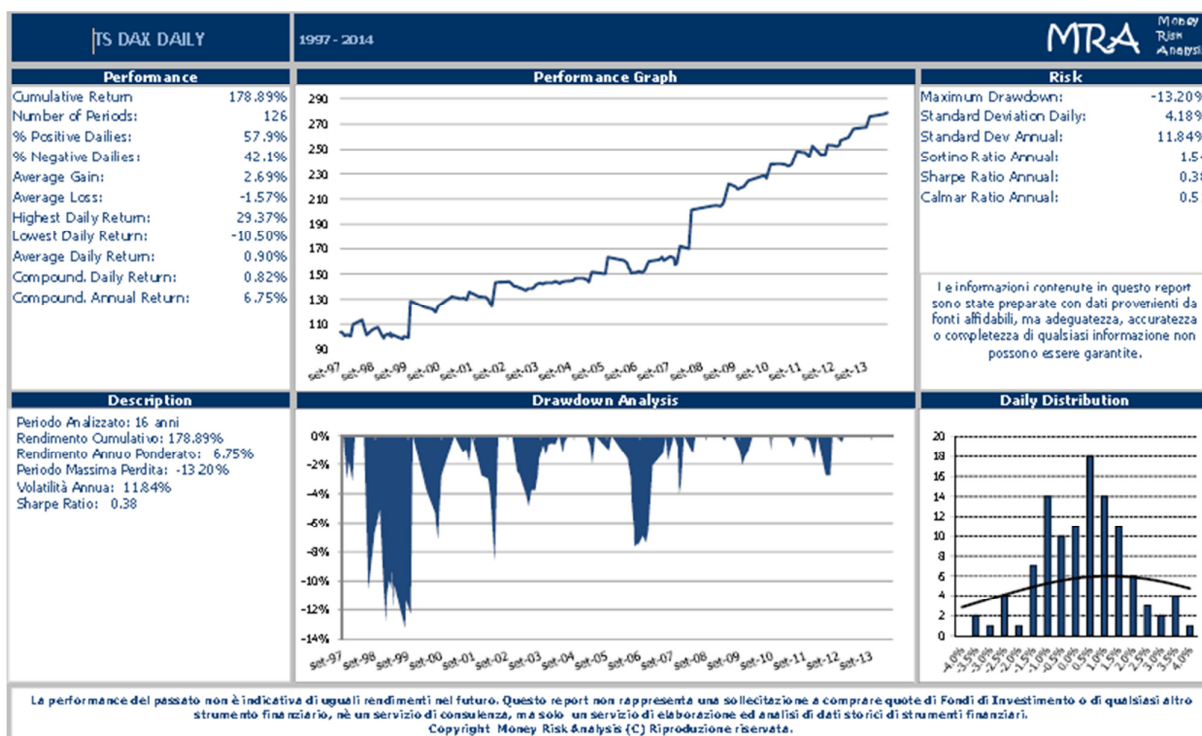


TRADING SYSTEM BUND2 (CAPITALE PARTENZA 100 MILA EURO)



Qui sotto invece viene riportato il TS DAX DAILY sempre sullo stesso principio del DAX1

TRADING SYSTEM DAILY (CAPITALE PARTENZA 200 MILA EURO)



Riassumendo il TS 1 sia su Bund che su Dax, mediamente sta per il 75% del tempo sul mercato, mentre per il TS 2 questa percentuale scende al 25%. Questo per capire la tempistica di azione.

NOVITA'

Da questa settimana abbiamo attivato la chat sul sito al fine di essere sempre più vicini a voi

Buon lavoro a tutti e sempre a vostra disposizione.

La performance del passato non è indicativa di uguali rendimenti nel futuro. Questo report non rappresenta una sollecitazione a comprare quote di Fondi di Investimento o di qualsiasi altro strumento finanziario, né un servizio di consulenza, ma solo un servizio di elaborazione ed analisi di dati storici di strumenti finanziari.

Copyright Money Risk Analysis © Riproduzione riservata