

Les indicateurs mathématiques

Relative Strength Index (RSI)

Cet indicateur détermine des zones de "surachat" ou de "survente" pour un actif, il oscille dans un intervalle compris entre 0 et 100. Généralement un RSI supérieur à 70 signifie qu'un actif est considéré comme suracheté et surévalué, le prix risque donc de chuter par la suite alors qu'un RSI inférieur à 30 peut indiquer une survente et un actif sous-évalué, dans l'image ci-dessous, la courbe du RSI est en bleu, la zone 30-70 est en violet.



Les divergences au niveau du RSI prennent place lorsque son mouvement est inverse à celui du cours, les divergences "bearish" indique que le RSI est en tendance baissière (sommet de plus en plus bas et creux de plus en plus profond) alors que le prix continu de monter, une divergence "bullish" est son opposé, le RSI est en tendance haussière (sommet de plus en plus haut et creux de moins en moins bas) alors que le cours baisse. Une divergence "bearish" peut indiquer une baisse de prix à venir, alors qu'une divergence "bullish" est plutôt annonciatrice d'une augmentation.

Moving Average (MA)

Les moyennes mobiles fournissent le cours moyen d'un actif sur une période donnée, elles sont dites mobiles car elles sont réactualisées à chaque fin de période, il y a différents types de MA dont l'Exponential Moving Average (EMA) et la Simple Moving Average (SMA), ci-dessous on peut voir la EMA 20 en bleu représentant la moyenne exponentielle sur 20 jours.



Moving Average Convergence Divergence (MACD)

MACD signifie "Moving Average Convergence Divergence", ce qui veut dire en français, Convergence et Divergence de Moyennes Mobiles. Le MACD est un indicateur technique, résultant de la différence entre deux moyennes mobiles exponentielles (EMA) de périodes différentes. En rouge, on voit la ligne de signal (9-day EMA of MACD Line) et en bleu la ligne de MACD (12day EMA - 26day EMA).



On peut observer les mêmes divergences (bearish et bullish) que sur le RSI cité précédemment.

Si le MACD passe sous la courbe de signal, c'est un indicateur baissier ("cross bearish"), à l'inverse s'il remonte au-dessus, c'est plutôt haussier ("cross bullish").

Bollinger (BB)

Les Bandes Bollinger sont matérialisées par deux lignes situées à la fois au-dessus et en-dessous d'une moyenne mobile centrale, englobant ainsi le prix.

Les BB représentent la volatilité d'un marché, au plus elles sont écartées au plus le marché est volatil.

Un resserrement des BB précède souvent une période de forte volatilité, à la baisse comme à la hausse.



Ichimoku Kinko Hyo (Ichimoku)



Kijun-sen

Calcul de Kijun-Sen : $(\text{plus haut} + \text{plus bas})/2$ sur les 26 dernières périodes.

C'est une ligne de confirmation et une ligne de support/résistance, qui peut être utilisée comme un trailing stop. Kijun Sen agit comme un indicateur du futur mouvement du prix. Si le prix est plus haut que la courbe bleue, il pourrait continuer à grimper plus haut. Si le prix est en-dessous la courbe bleue, il pourrait continuer à baisser.

Tenkan-Sen

Calcul de Tenkan-Sen: $(\text{plus haut} + \text{plus bas})/2$ sur les 9 dernières périodes.

Il est essentiellement utilisé comme une courbe de signal et une ligne de support/résistance mineure. Tenkan-Sen est un indicateur de la tendance du marché. Si la courbe rouge est orientée vers le haut ou vers le bas, cela signifie que le marché est en tendance. Si elle est horizontale, elle indique que le marché est en range.

Si le prix est au-dessus Senkou Span, la courbe supérieure sert de premier support, tandis que la courbe inférieure sert de deuxième support.

Si le prix est en-dessous Senkou Span, la courbe inférieure sert de première résistance, tandis que la courbe supérieure sert de deuxième résistance.

Kumo

Le Kumo (nuage) est l'espace entre le Senkou Span A et le Senkou Span B. Les contours du Kumo identifient les niveaux de support et résistance actuels, et potentiellement futurs.

La forme et la grosseur du Kumo changent selon les fluctuations du prix. Cette grosseur représente la volatilité : de plus grands mouvements du prix forment un plus gros nuage, ce qui crée des supports et résistances plus forts.

Un nuage plus mince n'offre que de faibles supports et résistances, et le prix peut plus facilement casser de tels nuages.

En général, les marchés sont haussiers quand Senkou Span A est au-dessus Senkou Span B et vice-versa pour les marchés baissiers. Les traders regardent souvent les changements de Kumo,

lorsque Senkou Span A et B échangent leurs positions, comme un signal d'un potentiel renversement de tendance.

En plus de sa grosseur, la force du Kumo peut aussi être déterminée par son angle, ascendant pour un marché haussier et descendant pour un marché baissier.

Chikou Span

Calcul de Chikou Span : prix de clôture du jour projeté 26 jours en arrière sur le graphique.

Egalement appelé “lagging span”, il est utilisé comme une aide à la détermination de supports/résistances.

Si Chikou Span traverse le prix du bas vers le haut, c'est un signal d'achat. S'il le traverse du haut vers le bas, c'est un signal de vente.