

Programme investissement à moyen terme

PAR MARIO LAMOUREUX

GROUPE CYBERCOURS INC / BOURSE101.COM ET BOURSE101.FR

TOUT DROIT RÉSERVÉ – REPRODUCTION ET DISTRIBUTION INTERDITE



Un peu d'histoire

Achat de Dow Jones

GICS par MSCI

10 Secteur

- Groupe d'industrie
 - Industrie
 - Sous-industrie

10 Secteurs

Énergies

Energy #10

Matériaux

Materials #15

Industriels

Industrials #20

Consommations discrétionnaires

Consumer Discretionary #25

Consommation de base

Consumer Staples #30

Santé

Health Care #35

Finance

Financials #40

Technologie

Information Technology #45

Télécommunication

Telecommunication Services #50

Service public

Utilities # 55

Énergies TTEN -

Grande entreprise « Oil and Gaz »

Recherche

Raffinerie

Transport

Équipement au compagnie d'énergie

Oui, pétrole, Gaz... Charbon...

Autres produits producteurs d'énergies...Uranium

Matériaux

Chimique incluant fertilisant

Matériaux de construction

Emballage

Mines et métaux (aluminium, or, métaux précieux)

Papier et forêt

Industriels

Aérospatial et défense

Matériaux construction

Ingénierie et firme de construction

Électricité

Conglomérat

Imprimerie

Services professionnel (sécurité, maintenance, nettoyage, paye, consultant, architecture)(exclus technologie)

Transport (Train, bateau, avion, infrastructure)



Consommation discrétionnaire

Automobile (Pièce d'auto)

Bien durable (Frigidaire, tapis, rideau, outils)

Constructeur résidentiel (préfab)

Loisir (Ski, soulier de course, textile)

Hôtel et restaurant (casino, croisière)

École spécialiser

Média (publicité, câble, poste de TV, producteur de film, éditeur)

Magasin (distributeur, internet, magasin général, rénovation, spécialisé, station essence, pièce d'auto, concessionnaire auto)

Consommation base

Pharmacie et Épicerie

Producteur de nourriture (brasserie, liqueur, produits agricole, viande, tabac)

Produits personnel (non durable) (Papier mouchoir, maquillage, savon, couche, parfum)

Santé

Équipement (instrument)

Hôpital, résidence personne âgée et vétérinaire

Technologie pour la santé

Pharmaceutique

Services

Finance

Banque

Carte de crédit

Assurance

Courtier en action, « investment banking », Bourse

Fonds mutuel

Financement hypothécaire, financement à court terme, prêt sur gage

Agence crédit

Investissement immobilier

Technologie

Logiciel

Data processing (cloud)

Jeux

Équipement de communication

Consultant

Pièce électronique (écran ordinateur, disque rigide, caisse)

Distributeur de technologie

Semi-conducteur et « chip »

Télécommunication

Grand réseau téléphonique

Cellulaire

Alternatif



Service public

Électricité

Gaz

Eau



Moyenne mobile simple

$J_2 + J_3 + J_4 + J_5 + \dots + J_{11}$

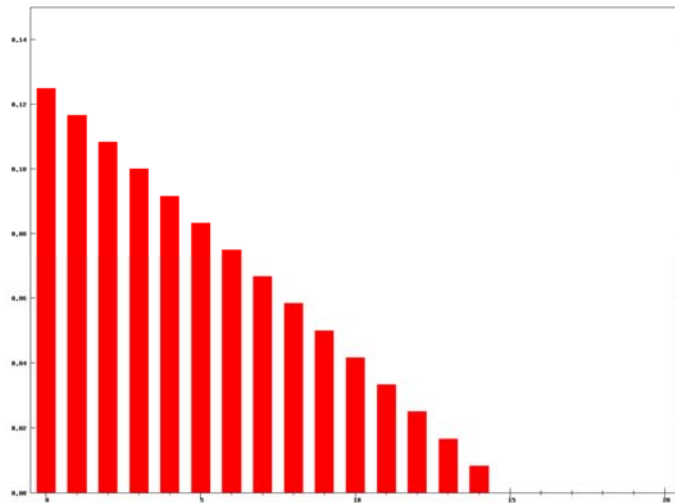
Nombre de jours

Moyenne simple ou arithmétique

$$\frac{\text{Prix} + \text{prix}(-1) + \text{prix}(-2) + \text{prix}(-3) + \dots}{n}$$

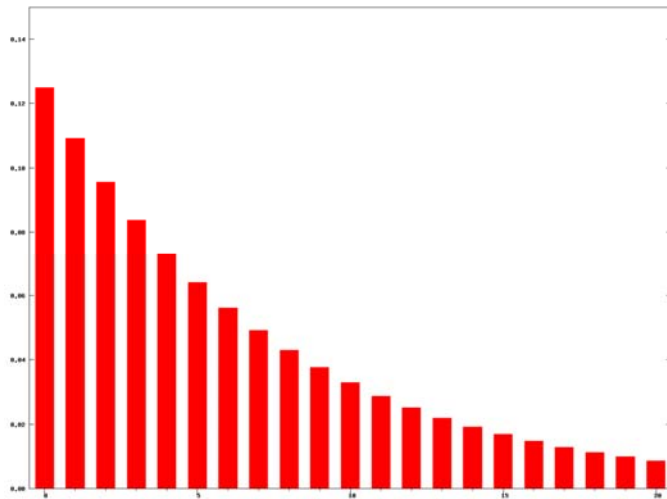
Moyenne mobile pondérée

$$M_p = \frac{P \cdot n + (P(-1) \cdot (n-1)) + (P(-2) \cdot (n-2)) + (P(-3) \cdot (n-3)) + \dots}{(n + n-1 + n-2 + n-3 + \dots)}$$



Moyenne mobile exponentielle

$$Me = Me(\text{hier}) + (2/n+1 * (\text{Prix} - Me(\text{hier})))$$



Direction marché

Quelles situations à court terme de marché sont acceptables pour un achat? Ceci dépend du marché à moyen terme.

MOYEN TERME

Haussier (vert)

Creux (bleu)

Sommet (Jaune)

Baissier (rouge)

COURT TERME

h1, h2, h3, S, b1, b2, b3 et c

Achat en b3, c et h1 (h2*)

Achat en c* et h1

Achat en c et h1

* à éviter pour les débutants

Direction marché

Quelles situations à court terme de marché sont acceptables pour un achat? Ceci dépend du marché à moyen terme. Utilisation de 5 moyennes mobiles exponentiels (3-10-20-40-80*) pour connaître le % investie à moyen terme.

MOYEN TERME

100% 4 mm (vert)

75% 3 mm (bleu)

50% 2 mm (jaune)

25% 1 mm (orange)

0% 0 mm (rouge)

COURT TERME

Achat en b3, c et h1

Achat en b3, c et h1

Achat en c et h1

Achat en c et h1

* La moyenne de 80 pourrait être pondérée (waited) pour être plus rapide. S'il y trop de signaux a votre goût, augmenter les moyennes, par exemple 7-20-40-80-200