

AIDE MÉMOIRE - MACD



Groupe CyberCours inc.

Tout droit réservé - Reproduction et distribution interdite

Ce cahier ce veut un aide-mémoire pour les étudiant du programme de formation.

Bourse101 est un site de formation vidéo. En aucun temps ce cahier devrait être considéré comme suffisant pour constituer un cours.

Groupe CyberCours inc – Créateur de Bourse101.com

Moving Average Converge Divergence (MACD), Optimisateur des moyennes mobiles

Objectif

Accélérer le signal de deux moyennes mobiles: Le croisement des moyennes mobiles est par définition un système qui est en retard sur les creux des sommets. Le MACD anticipe le croisement des moyennes mobiles et produit un signal quelques jours avant ce croisement.

Formule mathématique

Développé par Gerald Appel, le calcul du MACD est effectué en soustrayant la différence entre deux moyennes mobiles. Cette différence est par la suite tracée sur un graphique. Finalement, une moyenne mobile est tracée sur cette différence.

Il s'agit de moyenne mobile exponentielle.

Période

L'auteur à utiliser des moyennes mobiles de 12 jours et de 26 séjours. Il a utilisé une moyenne à neuf jours pour la moyenne sur la différence. MACD12-26-9

Aspect visuel

Pour tracer le MACD, nous avons besoin d'une ligne de zéro. Lorsque la moyenne mobile courte sera au-dessus de la longue (position d'achat), alors la différence entre les deux moyennes sera tracée positivement au-dessus de la ligne zéro.

Lorsque la moyenne mobile courte sera au-dessous de la moyenne mobile longue (position de vente) alors la différence tracée sera négative.

À l'évidence lorsque les moyennes croissent le MACD elle sera de 0.

Puisque l'échelle du MACD est la différence entre deux moyennes, il n'y a pas de maximum ou de minimum au MACD. Le concept de survendu/suracheté ou trop haut/trop bas n'est pas applicable sur le MACD.

Variations des paramètres

Le MACD est composé de trois chiffres. Les deux premiers représentent les deux moyennes mobiles. Normalement, il y a une courte et une longue. 12-26 selon l'auteur. Nous vous invitons à modifier ces paramètres pour les adapter à vos deux moyennes mobiles préférées.

Plus les moyennes mobiles seront courtes plus le signal sera rapide, mais plus le nombre de signaux inutiles sera important.

Plus les moyennes mobiles seront longues, plus le signal sera lent, mais plus le signal sera efficace.

Le troisième chiffre représente la moyenne à appliquer sur le calcul (moyenne courte moins moyenne longue). Plus le troisième chiffre sera petit plus la moyenne du MACD sera près.

Interprétation simpliste

Lorsque le MACD croise sa ligne de signal à la hausse, nous avons le signal d'achat. Lorsque le MACD croise sa ligne signal à la baisse, nous avons signal de vente.

Originellement destiné pour les investisseurs à long terme, le MACD peut être utilisé dans tous les termes d'investissement avec des résultats acceptables. Toutefois, puisqu'il est dérivé des moyennes mobiles il sera plus efficace sur des titres qui peuvent maintenir une tendance pendant plusieurs périodes. Il sera très vulnérable dans les mouvements neutres.

Notre avantage

Signal plus rapide que celui des moyennes mobiles.

Facile d'interprétation.

Utilisable en tout temps.

Stratégie 1 : Programme pour investisseur à moyen terme, croisement des lignes du MACD, méthode classique.

La méthode enseignée dans le programme pour investisseur à moyen terme contient une lacune pour les titres en hausse spectaculaire. Puisque les moyennes mobiles seront trop lentes dans ce cas.

Dans cette stratégie le MACD il doit être utilisé uniquement sur des titres en ascension spectaculaire (par exemple: un titre a doublé rapidement) Nous utiliserons le MACD comme signal de vente pour vendre une partie ou la totalité de la position.

Paramètre : Utiliser les mêmes paramètres que vos moyennes mobiles. Donc, si vos moyennes sont 10 et 40, utiliser un MACD 10-40-10.

Stratégie 2 : Programme pour investisseur à moyen terme, remplacement de la moyenne à 200 jours pour un MACD pour avoir une stratégie à long terme plus efficace.

Pour les amateurs de la moyenne mobile à 200 jours qui désire obtenir la direction à long terme d'un titre ou d'un indice, nous suggérons le remplacement de la moyenne à 200 jours par un MACD 40-200-15.

Les signaux seront plus près des creux et des sommets.

Voir le programme à moyen terme.

Stratégie 3 : Programme pour investisseur à court terme, utilisation du MACD pour un swing trader. Idéal pour celui qui veut confirmer un signal technique classique. (Bris de résistance)

Le MACD produira un signal en même temps (ou presque) qu'un signal classique. Il l'accompagne donc très bien.

Ceci s'inscrit bien dans une stratégie de type : « Tendence haussière, en correction et qui retourne à la hausse maintenant »

La « tendance haussière » sera validée visuellement (les derniers creux sont à la hausse)

« en correction » sera validé par la correction du MACD

« qui retourne à la hausse maintenant » sera validé par le croisement du MACD et du bris de résistance

Le principal avantage de ce système est que si un titre « retourne à la hausse maintenant », il crée un creux à très court terme. Donc nous avons un point de support bien défini et un point de sortie en cas de perte.

Le principal désavantage est que ce support est parfois trop loin par rapport au gain potentiel. Bien évaluer votre ratio risque rendement.

Utiliser une période plus courte pour le paramètre de MACD, par exemple : 5-20-7

Stratégie 4 : Programme pour investisseur à moyen terme, utilisation du MACD sur un graphique en 1 minute (intraday) sur des titres qui ont ou qui devrait connaître une grande variation à l'ouverture

Cette stratégie est particulièrement valide si vous anticipé une fluctuation importante du prix de l'action dans les premières minutes de transaction de la journée.

Démarrer avec des périodes de 5-15-5 ou 5-20-5 (modifier selon votre style)

Il y a trois cas où le MACD sera particulièrement efficace.

4-1 : MACD comme signal de vente vers 10h pour un achat effectué à l'ouverture

4-2 : MACD comme signal d'achat vers 10h pour un titre qui a réagi fortement à la hausse dans les premières minutes, puis a corrigé. Acheter sur le signal du MACD

4-3 : MACD comme signal d'achat vers 10h pour un titre qui eu un GAP important à l'ouverture, puis a corrigé. Acheter sur le signal du MACD

Dans les cas 4-2 et 4-3 vendre si :

Après l'achat, si le titre poursuit à la hausse vendre sur le signal du MACD

Après l'achat, si le titre reprend à la baisse, le titre devrait couper le support à court terme et avoir rapidement un signal de vente. Vendre dans un cas comme dans l'autre.

Après l'achat, si le titre ne bouge plus, vendre, car le MACD n'est pas efficace en mouvement neutre.