

Oscillateurs Forex

Le nom d'oscillateur se dérive du mot latin "oscillo", ce qui signifie "Je balance". Dans l'analyse technique, l'oscillateur est une expression mathématique, mesurant la vitesse et la force des mouvements de cours. Par leurs formes, les oscillateurs sont les indicateurs avancés.

Les concepts principaux des oscillateurs utilisés sont les conditions de Forex surachetées et survendues. Le marché est considéré comme survendu, quand le prix est à un prix limite supérieur et lorsque sa nouvelle amélioration est peu probable. La zone survendue est caractérisée par une faible volatilité des prix, qu'à un moment donné le nouveau recul est peu probable. Cependant, l'analyse et l'utilisation des oscillateurs sont tous mieux présentés sur l'état stable du marché, au temps de renversement de tendance, déterminé par son aide.

Pour identifier le renversement de tendance, il est nécessaire de comprendre les concepts de convergence et divergence de l'oscillateur courbe avec la direction des mouvements de prix.



Indicateur Average True Range (ATR)

L'ATR Average True Range (ATR) l'indicateur a été introduit par Welles Wilder comme un outil pour mesurer la volatilité du marché et la volatilité seule en laissant de côté les tentatives pour indiquer la direction. Contrairement à l'indicateur "Average True Range", l'ATR comprend également la volatilité des ruptures et des limites. L'indicateur ATR est très bon en valorisant l'intérêt du marché dans les mouvements de prix pour des mouvements forts et pour les évasions qui sont normalement accompagnées par de grandes plages.



CALCUL DE "AVERAGE TRUE RANGE"

Average True Range est une moyenne mobile de "True Range", qui est la plus grande des trois valeurs suivantes:

- La distance à partir d'aujourd'hui le plus haut à plus bas d'aujourd'hui.
- La distance de la clôture d'hier à aujourd'hui le plus haut.
- La distance de la clôture d'hier à aujourd'hui bas.

Bandes de Bollinger

OBJET

L'indicateur des Bandes de Bollinger (au nom de son inventeur) affiche les changements de la volatilité du marché actuel, confirmant la direction, mettant en garde contre l'éventuelle poursuite ou la tendance à la baisse, les périodes de consolidation, la volatilité croissante de la baisse, ainsi que mettant en évidence les sommets locaux et des bas.

USAGE

L'indicateur est composé de trois moyennes mobiles:

- **Bande supérieure** - 20 jours de la moyenne mobile simple (SMA), ainsi que le prix de déviation doublement standard.
- **Bande moyenne** - 20-jours de SMA.
- **Bande inférieure** - 20-jours de SMA exclut le prix de déviation doublement standard.

La distance croissante entre les bandes supérieures et les bandes inférieures, lors de la croissance de la volatilité, suggère un prix de développement dans une tendance dont la direction est en corrélation avec la direction de la ligne médiane. Par revanche, pendant la période de volatilité décroissante, lorsque les bandes se ferment, nous devrions attendre le prix de se déplaçant latéralement dans une gamme.

Le prix se déplaçant en dehors des bandes peut indiquer soit la continuation de la tendance (lorsque les bandes sont flottantes à part comme la volatilité augmente) soit la demi-tour de la tendance si le mouvement initial est épuisé. De toute façon chacun des scénarios doit être confirmé par d'autres indicateurs tels que RSI, ADX ou MACD.

De toute façon, le passage du prix croissant de la ligne médiane du dessous ou au-dessus, peut être interprété comme un signal d'achat ou de vente, respectivement.



CALCUL DE "BANDES DE BOLLINGER"

La ligne médiane (ML) est une moyenne mobile régulière:

$$ML = \text{SUM} [\text{CLOSE}, N]/N$$

La ligne supérieure (L) est ML possède un écart (D) supérieur:

$$TL = ML + (D * \text{StdDev})$$

La ligne de fond (BL) est ML possède un écart (D) inférieure.

$$BL = ML - (D * \text{StdDev})$$

Où:

N — quantité des périodes utilisées dans le calcul;

SMA — Moyenne mobile simple;

StdDev — Déviation Standard.

Commodity Channel Index - Indicateur CCI

OBJET

L'indicateur "Commodity Channel Index" est un indicateur proposé par Donald Lambert. Malgré l'objectif initial d'identifier les nouvelles tendances, il est aujourd'hui largement utilisé pour mesurer les niveaux de prix actuels par rapport à une moyenne.

USAGE

Commodity Channel Index est un indicateur oscille autour du seuil de zéro qui tend à rester dans la gamme de -100 à 100. La ligne zéro représente le niveau d'un prix d'équilibre moyen. De plus, l'indicateur surgit au-dessus de la ligne de zéro plus surévalué de la sécurité. La poursuite de l'indicateur CCI plonge dans la zone négative, le plus grand potentiel de croissance du prix.

Toujours le seul prix déséquilibrée peut ne pas servir d'indicateur clair ni à la direction du prix suit, ni à sa force. Il y a des valeurs critiques et les directions de passage qui doivent être examinées à proximité:

- *Dépassement du passé sur le niveau 100 suggère un éventuel mouvement supplémentaire vers le haut*
- *La diminution au-delà du niveau 100 indique un demi-tour comme un signal de vente.*
- *Diminution du passé sur le niveau -100 suggère une éventuelle poursuite du mouvement vers le bas*
- *Dépassement du passé sur le niveau -100 indique un demi-tour et sert comme un signal d'achat.*
- *Franchir la ligne cochonne de bas en haut comme une confirmation à acheter*

Franchir la ligne cochonne de haut en bas comme une confirmation à vendre.

Diminuez la période de l'indicateur de CCI qui augmente sa sensibilité. Le passage des niveaux critiques à 200 permet d'exclure les fluctuations des prix insignifiants.



CCI STRATÉGIE DE TRADING

La stratégie de Trading CCI est utilisée par la plupart des traders, des investisseurs et des chartistes comme un oscillateur de surachat ou de survente. La stratégie de base du CCI est de regarder les lectures au-dessus et au-dessous 100- 100+. Les lectures au-dessus 100+ sont considérées comme suracheté et génèrent des signaux d'achat. Les lectures inférieures à 100- sont considérées comme survendu et génèrent des signaux de vente. Bien que l'indicateur "Commodity Channel Index" a été initialement développé pour les matières premières, il est également utilisé pour les contrats à terme et options sur indices, actions.

Indicateur DeMarker

OBJET

Cet indicateur a été présenté par Tom DeMark comme un outil pour identifier les nouvelles opportunités d'achats et de ventes. Il démontre les phases de diminution des prix qui correspondent généralement avec les hauts et les bas des prix.

L'indicateur DeMarker a présenté son efficacité pour identifier les tendances de baisse, ainsi que le repérage des points d'entrée et de sortie.

USAGE

L'indicateur fluctue dans une gamme entre 0 et 1 et est indicative de la volatilité plus faible et une éventuelle baisse des prix lors de la lecture de 0,7 et plus, en présentant comme un signal de l'augmentation éventuelle des prix lors de la lecture en dessous de 0,3.



CALCUL DE "DEMARKER" (DEM)

L'indicateur DeMarker est la somme de toutes les valeurs d'incrément de prix enregistrées au cours de la période "i" divisé par le prix minimum:

DeMax(i) est calculé:

Si à la hausse(i) > haut(i-1) , donc DeMax(i) = haut(i)-haut(i-1), autrement DeMax(i) = 0

DeMin(i) est calculé:

Si à la baisse(i) < bas(i-1), donc DeMin(i) = bas (i-1)-bas (i), autrement DeMin(i) = 0

La valeur de DeMarker est calculée comme:

$$DMark(i) = \text{SMA}(\text{DeMax}, N) / (\text{SMA}(\text{DeMax}, N) + \text{SMA}(\text{DeMin}, N))$$

Où:

SMA - Moyenne mobile simple ;

N - quantité des périodes utilisées dans le calcul.

Indicateur Enveloppe

OBJET

L'indicateur des enveloppes reflète les conditions des prix de surachat et de survente, aidant à identifier les points d'entrée ou de sortie, ainsi que les tendances possibles.

USAGE

L'indicateur Enveloppes comprend deux SMA's formant ensemble un flexible Canal dans lequel le prix s'évolue. Les moyennes sont tracées autour d'une moyenne mobile à une distance de pourcentage, constant qui peut être ajustée en fonction de la volatilité actuelle du marché. Chaque ligne sert de marge de la plage de fluctuation des prix.

Dans le marché de tendance, on ne tient en compte que les signaux de survente dans les conditions de tendance haussière et des signaux de surachat dans des conditions de la tendance baissière.

Dans le marché, le prix va atteindre la ligne supérieure comme un signal de vente, alors que le prix à la ligne inférieure génère un signal d'achat.



CALCUL DE "ENVELOPPES"

Bande supérieure = $SMA(\text{Fermé}, N) * [1 + K/1000]$

Bande inférieure = $SMA(\text{Fermé}, N) * [1 - K/1000]$

Où:

SMA — Moyenne Mobile Simple;

N — Période moyenne;

K/1000 — la valeur de décalage de la moyenne (mesurée en points de base).

Indicateur Force Index

OBJET

L'indicateur de l'Indice de Force inventé par Alexander Elder mesure la puissance derrière de chaque mouvement de prix en fonction de leurs trois éléments essentiels, par exemple, la direction, l'extension et le volume. L'oscillateur fluctue autour du zéro, un point d'équilibre relatif entre les quarts de puissance.

USAGE

L'indice de Force permet d'identifier le renforcement des tendances à l'échelle de temps différente:

- *L'indicateur devrait être plus sensible en diminuant sa période de tendances à court temps.*
- *L'indicateur doit être lissée en augmentant sa durée de plus longues tendances.*
- *L'indice de Force peut impliquer fortement un changement de tendance:*
- *La baisse d'une tendance haussière lorsque la valeur de l'indicateur change de positif à négatif et le prix et l'indicateur montrent une divergence.*
- *La hausse d'une tendance à la baisse lorsque la valeur de l'indicateur change du négatif au positif et le prix et l'indicateur montrent la convergence.*
- *Avec l'indicateur de suivi de tendance de l'indice de travail peut aider à identifier les corrections de tendance:*
- *Une correction de la tendance haussière lorsque l'indicateur rebondit sur le bas.*
- *Une correction de la tendance baissière lorsque l'indicateur diapositives à partir d'un brochet.*



CALCUL DE "FORCE INDEX"

Indice de Force (1) = {fermé (période actuelle) - Fermé (période précédente)} x Volume

Indice de Force (13) = 13-période EMA de l'indice de Force (1)

Indicateur Ichimoku

OBJET

L'indicateur de Ichimoku Kinko Hyo (Tableau d'équilibre immédiat) est une Analyse technique comprehensive, un outil introduit en 1968 par un chroniqueur de Tokyo, Goichi Hosoda. Le concept du système était de fournir une vision immédiate de la tendance de sentiment, l'élan et la force à un coup d'oeil percevant les cinq composantes de l'Ichimoku et un prix en termes d'interactions entre eux d'un type cyclique liée à celle de la dynamique de groupe dynamiques.

USAGE

L'Indicateur Ichimoku indicateur se compose de cinq lignes qui peuvent tous servir aussi flexiblement comme les lignes du support ou de la résistance, dont les croisements peuvent aussi bien être assumées en tant que des signaux supplémentaires:

1. Tenkan-Sen (Ligne de conversion, bleu)
2. Kijun-Sen (Ligne de base, rouge)
3. Senkou Span A (Période principale A, frontière verte du nuage)
4. Senkou Span B (Période principale B, frontière rouge du nuage)
5. Chikou Span (Période en retard, verte)

Kumo (Nuage) est un élément central du système Ichimoku et représente des zones du support ou de la résistance. Il est formé par les Périodes Principales A et B.

La détermination de la persistance des tendances et corrections::

- Période principale A sert de ligne première de support pour une tendance haussière
- Période principale B sert de ligne seconde de support pour une tendance haussière
- Période principale A sert de ligne première de résistance pour une tendance à la baisse
- Période principale B sert de ligne seconde de résistance pour une tendance à la baisse

Signaux moins fiables d'achat/de vente qui se produisent dans le nuage:



CALCUL DE "ICHIMOKU"

- **Tenkan-Sen (Conversion ligne, bleue)** est $(9\text{-période haussière} + 9\text{-période baissière})/2$
- **Kijun-Sen (ligne de base, rouge)** est $(26\text{-période haussière} + 26\text{-période baissière})/2$
- **Senkou Span A (période principale A, frontière verte du nuage)** est $(\text{Conversion} + \text{Ligne de Base})/2$
- **Senkou Span B (période principale B, frontière rouge du nuage)** est $(52\text{-période haussière} + 52\text{-période baissière})/2$
- **Chikou Span (période précédenté, verte)** est un prix proche de 26 les périodes dans le passé.

Indicateur MACD - Convergence et Divergence des Moyennes Mobiles

OBJET

MACD est un Oscillateur, généralement appelé comme indicateur MACD, est développé par Gerald Appel qui est conçu de révéler les changements dans la direction et la force de la tendance par des signaux combinant les trois séries chronologiques de courbes moyennes mobiles.

USAGE

Les trois signaux de principaux générés par l'indicateur MACD (ligne bleue) sont les croisements avec la ligne de signal (ligne rouge), avec les motifs d'axe X et le modèle de divergence.

Croisement avec la ligne de signal:

- Si la ligne MACD augmente plus vite que la ligne de signal et la traverse vers le bas, le signal est interprété comme une tendance haussière et suggère une accélération de la croissance des prix;
- Si la ligne MACD diminue plus rapidement que la ligne de signal et la traverse vers le haut, le signal est interprété comme une tendance baissière et suggère l'extension des pertes de prix;

Croisements avec l'axe x:

- Un signal haussier apparaît si la ligne MACD monte au dessus de zéro;
- Un signal baissier présente si la ligne MACD tombe en dessous de zéro.

Convergence/Divergence:

- Si la ligne MACD est une tendance dans le même sens que le prix, le modèle est connu comme la convergence, ce qui confirme le mouvement de prix;
- S'ils se déplacent dans les directions opposées, la tendance est la divergence. Par exemple, si le prix atteint au nouveau sommet, mais l'indicateur ne fonctionne pas, cela peut être un signe de faiblesse supplémentaire.



CALCUL DE "CONVERGENCE ET DIVERGENCE DES MOYENNES MOBILES" (MACD)

MACD ligne = 12-période EMA – 26-période EMA

Ligne de signal = 9-période EMA

Histogramme = Ligne MACD - ligne de signal

Indicateur Momentum

OBJET

L'Oscillateur Momentum est un indicateur qui indique la direction des tendances et des mesures et la rapidité avec laquelle le prix change, en comparant les prix actuels et passés.

USAGE

L'indicateur est représenté par une ligne, qui fluctue autour de 100. Comme un oscillateur, le Momentum doit être utilisé dans le prix de la tendance de l'analyse.

Traversée de l'axe x:

- *On croit que si l'indicateur grimpe au-dessus de 100 au cours d'une tendance haussière, il est un signal haussier;*
- *Par contre, si l'indicateur tombe en dessous de 100 au cours d'une tendance à la baisse, un signal baissier apparaît.*

Tomber sur sa gamme normale:

- *Points extrêmes signifient que le prix a affiché sa hausse plus forte ou la perte d'un nombre déterminé de périodes mobiles, en soutenant la force de la tendance;*
- *Dans le même temps, si le mouvement des prix était trop rapide, il peut indiquer des zones de surachat et de survente possibles.*

Modèles de Divergence:

- *Si le prix atteint un nouveau sommet, mais l'indicateur ne fonctionne pas, cela pourrait signifier que le sentiment de l'investisseur est réellement en bas;*
- *Et au contraire, si le prix tombe à un nouveau plus bas, mais l'indicateur ne prend pas en charge la baisse, il est un signal que la tendance peut se terminer bientôt.*



CALCUL DE "MOMENTUM"

Momentum = (Prix actuel proche / Prix proche retardé) x 100

Relative Vigor Index - Indicateur RVI

OBJET

L'indicateur RVI, développé par John Ehlers, est un indicateur technique conçu pour déterminer le prix de direction de la tendance. La logique sous-jacente est basée sur l'hypothèse que les prix proches ont la tendance à être plus élevés que les prix ouverts dans un environnement haussier et plus faible dans un environnement baissier.

USAGE

Le RVI permet d'identifier le renforcement des changements de prix (et donc peut être utilisé dans l'analyse des modèles de convergence/divergence):

- En général, plus les sommets d'indicateurs augmentent, plus fort est l'augmentation actuelle des prix relatifs baissent;
- En général, plus l'indicateur tombe, la baisse actuelle des prix relatifs est la plus forte.

Avec l'ensemble de sa ligne de signal (Rouge), la 4-ème période de moyenne de mobile de RVI, l'indicateur (Vert) peut aider à identifier les changements dans l'évolution des prix en vigueur:

- Passage de la ligne de signal d'en haut, le RVI signale a une éventuelle opportunité de vente;
- Passage de la ligne de signal d'en bas, le RVI signale a une éventuelle opportunité d'achat.



CALCUL DE "RELATIVE VIGOR INDEX" (RVI)

$RVI(1) = (\text{Fermer} - \text{Ouvrir}) / (\text{Haut} - \text{Bas})$

$RVI(10) = 10\text{-période SMA de } RVI(1)$

Relative Strength Index - Indicateur RSI

OBJET

RSI est un indicateur développé par Welles Wilder pour évaluer la force ou la faiblesse des mouvements de prix actuels et de mesurer la vitesse des changements de prix en comparant les augmentations de prix avec ses pertes dans une certaine période.

USAGE

Le RSI permet d'identifier les zones de surachat et de survente possibles, mais devrait être considérée dans l'analyse des tendances:

- En général, si l'indicateur RSI grimpe au-dessus de 70, l'actif peut être suracheté;
- Si l'indicateur RSI tombe en dessous de 30, l'actif peut être survendu.

Laissant les zones extrêmes, l'indicateur peut suggérer des corrections possibles ou même des changements de tendance:

- Traverser la frontière surachat d'en haut, le RSI signale une éventuelle opportunité de vente;
- Franchir la limite de survente d'en bas, le RSI signale une éventuelle opportunité d'achat.

Modèles de Convergence/divergence peuvent indiquer la faiblesse possible de la tendance:

- Si le prix grimpe à un nouveau sommet, mais l'indicateur n'a pas ce niveau, cela peut être un signe de la faiblesse tendance haussière;
- Si le prix tombe à un nouveau plus bas, mais l'indicateur ne fonctionne pas, cela peut être un signe de la faiblesse de la tendance baissière.



CALCUL DE "RELATIVE STRENGTH INDEX" (RSI)

$$RSI = 100 - 100 / (1 + RS)$$

$$RS (14) = \Sigma(\text{Mouvements haussiers}) / \Sigma(|\text{Mouvements baissiers}|)$$

Oscillateur Stochastique

OBJET

L'indicateur Stochastique est introduit par George Lane pour identifier la direction de la tendance des prix et des points de retournement possibles en déterminant la place du cours de clôture de courant dans la plus récente gamme de prix, comme dans une tendance haussière durable des prix proches ont tendance à l'extrémité supérieure de la plage et à l'extrémité inférieure dans une tendance baissière.

USAGE

L'oscillateur Stochastique permet d'identifier les zones possibles de surachat et de survente, mais doit être examinée dans l'analyse de tendance :

- En général, si l'indicateur grimpe au-dessus de 75, l'actif peut être suracheté;
- Si l'indicateur est inférieur de 25, l'actif peut être survendu.

L'absence des zones extrêmes de l'indicateur peut suggérer des points de retournement possibles:

- Traversé de la frontière de surachat au dessus, le signal de Stochastique a une éventuelle opportunité de vente;
- Croisement de la limite de survente en bas, le signal de Stochastique a une éventuelle opportunité d'achat.

Les croisements de l'indicateur avec sa ligne de signal lissé, habituellement pendant une période de 3 moyennes mobiles, peuvent également détecter les possibilités de transactions:

- L'indicateur suggère d'aller au long lors du franchissement de la ligne de signal par le bas;
- L'indicateur suggère d'aller à court lors du franchissement de la ligne de signal d'en haut.

Les modèles de Convergence/divergence peuvent indiquer la faiblesse possible de tendance:

- Si le prix grimpe à un nouveau sommet, mais l'indicateur n'a pas, cela peut être un signe de la faiblesse de tendance haussière;
- Si le prix tombe à un nouveau plus bas, mais l'indicateur ne fonctionne pas, cela peut être un signe de la faiblesse de la tendance baissière.



CALCUL DE "STOCHASTIQUE"

Stochastique = $100 \times ((C - L) / (H - L))$;

Signal = moyenne des trois dernières valeurs stochastiques;

Où:

C – dernier prix proche;

H – le prix le plus élevé sur une période donnée.

L – le prix le plus bas sur une période donnée;

Indicateur Percent Range de Williams - %R de Williams

OBJET

Williams Gamme de Pourcentage (%R) est un indicateur technique développé par Larry Williams pour déterminer l'actif de surachat ou de survente et donc pour déterminer les points de retournement possibles. A la différence de l'Oscillateur Stochastique de Williams Gamme de Pourcentage est une seule ligne fluctuante sur une échelle inverse.

USAGE

L'objectif principal de Gamme Williams en pourcentage est d'identifier les zones de surachat et de survente possibles, mais l'indicateur doit être considéré dans l'analyse des tendances:

- En général, si l'indicateur grimpe au-dessus de 20, l'actif peut être suracheté;
- Si l'indicateur tombe en dessous de 80, l'actif peut être survendu.

L'absence des zones extrêmes de l'indicateur peut suggérer des points de retournement possibles:

- Traversée de la frontière de surachat en haut, le signal de Gamme de pourcentage Williams a une éventuelle opportunité de vente;
- Traversée de la frontière de survente en dessous, le signal de Gamme de pourcentage Williams a une éventuelle opportunité d'achat.

Modèles de Divergence sont rares, mais peuvent indiquer la possible faiblesse des tendances:

- Si le prix grimpe à un nouveau sommet, mais l'indicateur n'a pas de ça, cela peut être un signe de la faiblesse tendance haussière;
- Si le prix tombe à un nouveau plus bas, mais l'indicateur ne fonctionne pas, cela peut être un signe de la faiblesse de la tendance baissière.



CALCUL DE "PERCENT RANGE DE WILLIAMS"

$$R\% = - ((H - C)/(H - L)) \times 100;$$

Où:

C – Dernier prix proche;

L – le prix le plus bas sur une période donnée;

H – le prix le plus élevé sur une période donnée.

Conclusion

Lorsque vous travaillez sur une forte tendance, traitez des signaux d'oscillateur avec le plus grand soin, car l'oscillateur de faux signaux tend à montrer la tendance de renforcement. Identifier le renversement de tendance, il est nécessaire pour comprendre les concepts de convergence et de divergence de la courbe d'oscillateur avec la direction des mouvements des prix.

www.ifcmarkets.com

