

TRADING CONCEPT ตอน เทรตเดอร์ที่ดี

สวัสดีครับท่านนักลงทุน สัปดาห์ก่อนจารย์ดีได้มีโอกาสจัดสัมมนาเกี่ยวกับเรื่องของการสร้างระบบเทรด จากการพูดคุยกับท่านนักลงทุนที่มาเข้าร่วม ทำให้ได้ข้อคิดดีๆ หลายอย่าง ฉบับนี้เลยขอเอามาสรุป เล่าสู่กันฟังครับ

(ส่วนใครที่ไม่ได้เข้าร่วมสามารถรับชมสนทนาย้อนหลังได้ที่ fb: TH UTRADE)

บ่อยครั้งครับ ที่เวลาเราได้กำไรจากการเทรด มักจะผินหวาน ถึงกำไรที่ได้ ผินต่อไปในอนาคต ว่าถ้าทำแบบนี้อีกซ้ำๆ คงได้กำไรมากมาย หลายสิบหรือหลายร้อยเปอร์เซ็นต์ต่อปี คิดแล้วก็ทำให้เคลิ้มเอาง่ายๆ เหมือนแมลงที่จู่จะหลงบินเข้าหาแสงไฟ ถ้าจะพูดกันตามจริงแบบไม่ผินหวานแล้ว หากกำไรสูงแบบนี้ ทำได้สม่ำเสมอจริง เราก็เตรียมขึ้นแท่นระดับโลกครับ ฉบับนี้ จึงชวนท่านนักลงทุน มาตรวจสอบกันว่า ณ ตอนนี้อยู่เป็นเทรดเดอร์ที่ดีในด้านไหนกันบ้าง และยังมีด้านไหนที่ต้องระมัดระวังหรือปรับเปลี่ยน เพื่อให้การเทรดง่ายและประสบความสำเร็จยิ่งขึ้น

1. ภายนอก**1.1 เครื่องมือที่ใช้**

ถ้าพูดถึงเทรดเดอร์ ส่วนใหญ่ก็ต้องมีนำเครื่องมือสายเทคนิคมาใช้บ้างแหละ อันนี้ยอดนิยม อย่าง Moving Avg., MACD, RSI, Stochastic ฯ มีอยู่ในทุกโปรแกรมการวิเคราะห์หุ้นอยู่แล้ว

จารย์ดีเชื่อว่าแทบทุกคนเคยใช้ และตีความได้เหมือนกัน เช่น $MACD > 0$ แสดงถึงแนวโน้มขาขึ้น

แต่เทรดเดอร์ที่ดี ควรทราบแนวคิดเบื้องหลัง หรือศึกษาที่มาของสูตรที่ใช้ในการคำนวณ เพื่อให้ตระหนักถึงข้อจำกัดเวลานำไปใช้ (หากเราได้ศึกษาที่มาของมันจริงๆ หลายๆ เครื่องมือเป็นแค่สมการเส้นตรงกำลังหนึ่ง หรือก็คือใช้แค่คณิตศาสตร์ระดับมัธยมต้นเท่านั้น)

1.2 ระบบที่ใช้

ระบบเป็นเรื่องดี ช่วยให้สามารถตัดสินใจได้แม่นยำ ช่วยตัดปัญหาด้านอารมณ์ แต่หลายๆ คน โดยเฉพาะเทรดเดอร์มือใหม่ มักรื้อนิวา เครื่องมือนั้นก็ดี เครื่องมือนี้ก็ยอด จึงสร้างระบบจากการใช้เครื่องมือหรือเงื่อนไขมากมาย ยิ่งดูซับซ้อน ยิ่งรู้สึกดี คิดว่า จะยิ่งแม่นยำ แต่ส่วนใหญ่แล้วการมีเครื่องมือมาก เงื่อนไขที่ซับซ้อนเกินไปนั้น นอกจากการตีความจะยาก (บางทีก็ขัดกันเอง) ยังอาจนำไปสู่ระบบที่เรียกว่า Overfit คือ เหมาะกับเฉพาะข้อมูลอดีตที่นำมาทดสอบ พอเอาไปใช้จริง ข้อมูลอนาคตเปลี่ยนแปลงแค่คนเดียว ความแม่นยำ และกำไร ที่เคยสูงๆ ก็หายไปหมด

เทรดเดอร์ที่ดี จึงมักใช้ระบบที่ง่ายๆ แต่ชัดเจน ไม่ได้ดีเลิศ แต่ยืดหยุ่นพอกับข้อมูลที่เปลี่ยนไปในอนาคต เน้นที่ความมี

วินัยและความอดทน ซึ่งส่วนใหญ่แล้วก็มักทำผลงานได้ดีกว่า

1.3 ระยะเวลาที่ใช้

Time Frame ที่เทรด เป็นอีกปัจจัยที่สำคัญ ความอยากรวยเร็ว มักนำไปสู่การเทรดใน TF ที่สั้น ซึ่งทำให้ไม่มีเวลาคิดวางแผนที่มากพอ การเคลื่อนไหวของราคาเองก็มีความผันผวนหลุดออกจากค่าทางสถิติที่ควรเป็นได้ง่าย (นึกถึงการโยนเหรียญ 2 ครั้ง กับ 1000 ครั้ง โอกาสออกหัว ทั้ง 100% ไม่เท่ากันนะ) มีหน้าซ้ำๆ ระยะเวลาทำกำไร ใน TF ที่สั้นก็มีจำกัด ในขณะที่ต้นทุนการซื้อขายคงที่

เทรดเดอร์ที่ดี มักเทรดที่ TF ใหญ่ขึ้น นอกจากความสบายใจ และมีเวลาเพิ่มแล้ว ยังง่ายและมีโอกาสประสบความสำเร็จมากกว่าอีกด้วย

2. ภายใน**2.1 มุมมองต่อตลาด**

เทรดเดอร์ส่วนใหญ่ มักใช้เวลาเกือบทั้งหมดไปกับการคาดการณ์ว่าตลาดจะมีทิศทางไปทางไหน การทำแบบนี้มันทำให้สนุก เราใจทุกวันครับ แต่มันจะนำไปสู่การโหยหาระบบหรือวิธีการที่แม่นยำ และพอคิดว่าเจอ จะมั่นใจ จนนำไปสู่การ Overtrade และนำหายนะมาสู่พอร์ตในที่สุด

เทรดเดอร์ที่ดี จะใช้เวลาวางแผน สำหรับการลงทุนเพื่อรองรับกรณีตลาดเคลื่อนไหวไปในทิศทางต่างๆ นำไปสู่การสร้างกลยุทธ์ (Strategy) ในการลงทุนที่รองรับตลาดทุกแบบ คำนวณค่า Risk-to-Reward Ratio การวางแผนจัดการเงิน (Money Management) จึงอยู่รอดได้ไม่ว่าจะเกิดสถานการณ์ใดขึ้นก็ตาม

2.2 มุมมองต่อการลงทุน

หากตั้งเป้าที่ต้องการเป็นฝ่ายถูก พอถอดแบบวิธีจากครูหรืออ่านหนังสือดีๆ เอามาใช้ก็จะมั่นใจมาก เมื่อตลาดไม่เป็นเหมือนที่คาดก็ต้อตั้ง อาจซื้อถัวเพิ่ม จนสุดท้ายเสียหายหนักจากนั้นก็ทิ้งวิธีเดิม และออกเดินทางหาวิธีใหม่ๆ ต่อไป

เทรดเดอร์ที่ดี ต้องการเงินมากกว่าการเป็นฝ่ายถูก จึงพยายามกลบกลืนไปกับตลาด เพราะตลาดถูกเสมอ หลีกเลี่ยงการอยู่ฝั่งเดียวกับนักลงทุนทั่วไป

2.3 มุมมองต่อตัวเอง

เทรดเดอร์ที่ดี ไม่ใช่ไม่เกิดอารมณ์ แต่จะคอยสังเกตและจัดการกับอารมณ์ที่เกิดขึ้น แยกอารมณ์จากการเทรด ที่สำคัญแยกการถูกผิด (กำไรขาดทุน) ว่าไม่ใช่การถูกผิดของตัวเอง แต่การถูกผิดเป็นของวิธี คิดแบบนี้จะช่วยลดการยึดมั่น และสามารถยอมรับเพื่อปรับปรุงวิธีให้ดีขึ้นได้ง่ายขึ้น อีกทั้งลดความเครียดจากการลงทุนได้อีกด้วยครับ...จารย์ดี

รอบรั้ว ลงทุน ตอน สติมา กำไรมี

สวัสดีครับ วันนี้จารย์ดีมีของดีๆ มาฝากกันครับ จากภาพด้านล่าง เชื่อว่า โลโก้ใบพัดสีฟ้านี้ น่าจะเป็นยนตร์กรรมในฝันของใครหลายๆ คน



แต่ด้วยราคาตัวที่ระดับสองล้านขึ้น ทำให้หลายคนยังลังเลอยู่ วันนี้จารย์ดีเลยมีของดีมาฝากครับ



สมมติ รถคันละ 2 ล้านบาทถ้วน แต่วันนี้จารย์ดีมีบัตรพิเศษ ซื้อได้ที่ราคาเพียง 1.5 ล้านบาทมาแจก ท่านสนใจจะรับไว้ไหมครับ

เชื่อว่าใครที่เคยลังเล คิดอยากซื้อต้องเอาแน่นอน แต่เดี๋ยวก่อนครับ ของดีแบบนี้ จารย์ดีไม่ให้ฟรีครับ ถ้าผมขายบัตรพิเศษใบนี้ให้ที่ราคา 5 หมื่นบาท ท่านจะยังเอาไหม

ก็ยังคุ้มว่าไหมครับ เพราะ 5 หมื่นบาทค่าบัตร รวมอีก 1.5 ล้านบาท รวมจ่าย 1.55 ล้านบาท ได้รถราคา 2 ล้านบาท ก็ยังคุ้มค่าน่าจัดอยู่ดี

แต่เอ็ง! ถ้าผมมีบัตรพิเศษอีกใบ ใบนี้พิเศษยิ่งกว่าเดิม คือท่านสามารถแก้เลขราคาจาก 1.5 ล้านบาทเป็นเท่าไรก็ได้แต่ไม่ต่ำกว่า 100 บาท อยากได้ไหมครับ ผมไม่ให้ฟรีครับ ผมขาย

1. บัตรใบแรก ขายราคา 1 แสน ซื้อได้ 1.5 ล้าน
2. บัตรใบสอง ขายราคา 1.2 ล้าน ซื้อได้ต่ำสุด 100 บาท

เชื่อว่าทุกคนต้องซื้อใบสอง และคงแก้เลขต่ำสุดเหลือ 100 บาทแบบไม่ต้องเกรงใจผม (ใบสองคุ้มสุดๆ เลยทีนี้)

แต่ถ้าเอาบัตรพิเศษที่แก้เป็น 100 บาท (ซื้อรถได้ในราคา 100) มาขายให้ท่านในราคา 2 ล้านบาท ท่านจะซื้อไหม

ครั้งนี้ไม่มีใครเอาครับ มี 2 ล้านบาทซื้อรถเลยดีกว่า จะซื้อบัตร 2 ล้านแล้วมาจ่ายเพิ่มอีก 100 บาททำไมว่าไหมครับ

บัตรพิเศษที่เราพูดถึงกันนี้ มีลักษณะเหมือนวอร์แรนท์ต่างกันแค่ แทนที่จะซื้อรถ แต่เป็นสิทธิซื้อหุ้นแทน

งั้นย้อนกลับมากับ ถ้าหุ้นราคา 1.5 บาท ต่อให้ผมมีบัตรซื้อหุ้นนั้นได้ราคาถูกมากจนเหมือนได้ฟรี บัตรนั้นก็ไม่มีทางขายได้เกิน 1.5 บาท ถูกต้องไหมครับ

ไม่น่าเชื่อนะครับ ในตลาดบ้านเรา บางทีเคาะซื้อขายกันเพลิน สัมผัสความสัมพันธ์ของราคาหุ้นจริงกับราคาวอร์แรนท์ จนบางช่วงคนยอมจ่ายเงินซื้อบัตรพิเศษนี้ (ราคาวอร์แรนท์) แพงกว่าราคาซื้อหุ้นตรงๆ เสียอีก ตลาดไร้เหตุผลโดยสิ้นเชิงครับ ในภาวะนั้น หากเรามีสติ ก็จะหากำไรจากความผิดพลาดนี้ได้ไม่ยาก

แล้วพบกันใหม่ฉบับหน้าครับ...จารย์ดี

คำคมเขียนหุ้น



เพลโต (Plato)

“พฤติกรรมของคนเรา
ขับเคลื่อนด้วย 3 สิ่ง...
กิเลส อารมณ์ และความรู้”

“Human behavior flows from three main sources: desire, emotion and knowledge.”

รายงานฉบับนี้จัดทำขึ้นโดยข้อมูลเท่าที่ปรากฏและเชื่อว่าเป็นที่น่าเชื่อถือได้แต่ไม่ถือเป็นการยืนยันความถูกต้องและความสมบูรณ์ของข้อมูลใดๆ โดยบริษัทหลักทรัพย์ ยูบี เคีย (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) ผู้จัดทำขอสงวนสิทธิ์ในการเปิดเผยความเห็นหรือประมาณการที่ปรากฏในรายงานฉบับนี้ โดยไม่ต้องแจ้งล่วงหน้า รายงานฉบับนี้มีวัตถุประสงค์เพื่อใช้ประกอบการตัดสินใจของนักลงทุน โดยไม่ได้เป็นการชี้นำชักชวนให้นักลงทุนทำการซื้อหรือขายหลักทรัพย์ หรือตราสารทางการเงินใดๆ ที่ปรากฏในรายงาน