

TRADING CONCEPT ตอน บีบให้ระเบิด (2)

สวัสดีครับท่านนักลงทุน กลับมาต่อกันอีกที คราวที่แล้ว เราคุยถึงเทคนิคดีๆ จากผู้บริหารกองทุน Hedge Fund อย่าง **Toby Crabel** (โทบี คราเบล) ไป

ยังพอจำเทคนิค NR7 กันได้อยู่ไหมครับ เอาเป็นว่า จารย์ตีทวนให้แบบย่อๆ อีกครั้ง



แนวคิดคือ เมื่อราคาเกิดการบีบตัว (สังเกตได้จาก ระยะห่างระหว่างค่าสูงสุดและค่าต่ำสุดในวันนั้น ลดลงกว่าวันก่อนๆ โดย NR7 คือ High-Low ของวันต่ำสุดในรอบ 7 วันล่าสุด)

หลังการบีบตัว ราคามักจะเคลื่อนไหวรุนแรง (ระเบิดออกด้านบนหรือล่างก็ได้) ดังนั้นเมื่อเห็นราคาหลุดกรอบไปทางใด ก็เข้าเทรดไปตามทิศทางนั้นๆ

เงื่อนไขการนำไปใช้

จากฉบับที่แล้ว จารย์ตีได้เขียนแนวทางการนำไปใช้แบบชัดเจน เป็นข้อๆ ดังนี้

วันเข้าติดตาม (t)

1. เกิด NR7
2. MACD มากกว่า 0
3. %D น้อยกว่า 80

วันเกิดสัญญาณ (t+1)

1. เป็นวันถัดจากวันเข้าติดตาม
2. ราคาปิด สูงกว่า จุดสูงสุดของวันเข้าติดตาม
3. มูลค่าการซื้อขายทั้งวันมากกว่า 20 ล้านบาท

วันเข้าซื้อ (t+2)

1. เป็นวันถัดจากวันเกิดสัญญาณ
2. เข้าซื้อที่ราคาเปิด

วันขายออก

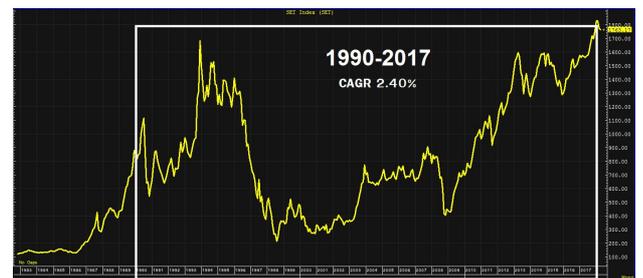
1. ใช้ระบบ Trailing Stop ระยะ 5%



คราวนี้ลองมาดูผลกันครับ จารย์ตีจะใช้วิธี เข้าซื้อ หุ้นละ 10% ของพอร์ต เพื่อเป็นการกระจายความเสี่ยง (ถือหุ้นมากที่สุด 10 ตัวในเวลาหนึ่งๆ) โดยทดสอบกับหุ้นทั้งตลาด ในช่วงปี 1990-2017 รวม 28 ปี (คิดค่าคอมมิชชั่นที่อัตราปกติ)

ผลที่ได้

ก่อนจะไปดูผลว่าดีหรือไม่ก็ต้องหาเกณฑ์อ้างอิงก่อน ในที่นี้จารย์ตีจะใช้ดัชนี SET Index ในช่วงเวลาเดียวกันเป็นตัวอ้างอิง



โดยดัชนี SET Index วิ่งจากแถวๆ 900 จุดไปจบที่ 1750 จุด หรือขึ้นมาเกือบเท่าตัว คิดเป็นผลตอบแทนเฉลี่ย 2.40% ต่อปี โดยในช่วงที่เลวร้ายที่สุด มูลค่าของพอร์ตลดลงมากถึง -88% เลยทีเดียว (Maximum Drawdown)

คราวนี้มาดูผลของการเทรดตามระบบ “บีบให้ระเบิด” หรือ NR7 ของเรากันบ้างครับ

การเทรดทั้งสิ้นเกือบๆ 3,000 ครั้ง ความแม่นยำอยู่ที่ 40% (ขออนุญาตตัดเป็นเลขกลมๆ) โดยมีกำไรเฉลี่ยครั้งละ 12% ขาดทุนเฉลี่ยครั้งละ 5%

รวมๆ แล้ว ตกกำไรเฉลี่ย 14% ต่อปี โดยช่วงที่แย่มากที่สุด มี Drawdown อยู่ที่ 39% เท่านั้นเอง

เรื่องเงินไม่ต้องพูดถึง ถ้าให้เงินต้น 1 ล้านบาทเท่ากัน การซื้อแล้วถือดัชนี จะทำให้พอร์ตโตเป็น 1.9 ล้านบาท ในขณะที่พอร์ต “บีบให้ระเบิด” เงินโตไปเป็น 43.4 ล้านบาท พุดง่ายๆ เริ่มต้นรวยเท่ากัน **ปลายทางรวยกว่ากันกว่า 20 เท่า !!**



จารย์ตีว่า ระบบนี้ก็พอใช้งานได้ดีทีเดียวครับ ง่ายๆ ไม่ซับซ้อนอะไร ลองเอาไปใช้ดูกันครับ

ประยุกต์การระเบิดที่แรงขึ้น

บางครั้ง ก็มีการนำลักษณะของการบีบให้ระเบิดไปใช้อีกแบบครับ คือมองในลักษณะของ Pivot Point อาจารย์ดีขออธิบายเพิ่มเติมง่ายๆ ตามนี้ครับ

แทนที่จะรอให้ราคาบีบตัวแคบ เพื่อหาจังหวะระเบิด สู้เราไม่ต้องสนใจการบีบตัว แต่มองหาว่าวันใดที่ราคามีการเคลื่อนไหว หรือวิ่งแรงเกินกว่าค่าปกติ นั่นก็คือเป็นการระเบิดลงมากกว่ากำหนดเงื่อนไขตามพินิจนิยมที่คนส่วนใหญ่ใช้กันดูครับ

ตัวกรอง 1. ระยะการเคลื่อนไหวปกติ

เนื่องจากเรา จะเทรดในช่วงของการแกว่งขึ้นหรือแกว่งลง ดังนั้นระยะที่มองจึงมองแบบด้านเดียว คือ

- จุดสูงสุด-ราคาเปิด หรือ ราคาเปิด-จุดต่ำสุด
- เลือกระยะที่สั้นกว่า นับเป็น Narrow Range (อาจารย์ดีจะขอใช้ชื่อ NR7 เหมือนเดิม)

3. เนื่องจากค่าในแต่ละวันไม่เท่ากันแน่ จึงนำค่าที่ได้แต่ละวันมาหาเป็นค่าเฉลี่ยแบบ Simple MA 7 วัน (SNR7)

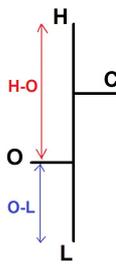
วันเกิดสัญญาณและวันเข้าซื้อ (t)

รอบนี้ทั้ง 2 เป็นวันเดียวกันครับ คือ เข้าซื้อเมื่อ

1. ราคาเปิด สูงกว่าราคาปิดวันก่อนหน้าบวก SNR7 (ความหมายก็คือ แค่เปิดมาราคาก็เคลื่อนไหวไปจากราคาปิดเมื่อวานมากกว่าระยะการเคลื่อนที่เฉลี่ยใน 1 วันที่เราบันทึกมาเสียอีก แสดงว่าเกิดการระเบิดแล้ว)

2. ตัวกรองพื้นฐาน วันที่เกิดสัญญาณ จะต้อง มี

- 2.1 MACD มากกว่า 0
- 2.2 %D น้อยกว่า 80



2.3 มูลค่าการซื้อขายมากกว่า 20 ล้านบาท

3. เข้าซื้อที่ราคาปิดของวันที่เกิดสัญญาณ

วันขายออก

1. ใช้ระบบ Trailing

Stop ระยะ 5%

โดยเข้าซื้อ หุ่นละ 10% ของพอร์ต ในช่วงเวลาเดียวกันกับตัวอย่างที่แล้ว

ภาพตัวอย่างด้านขวา แสดงการเกิดสัญญาณซื้อ



ผลที่ได้

พบว่า สัญญาณของระบบ SNR7 นี้เกิดได้ง่ายกว่า โดยในช่วงที่ทดสอบ มีการซื้อขายเพิ่มขึ้นอีกราว 1,000 ครั้ง ความแม่นยำอยู่ที่ 40% โดยมีกำไรเฉลี่ยครั้งละ 12% ขาดทุนเฉลี่ยครั้งละ 5% (ใกล้เคียงของเดิม)

เนื่องจากความแม่นยำและกำไรขาดทุนเฉลี่ยใกล้เคียงเดิม แต่มีรอบหรือความถี่ในการเข้าสัญญาณบ่อยขึ้น (เงินขยับขึ้น) ทำให้ระบบนี้ สร้างผลตอบแทนรวมเฉลี่ยเพิ่มเป็น 21%ต่อปี แทนอนครับ ซื้อขายบ่อยก็ทำอะไรได้มากขึ้น ในมุมมองกลับกัน ช่วงที่แย่ ก็มีสิทธิโดนหลายที่หลายรอบขึ้น ทำให้มี Maximum Drawdown อยู่ที่ 47% (เพิ่มขึ้นจาก 39% ในระบบ “บีบให้ระเบิด”)

ดังนั้นหากใครจะเลือกใช้ เพื่อหวังกำไรสูงขึ้น ก็ต้องทำให้แข็งขึ้น พร้อมรับการบาดเจ็บที่หนักขึ้นด้วยครับ เพราะโลกนี้ไม่มีอะไรได้มาฟรีๆ

แล้วพบกันใหม่ฉบับหน้าครับ...จารย์ดี

คำคมเขียนหุ่น



ดอนัลด์ ทรัมป์ (Donald J. Trump)

“หากปราศจากแรงปรารถนา
คุณจะไร้พลัง
และเมื่อขาดซึ่งพลัง
...คุณย่อมนไม่เหลืออะไร”

“Without passion you don't have energy,
without energy you have nothing.”

รายงานฉบับนี้จัดทำขึ้นโดยข้อมูลเท่าที่ปรากฏและเชื่อว่าเป็นที่น่าเชื่อถือได้แต่ไม่เป็นการยืนยันความถูกต้องและความสมบูรณ์ของข้อมูลใดๆ โดยบริษัทหลักทรัพย์ ยูเอสบี เคย์ ฮีเนียน (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) ผู้จัดทำขอสงวนสิทธิ์ในการเปลี่ยนแปลงความเห็นหรือประมาณการณ้ต่างๆที่ปรากฏในรายงานฉบับนี้ โดยไม่ต้องแจ้งล่วงหน้า รายงานฉบับนี้มีวัตถุประสงค์เพื่อใช้ประกอบการตัดสินใจของนักลงทุน โดยไม่ได้เป็นการชี้นำชักชวนให้นักลงทุนทำการซื้อขายหลักทรัพย์ หรือตราสารทางการเงินใดๆ ที่ปรากฏในรายงาน