

TRADING CONCEPT ตอน คำนมหนู...อยู่ไหน

อาทิตย์ก่อนเป็นวันเด็ก เมื่อวานเป็นวันครู เดิมทีด้วยครูคือ
สิ่งศักดิ์สิทธิ์ เป็นผู้ทรงภูมิ...คอยถ่ายทอดความรู้ให้เด็ก

พอถึงยุค 5G ที่ความรู้อยู่แค่ปลายคลิก ที่ไหนนิ้วเรียวยาวของ
ครูนิ้วเดียว จะคลิกกัน 40 นิ้วของนักเรียนทั้งห้อง

ห้องเรียนวันนี้...จึงน่าเป็นสถานที่แลกเปลี่ยนความรู้ระหว่าง
ครูและเด็กๆ โดยมีครูช่วยกระตุ้นความอยากในการเรียนรู้ รวมไปถึง
พัฒนาทักษะกระบวนการคิดวิเคราะห์ของเด็กเสียมากกว่า

พูดแล้วก็นึกถึงวันที่ห้องสัมมนาเบียดเสียดไปด้วยนักลงทุน
วันที่เบียดกันก็แทบหาไม่ได้ วันวานที่ตลาดยังเป็นกระทิงหนุ่มเมื่อหลายปี
ก่อน คำพูดนักลงทุนท่านหนึ่งยังติดใจจรัสมาถึงทุกวันนี้...ท่านว่า

“ทุกวันนี้ เล่นหุ้นหาคำกับข้าวให้เมีย...คำนมให้ลูก”

ก็เหมือนเหมือนกับปลายเมียบอกกับลูกน้ำหนักลดไปสักทีก็โล
ว่าแต่...เล่นหุ้นหาคำนมลูกเมีย ทำได้จริงไหม วันนี้จารย์ที่มีคำตอบ

พื้นฐาน vs เทคนิค

สายพื้นฐาน เหมือนปลูกข้าว กว่าข้าวจะแตกรวงต้องใช้เวลา
...รอราคาสะท้อนมูลค่าที่แท้จริง ดังนั้น การเล่นหุ้นหาคำกับข้าว คง
สงวนสิทธิ์ไว้เพียงเทรดเดอร์สำนักเทคนิคเท่านั้น

เหยียบเข้าสำนักเทคนิค ร้อยทั้งร้อยต้องเจอคำว่า

“The Trend is Your Friend”

สอนกันมารุ่นต่อรุ่น เทรนก็เหมือนแฟน ไม่ว่าจะเปิดสถานะที่
ไหน ก็ต้องขอมิเทรนอยู่ใกล้ๆ ไม่ห่างเสมอ

นอกจากนี้ อีกใบไม้ของเทคนิค คือ

“Cut Loss Short, Let Profit Run”

ตัดขาดทุนให้เร็ว และอยู่กับกำไรให้นานที่สุด

ลงมาเดากันครับ การจะทำตาม 2 ประโยคของนี้ได้

เงื่อนไขไหนสำคัญที่สุด...

1. จุดเข้า

2. จุดออก

...ใช้ครับ การหนีออกจากเทรดที่ขาดทุน หรือทนอยู่กับ
การเทรดที่ทำไถ่ไปนานๆ ขึ้นอยู่กับ...การกำหนดจุดออก

สากลนิยมใช้ **Trailing Stop**...คือกำหนดจุดตัดขาดทุนไว้
ห่างๆ แล้วคอยยกจุดตัดขาดทุนขึ้นไปเรื่อยๆ เมื่อราคาปรับสูงขึ้น

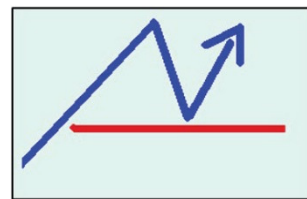
ทุกอย่างฟังดูดี...สอดคล้องและลงตัวดี

แต่หากใครเคยได้ทำจริง จะพบปัญหายิ่งใหญ่ติดคาใจ
เหมือนกับข้าวมันไก่ไม่มีน้ำซุ๊ป...ลองนึกถึงเหตุการณ์ ช้อแล้วหุ้นขึ้น...

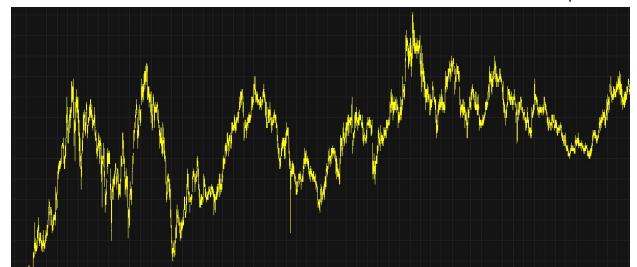
จึงเลื่อนจุดตัดขาดทุนตามไปซ้ำๆ วันระยะกว้างๆ...ที่ไหนได้ พอราคา
วกกลับลงมาแตะจุดตัด ทำไรก็เหวี่ยง แคมท้ายยังขาดทุนเสียอีก

หรืออีกแบบที่คุ้นเคยกัน ช้อปั๊...ลงปั๊...แตะจุดตัดขาด
ทุนพอตัดออกมาเรียบร้อย ราคาที่ผกผันขึ้นไปตามที่เราคิดไว้หลายแห่ง
...เราได้แต่นั่งมองตาปริบๆ โทษเจ้ากรรมนายเวรไปต่างๆนาๆ

แล้วระยะที่ขาดทุนที่ดี...อยู่ที่ไหน ? เพื่อให้เห็นภาพ ลองดู
ตัวอย่างคลาสสิก เราเข้าซื้อเมื่อราคาเบรค High เดิม โดยใช้จุดตัดอยู่
ที่เส้นแดง ได้จุดต่ำสุดที่ผ่านมา...คงเคยใช้กันใช้ไหมครับ



แต่ราคาหุ้นจริงๆ ไม่เคยสวยอย่างนั้น แม้จะคาดถูกว่าหุ้น
ขึ้น แต่ก็มักวัดแกว่งอาละวาดจนเราโดนเขย่าออกไปก่อนเสียทุกครั้ง



แล้วคำกับข้าวที่ตั้งใจจะหาทุกวันนี้จะทำได้จริงหรือ เมื่อต้อง
โดนตัดขาดบ่อยๆ แบบนี้ แคมวันไหนโชคดีมีกำไร ก็ขายไม่ได้ต้องอยู่
กับทำไถ่ให้นานอีก แล้วแบบนี้คำนมหนู...จะอยู่ไหน

เมื่อไรทางออก...จะออกทางไหน

ง่ายๆ ครับ **“หากทางออกไม่ได้ ให้ย้อนไปออกที่ทางเข้า”**

อ้าว จารย์ตีทวนเข้าให้แล้ว ไม่นะครับ ลองไปดูทางเข้าของ
ปัญหา...ก็เมื่อสายเทคนิค แคมจะถูกครั้งเราต้องทนขาดทุน
เล็กน้อยๆ ตลอดทาง เพื่อรอทำไถ่ก้อนใหญ่นานๆ ครั้ง

แถมไม่ว่าตลาดเลือกจะขึ้นหรือลง ก็ยังจะแกว่งตัวแรงๆ จน
นักลงทุนทั้งสองข้าง ถูกเขย่าออกไปก่อนจากการตัดขาดทุน

...ลองถอยแล้ว และกลับไปอ่านประโยคข้างบนอีกครั้งครับ...

คราวนี้ ลองทั้งทุกสิ่ง...แล้วย้ายไปยืนด้านตรงข้าม...สิ่งที่
ได้ก็คือ **เราจะมีกำไรเล็กๆ น้อยๆ ตลอดทาง** แลกกับการขาดทุนใหญ่ๆ
นานๆ ครั้ง และไม่ว่าตลาดเลือกจะขึ้นหรือลง ตลาดก็มีแค่แกว่งตัว
แรงเพียงพอ ให้เราได้ออกไปก่อนพร้อมกับกำไรแม้ว่าจะเลือกทางผิด
ฟังดูดีว่าไหมครับ เอาไว้ เรามาลองสร้างโมเดลแบบที่ว่ากัน

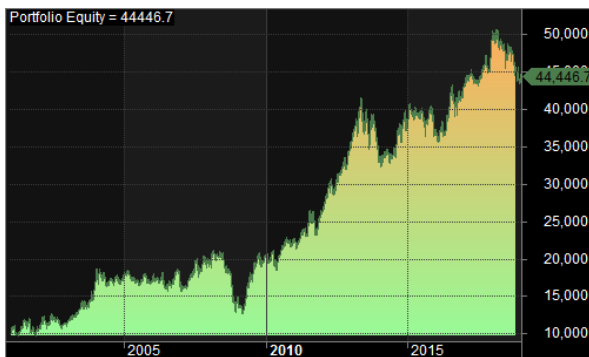
หาเงินก็แค่ซื้อ

สมมติให้การที่เราซื้อหุ้นเมื่อเส้นค่าเฉลี่ย EMA 10 วัน
นับเป็นหาเงิน ดังนั้น กำหนด

จุดซื้อ : ราคาอยู่เหนือเส้นค่าเฉลี่ย EMA 10 วัน โดยจะทำการเข้าซื้อที่
ราคาเปิดในวันทำการถัดไป

จุดขาย : กำหนด take profit ที่ 3% และถึงระยะ cut loss 30%

แบ่งเงินออกเป็น 5 ไม้ โดยซื้อเมื่อหุ้นตัวใด ๆ ใน SET50 เกิด
สัญญาณ ทำการทดสอบในช่วง 01/01/01 – 14/01/19 และหัก
ค่าธรรมเนียมการซื้อขายตามปกติ ผลการทดสอบเป็นแบบนี้ครับ



เงิน 10,000 บาท เพิ่มขึ้นเป็น 4 เท่ากว่า คิดเป็นอัตรา
ผลตอบแทนเฉลี่ย 8.6% ต่อปี ที่สำคัญมี %Win สูงถึง 94.69%

จุดเข้าสำคัญแค่ไหน

จากตัวอย่าง จารย์ลองเปลี่ยนจุดซื้อ

จาก ราคาอยู่เหนือเส้นค่าเฉลี่ย EMA 10 วัน

มาเป็น ราคาอยู่เหนือเส้นค่าเฉลี่ย EMA 25 วัน

ผลการเทรดที่ได้ แทบจะไม่ต่างกันเลย...ก็คงเป็นเงินเพราะใช้

EMA เหมือนกัน จ้างลองเปลี่ยนจุดซื้อมาใช้ indicator ตัวอื่นๆ บ้าง
(โดยคงเงื่อนไขอื่นไว้เหมือนเดิม ทั้งจุดขาย ช่วงเวลา ต่างๆ)

- ซื้อเมื่อ **MACD** มากกว่า 0
- ซื้อเมื่อ **DI+** เหนือ **DI-**
- ซื้อเมื่อ **RSI** มากกว่า 70

หรือลองไม่ใช้ indy เอา price pattern เพียวๆ มาจับ เช่น

- ซื้อเมื่อ **ราคาขึ้นทำจุดสูงสุด สูงกว่าตลอดทั้ง 10 วันที่ผ่านมา**

ผลการทดสอบทั้งหมดที่ได้เป็นดังตารางด้านล่าง

No	เงื่อนไขในการซื้อ	CAGR	%Win	MaxDD	# Trades
1	C > EMA(10)	8.62%	94.69%	-40.37%	716
2	C > EMA(25)	7.48%	94.78%	-36.49%	690
3	MACD > 0	7.34%	94.91%	-35.58%	648
4	DI+ > DI-	7.04%	94.73%	-41.14%	737
5	RSI(14) > 70	9.91%	95.37%	-27.87%	670
6	Highest High (10)	7.00%	94.30%	-40.26%	664

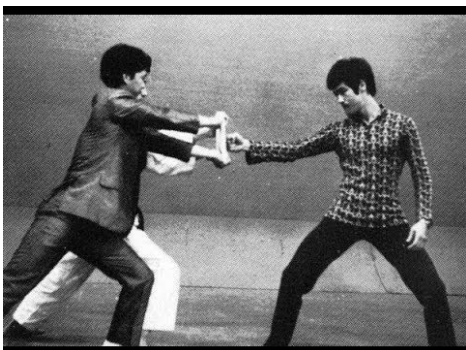
จะเห็นว่าเปลี่ยนจุดเข้าผล **แทบไม่แตกต่างกันเลย** ได้ผลตอบแทน
เฉลี่ยต่อปีก็พอหอมปากหอมคอ และความแม่นยำที่สูงจนการันตีได้ว่า
เทรดได้อย่างมีความสุข ซื้อ 100 ครั้ง ทำกำไรหายบาย 95 ครั้ง

ทั้งนี้ทั้งนั้น มี **จุดสำคัญซึ่งเป็นขั้วตาย** ที่จารย์ต้องอยากฝากไว้
หากท่านนักลงทุนอยากเอาโมเดลนี้ไปใช้ เพื่อหาความสุขจากการเทรด
หรือหาค่ากับข้าวเล็กๆ น้อยๆ คือ **กลุ่มหุ้น**

ต้องแน่ใจว่าระยะถือครอง 30% เป็นช่วงที่ราคาไปถึงได้ยาก
จริงๆ ดังนั้นกลุ่มหุ้นที่ใช้ควรเป็นหุ้นตัวใหญ่ ที่มีปัจจัยพื้นฐานรองรับที่
ดีพอสมควร การนำโมเดลนี้ไปใช้กับหุ้นบริษัทขนาดเล็ก ที่มีราคาผัน
ผวนสูงๆ มีประวัติ ceiling กับ floor เป็นว่าเล่น แบบนี้ไม่เหมาะกับการ
เข้าไปฝากความหวังเรื่องค่ากับข้าววันละรีบ

ขอให้ท่านนักลงทุน เพิ่มพูนความมั่งคั่งและมีความสุขกับ
การเทรดทุกวันครับ...จารย์ดี

คำคมเขียนหุ้น



บรูซ ลี (Bruce Lee)

“คนฉลาด...เรียนรู้อย่างรวดเร็ว
จากคำถามที่โง่งเงา
...ได้ดียิ่งกว่า คนโง่งเงาได้เรียนรู้อย่างรวดเร็ว
จากคำตอบที่ชาญฉลาด”

“A wise man can learn more from a foolish question
than a fool can learn from a wise answer.”