

TRADING CONCEPT ตอน ขึ้นแรง แต่ลงเบา

สวัสดีท่านนักลงทุน เดือนห้าผ่านมา พาน้ำตาตก ตอนนี้เข้าเดือนหก หาวนหุ้นตกแทบไม่เจอ...เชื่อว่าเดือนนี้คงเป็นเดือนที่สดใสของท่านนักลงทุนนะครับ

เป็นธรรมชาติของโลก หุ้นมีลงก็มีขึ้น มีขึ้นก็มีลง ความจริงนี้คงจะหลีกเลี่ยงไม่ได้แน่นอน

จารย์ที่เคยแอบคิดแอบฝันไปว่า ถ้าพอได้สักใจ **อยากขอหุ้นที่ขึ้นได้เหมือนจรวด แต่ตอนลงเบามือนนก**

คือ เวลาขึ้น...ขึ้นแรง และเวลาลง...ลงเบา

ว่าแต่หุ้นแบบนี้มีอยู่จริงไหม แล้วเราจะหามันเจอได้อย่างไร ฉบับนี้จารย์ที่มีคำตอบ



ตลาด...ภาพรวมที่กดดันหุ้น

ในวันที่ฟ้าอึมครึม จะให้นั่งตากฝนด้วยใจสดใสเบิกบาน กระปรี้กระเปร่าสุด จารย์คิดว่าคนนั้นคงเริ่มไม่ปกติทำไรแล้ว

ดังนั้นหุ้นในฝันที่เราอยากหา คงจะเป็นหุ้นที่ขึ้นมากๆ ในวันที่ตลาดกำลังไปได้สวย แต่ในวันที่ตลาดย่ำแย่ ก็ควรจะปรับพอร์ตของตัวเองได้ หรืออย่างน้อยๆ ก็ควรจะย้ายอย่างน้อยกว่าหุ้นตัวอื่นๆ ในตลาด

เพียงเท่าที่เท่านี้ก็ได้...การลงทุนของท่านนักลงทุน ที่ย่อมได้ผลที่ดีเหนือว่าตลาดโดยรวมแล้ว

แล้วจะรู้ได้ไงว่าดีกว่า จารย์ต้องเสนอเครื่องมือที่ง่ายที่สุด คือ

Price Ratio = ราคาหุ้นที่สนใจ / ดัชนีตลาด

ต้องบอกก่อนว่า การบอกน้อยของค่า Price Ratio นั้นบอกหุ้นในฝันไม่ได้ เพราะเบื้องต้นราคาหุ้นแต่ละตัวไม่เท่ากัน ลองดูตัวอย่างก่อนครับ จะได้เห็นภาพชัดเจน

สมมติ วันนี้ราคาหุ้น 10 บาท และดัชนีตลาด 1000 จุด

ดังนั้น Price Ratio เริ่มต้น จะอยู่ที่ $10/1000 = 0.0100$

คราวนี้ดู 2 กรณี

ตัวอย่างหุ้นที่ดีกว่าตลาด				ตัวอย่างหุ้นที่แย่กว่าตลาด			
สมมติ				สมมติ			
หุ้นขึ้น 20% ->	12	=	Price Ratio 0.0109	หุ้นขึ้น 5% ->	10.5	=	Price Ratio 0.0095
ตลาดขึ้น 10% ->	1100			ตลาดขึ้น 10% ->	1100		
หุ้นลง 5% ->	9.5	=	Price Ratio 0.0106	หุ้นลง 20% ->	8	=	Price Ratio 0.0089
ตลาดลง 10% ->	900			ตลาดลง 10% ->	900		

จะเห็นว่าด้านซ้าย หุ้นที่ขึ้นแรง หรือว่าลงเบา ล้วนทำให้ Price Ratio เพิ่มขึ้น (สีเขียว)

ในทางกลับกัน ตัวที่ขึ้นเบา หรือลงแรงกว่าตลาด ก็จะทำให้ Price Ratio ลดลงเสมอเช่นกัน (สีแดง)

ใช้ดีดี...บอกอนาคต

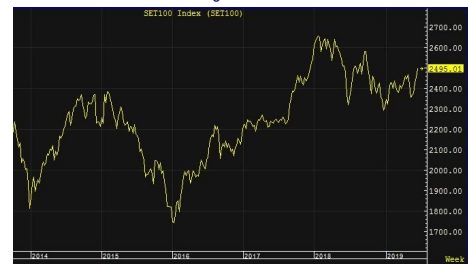
ปัญหาคือการขึ้นลงของค่า Price Ratio ที่เห็น ช่วยบอกให้รู้ว่าในอดีตหุ้นตัวไหนขึ้นแรงแต่ลงเบา...แต่ไม่บอกอนาคต

จึงต้องเชื่อไว้ก่อนว่าพฤติกรรมหุ้นก็เหมือนพฤติกรรมคน คนที่อดีตขี้บรกรเร็ว ก็น่าจะพอคาดได้ว่าพรุ่งนี้ก็ยังจะขี้บรกรเร็วอยู่

จารย์ที่เคยตั้งเกณฑ์ทดสอบแบบนี้ครับ

1. สนใจหุ้น 100 ตัวใน SET100 ช่วง 5 ปีล่าสุด 2014-ปัจจุบัน
2. ทุกสิ้นเดือน หากการเปลี่ยนแปลงของ Price Ratio ของหุ้นแต่ละตัวในช่วง 25 วันทำการล่าสุด
3. เลือกซื้อหุ้นที่มี Price Ratio เพิ่มขึ้นสูงสุด 5 อันดับแรก โดยซื้อที่ราคาปิดในวันทำการถัดไป (วันแรกของเดือน) ด้วยเงินเท่าๆ กันทั้ง 5 ตัว (ตัวละ 20% ของพอร์ต)
4. ณ วันทำการสุดท้ายของเดือน ขายหุ้นทั้งหมดที่ราคาปิดและวนไปเริ่มทำข้อ 2. ใหม่

พอใช้ดีดี SET100 เป็น Benchmark ในการวัดผล พบว่าช่วงเวลาดังกล่าวได้เกือบๆ 30% หรือกำไรเฉลี่ย 4.68% ต่อปี (หากเงินต้น 1 ล้าน ก็จะกลายเป็นเกือบๆ 1.3 ล้าน โดยในช่วงนี้ มี 2 ปีที่ลงหนักๆ คือ 2015 และ 2018 ดังรูปด้านล่าง)



จากผลการทดสอบการเทรดกับหุ้นในฝัน พบว่าเงิน 1 ล้านบาทไปเหยียบบ้าง 4 ล้านบาท หรือขึ้นเกือบๆ 300% คิดเป็นกำไรเฉลี่ย 28% ต่อปี (หักค่าธรรมเนียมการซื้อขายแล้ว)



จากกราฟ Equity Curve แสดงมูลค่าของพอร์ต จะเห็นว่ามีการเติบโตที่ราบรื่นขึ้นกว่าดัชนีมาก และมีปี 2018 ปีเดียวที่ขาดทุน

การหาหุ้นในฝัน ชนิดที่ขึ้นแรงแต่ลงเบา ไม่ใช่เรื่องยากเลย แกมهامาแล้วยังสามารถนำไปใช้ลงทุนจริงเพื่อทำกำไรในระยะยาวได้อีกด้วย และพบกันใหม่ฉบับหน้าครับ...จารย์ดี

รอบรั้ว ลงทุน ตอน แก้วไวน์ กับพลังจักรวาล

ท่านนักลงทุนเคยเกิดคำถามแบบนี้ในใจไหมครับ

ค้าขายมานาน...ทำไมไม่รวยสักที

ทำงานหลายปี...ทำไมตำแหน่งไม่ก้าวหน้า

ทำธุรกิจมา...ทำไมยังไม่ประสบความสำเร็จ

เล่นหุ้นมานาน...ทำไมยังไม่เป็นเศรษฐี

วันนี้จารย์ที่จะ**จะเป็นผู้นำพาทุกฝันของท่าน ให้ประสบความสำเร็จ**

พลังจักรวาล

หลายคนเคยบอกว่า จักรวาลที่กว้างใหญ่นี้ มีพลังลึกลับซ่อนอยู่ หากเราเรียนรู้วิธีติดต่อ จนสามารถสร้างแรงดึงดูดกับจักรวาลได้แล้ว สุดท้าย**จักรวาลจะมอบทุกสิ่งทุกอย่างที่ท่านต้องการให้...**



หลายคนเลยลอง จดจ่อคิดถึงสิ่งที่ต้องการ เผื่อเรื่องความสุข ความร่ำรวย ความกล้า หรือแม้แต่ความรัก ทว่าก็ยังมืดมิด แสงสว่างที่ปลายอุโมงค์ช่างรำไรเสียเหลือเกิน

ล้อมวงเข้ามา จารย์จะบอกเคล็ดลับให้ฟัง

หากท่านร้องขอความร่ำรวย...

...จักรวาลจะมอบสิ่งใดให้ก็ได้ นอกจาก**โอกาสในการหาเงิน**

หากท่านร้องขอความรัก...

...จักรวาลจะมอบสิ่งใดให้ก็ได้ นอกจาก**โอกาสในการแสดงความรัก**

เตรียมแก้วไวน์ รับพลังจักรวาล

เหมือนที่เคยกล่าวไว้ใน **Trading Wizard** ฉบับที่ 197 แค่ว่าจุดเชื่อมโยงในหัวคนคนเดียวที่ยิ่งใหญ่ มากกว่าดวงดาวทั้งหมดในจักรวาลนี้แล้ว **สิ่งสำคัญจึงอยู่ภายใน ไม่ใช่ภายนอก**



จักรวาลมอบโอกาสทุกอย่างทั้งรายวัน ไหลผ่านเข้ามาอยู่เสมอ ปัญหาอยู่ที่ ตัวเราต่างหากว่าพร้อมรองรับอะไร

ถ้าเราหลอมตัวเองให้เป็นแก้วไวน์ชั้นดี นั่นก็คือเราได้เตรียมความพร้อม ติดต่อกับจักรวาล เพื่อดึงดูดไวน์ชั้นเลิศที่ไหลผ่านเข้ามา แต่หากปล่อยตนเป็นกระป๋องบูบี้ ก็คงดึงดูดได้แค่ น้ำฝนที่รั่วจากหลังคา

รอบตัวเรามีตั้งแต่ **น้ำอมฤตไปจนถึงน้ำโสโครก** ไหลผ่านอยู่ตลอดเวลา ระวังให้ดิน-ครีบกเพราะกฎแรงดึงดูดจักรวาลทำงานเสมอ

การลงทุนก็เช่นกัน หุ่นหลากหลายไหลผ่านหน้าจอทุกวัน ลองเช็คดูครับว่า **“แก้วที่ท่านใช้อยู่ กรองหุ่นแบบที่ต้องการหรือเปล่า”** ถ้าไม่ใช่ รับเปลี่ยนแก้วใหม่ด่วนครับ...จารย์ดี

คำคมเขียนหุ่น



ดาไล ลามะ (Dalai Lama)

“ ยามพูด

...เราเพียงได้**ทบทวน**สิ่งที่รู้อยู่แล้ว

ยามฟัง

...เราเพิ่มโอกาสได้**เรียนรู้**สิ่งใหม่”

“When you talk, you are only repeating what you already know. But if you listen, you may learn something new.”

รายงานฉบับนี้จัดทำขึ้นโดยข้อมูลเท่าที่ปรากฏและเชื่อว่าเป็นที่น่าเชื่อถือได้แต่ไม่ถือเป็นการยืนยันความถูกต้องและความสมบูรณ์ของข้อมูลนี้ โดยบริษัทหลักทรัพย์ ยูโอบี เคีย (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) ผู้จัดทำขอสงวนสิทธิ์ในการเปลี่ยนแปลงความเห็นหรือประมาณการต่าง ๆ ที่ปรากฏในรายงานฉบับนี้ โดยไม่ต้องแจ้งล่วงหน้า รายงานฉบับนี้มีวัตถุประสงค์เพื่อใช้ประกอบการตัดสินใจของนักลงทุน โดยไม่ได้เป็นการชี้นำ ชักชวนให้นักลงทุนทำการซื้อหรือขายหลักทรัพย์ หรือตราสารทางการเงินใดๆ ที่ปรากฏในรายงาน