

TRADING CONCEPT ตอน Inside Divergence

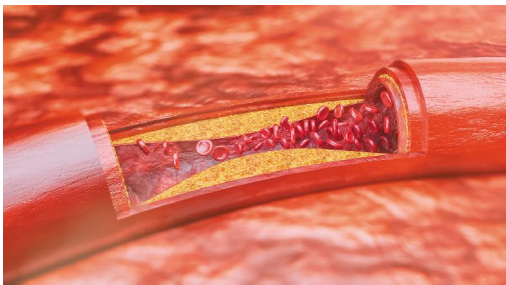
ทุกท่านคงเคยโดน มรสุมชีวิต ฟาดหน้าแบบไม่ตั้งตัว
หลายคนเอาแต่กับหน้า โทษฟ้า โทษดิน...

แต่หากทบทวนให้ดี... “ก่อนฝนมา ฟ้าจะครึ้ม”

เช่น ก่อนจะเป็นอัมพาตเพราะเส้นเลือดสมองจะแตก...

หากตรวจก่อนหน้า อาจพบโรคความดันโลหิตสูง เบาหวาน หัวใจ อ้วน
ความเครียดกับงาน กินเหล้า สูบบุหรี่ และละเลยการออกกำลังกาย

แน่นอน...รู้ก่อน...ก็เตรียมรับมือมรสุมสบาย



เหมือน เรา รู้อดีต ปุณหลังของใครคนหนึ่ง นั่นก็ช่วยให้เรา
คาดการณ์พฤติกรรมในอนาคตของคนคนนั้นได้

เชื่อเถอะว่า...**หุ้นก็คาดการณ์ได้ไม่ต่างกัน**

ก่อนนกระจอก...จะกินน้ำ

มาบวรอให้หุ้นขึ้น ถึงรู้ว่าขึ้น หรือนั่งเฝ้าจนหุ้นลงจึงรู้ว่าลง
บางทีก็โมโหกัน (lag) เลยมักได้แค่บ่นตามหลังว่า “รู้อะไรไม่รู้...รู้จัง”

ความฝันของนักลงทุน โดยเฉพาะนักเก็งกำไร...น่าจะเป็น

การบอกได้ว่า...“หุ้นที่ลงอยู่ กำลังจะขึ้น”

การบอกได้ว่า...“หุ้นที่ขึ้นอยู่ กำลังจะลง”

หรือแม้แต่

การบอกได้ว่า...“หุ้นที่ขึ้นอยู่ กำลังจะพุ่งแรง”

หากเราสามารถระบุสิ่งเหล่านี้ได้...

ต้องดีเยี่ยมแน่ๆ ลองคิดตามหลักธรรมชาติ

รถจะยูเทิร์น...ต้องชะลอความเร็ว

... หุ้นที่เซ่นกัน จะกลับแนวโน้มได้

...ต้องมีบางสิ่งเล็กน้อย ค่อยๆบั่นทอนก่อน

ดูตัวอย่างง่ายๆ

หุ้นที่เห็น **ลง ลง ลง มาต่อเนื่อง** แต่...ลงน้อยหรือยังลงยิ่งช้า

...แบบนี้ก็น่าจะใกล้หยุดลง

หุ้นที่เห็น **ขึ้น ขึ้น ขึ้น มาต่อเนื่อง** แต่...ขึ้นน้อยลงทุกวัน

...จะขึ้นต่อไถ่ๆ ก็คงจะเต็มกลับ

พอเห็นไอเดียใช้ไหม เดิมเรา**รอดูแต่การเพิ่ม/ลดของราคา**



คราวนี้ ไปให้โฟกัสที่**ความเร็วในการขึ้นลงของราคาแทน**

เครื่องมือวัดความเร็วของราคา

จะจับว่าราคาที่เปลี่ยนแปลงเร็วแค่ไหน เครื่องมือง่ายสุดที่
ใช้วัดคือ **Rate of Change** หรือ **ROC**

ROC = วัดการเปลี่ยนแปลงของราคา ระหว่าง 2 จุดของ
เวลา โดยมีหน่วยเป็น %

ดังภาพด้านล่าง สมมติราคาหุ้น

ROC (n วัน) จะเห็นว่าช่วงแรก สีเขียว หุ้นใช้เวลา n วันเพิ่มขึ้น 5%

ROC (n วัน) จะเห็นว่าช่วงหลัง สีแดง หุ้นใช้เวลาเท่ากัน เพิ่มขึ้น 2%



แบบนี้เรียกว่า **เพิ่มขึ้น ด้วยความแรงที่ลดลง...เดาไม่ยาก
มันกำลังหมดแรง ขึ้นต่อไม่ไหว...**

ตามภาพของจริง ราคาผันผวน ROC ที่ทำได้ จึงมี noise
สบกวน ควรปรับให้เรียบด้วยการหา SMA ของเส้น ROC อีกทีหนึ่ง



ดังนั้น เราคาดว่าหุ้นน่าจะ**ขึ้น** เมื่อ SMA ของ ROC เริ่ม
เพิ่มขึ้น (กำลังเร่งขึ้น...น่าซื้อ) และหุ้นน่าจะ**ลง** เมื่อ SMA ของ ROC
เริ่มลดลง (น่าขาย)

การจะรู้ว่า SMA ของ ROC กำลังเพิ่มหรือลด ง่ายๆ ก็
สร้างเส้น **Signal*** ตามแบบเดียวกับเครื่องมือ MACD

การที่ราคาหุ้น ยังเพิ่มขึ้นอยู่หรือลงอยู่ แต่ด้วยความเร็วที่
ลดลง การไม่สอดคล้องกันแบบนี้ ก็เหมือนการวิเคราะห์ divergence
ที่เราคุ้นเคยนั่นเอง จารยต์ขอตั้งชื่อว่า

“Inside Divergence”

*Signal คือเส้นที่สร้างจากค่าเฉลี่ยเคลื่อนที่ของ MACD

ทำไม Inside Divergence

มาถึงช่วงที่หลายๆ คนชอบใจ...ผู้อ่านบางคนหลังไม่คามาบอกว่า จารย์ตีเล่นให้วิธีแบบนี้ ไม่กลัวคนอ่านเอาไปใช้ทำไมกันหรือ บอกเลยครับว่า การได้เห็นนักลงทุน นำเงินจากข้างนอกที่หามาแบบเลือดตาแทบกระเด็น ลงทุนในหุ้นแล้วออกเลย ไม่เกิดลักษณะทุนหาย ทำไรหัด...แค่นี้จารย์ดีก็สูงใจแล้วครับ

ปัญหาที่สำคัญที่สุด คือ...วินัยที่จะทำตามระบบอย่างสม่ำเสมอ ไม่แอบชนระหว่างทาง...แค่นี้ทำได้หรือเปล่า ???

อย่าเสียเวลา ไปดูเงื่อนไขกันครับ

เครื่องมือ

1. ROC 25 วัน : ความเร็วในการเปลี่ยนราคาในระยะ 1 เดือน
2. SMA(ROC) 15 วัน : ทำให้เรียบด้วยระยะ 1/2 เดือน
3. SMA(SMA (ROC)) 5 วัน : สร้างเส้น signal โดยเฉลี่ย 1 สัปดาห์

เงื่อนไข

สัญญาณซื้อ เมื่อ SMA (ROC) ตัด signal ขึ้น

สัญญาณขาย เมื่อ SMA (ROC) ตัด signal ลง และห่างจากวันที่ซื้อมา ไม่น้อยกว่า 3 วัน

ลงมือซื้อขาย

ซื้อขายที่ราคาเปิดในวันทำการถัดจากวันที่มีสัญญาณ

ทดสอบย้อนหลังช่วงปี 2000-2019 รวม 20 ปี บนดัชนี SET Index

ผลลัพธ์ ของระบบ Inside Divergence

สร้างกำไรอวกาศ...เงินตั้งต้น 1 ล้านบาทเป็น 4.3 ล้านบาท

หรือสร้างผลตอบแทนได้เพิ่มขึ้นจากการซื้อแล้วถือเฉยๆ ถึง 40%

สร้างความเบิกบาน...ความแม่นยำ หรือ %Win ของระบบ

คำคมเขียนหุ้น



ไมเคิล ไฮเดนเบิร์ก (Michael Zeidenberg)

Inside Divergence อยู่ที่ 53.4% ทำให้เมื่อลงทุนแล้ว ได้เบบอย่าง

คลายความกดดัน...ความทุกข์จากการลงทุน คือการเห็นทุนหายทำไรหัด โดยเฉพาะช่วงที่ตลาดตกต่ำ

ระบบนี้ช่วยลดความทุกข์ลง เพราะลดความเสียหายในช่วงที่ตลาดตกต่ำ ลงได้ครั้งหนึ่งเลยก็เดียว คือลด MaxDD ของตลาดที่ 58% ลงเหลือ 29%

ภาพด้านล่าง แสดงเปรียบเทียบเงินทุนที่เปลี่ยนแปลงตลอดช่วงเวลา 20 ปี ระหว่างการซื้อและถือ (สีแดง) กับการเทรดด้วยสัญญาณ Inside Divergence (สีเขียว)

ด้วยจุดตั้งต้น 1 ล้านบาทเท่ากัน แต่ปลายต่างกัน และช่วงที่กราฟสีแดง (ซื้อแล้วถือ) ลดลง กราฟสีเขียวค่อนข้างทรงตัว หรือน้อยกว่า ความผันผวนลดลงได้อย่างชัดเจน



ข้อควรระวัง

ในมุมมองของจารย์ดี ระบบนี้ไม่เหมาะกับการเทรดหุ้นรายทอที่อยู่ ก็กระชากรุนแรงแบบไร้เหตุผล ดังนั้นจึงแนะนำให้ใช้กับหุ้นในกลุ่ม SET50/SET100 หรือตราสารเกี่ยวกับดัชนีจะมีประสิทธิภาพกว่า ขอให้ทุกท่าน มีความสุขกับการลงทุน...แล้วพบกันใหม่ฉบับหน้าครับ...จารย์ดี

“หากไม่มีอะไร...เปลี่ยนไป
คงไม่มีสิ่งใด...
...เปลี่ยนแปลง”

“If nothing changes, Nothing will ever change.”

รายงานฉบับนี้จัดทำขึ้นโดยข้อมูลเท่าที่ปรากฏและเชื่อว่าเป็นที่น่าเชื่อถือได้แต่ไม่ถือเป็นการยืนยันความถูกต้องและความสมบูรณ์ของข้อมูลนั้นๆ โดยบริษัทหลักทรัพย์ ยูเอสบี เคย์ ฮียน (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) ผู้จัดทำขอสงวนสิทธิ์ในการเปลี่ยนแปลงความเห็นหรือประมาณการต่างๆที่ปรากฏในรายงานฉบับนี้ โดยไม่ต้องแจ้งล่วงหน้า รายงานฉบับนี้มีวัตถุประสงค์เพื่อใช้ประกอบการตัดสินใจลงทุนของนักลงทุน โดยไม่ได้เป็นการชี้นำชักชวนให้นักลงทุนทำการซื้อหรือขายหลักทรัพย์ หรือตราสารทางการเงินใดๆ ที่ปรากฏในรายงาน