

เจาะลึก Technical ตอน เทรดหุ้นเหนือเมฆ (2)

กลับมาพบกันอีกครั้ง หลังจากหยุดพักยาวช่วงปีใหม่ หวังว่าท่านนักลงทุนคงได้ไปชาร์ตไฟมาเต็มที่ พร้อมทั้งจะทำงานและลงทุนในปี 2557 กันแล้ว ถึงแม้ว่าเมื่อสัปดาห์ก่อนเปิดมาวันแรกของปีตลาดจะไม่ค่อยสดใสสักเท่าไร แต่วาระระยะทางยังอีกไกลครับ สงครามยังไม่สงบอย่าเพิ่งนับศพทหาร

ฉบับนี้จะมาพูดถึงวิธีการใช้งาน Ichimoku Clouds กันครับ สำหรับรายละเอียดที่มาที่ไป ของเส้นแต่ละเส้น กล่าวไปเมื่อฉบับที่แล้วแล้วเรียบร้อยนะครับ

บอกแนวโน้มด้วย Clouds

เริ่มมองที่ภาพแนวโน้มใหญ่ก่อน สำหรับคนที่ชื่นชอบการลงทุนสไตล์ Trend Following คงจะคุ้นกันดีกับการดูการเรียงตัวของเส้นค่าเฉลี่ยอย่างรูปตัวอย่างด้านล่าง ในวงกลม



เมื่อเส้นค่าเฉลี่ยมีการเรียงตัวกันตามลำดับวันที่ใช้ เช่น ในแนวโน้มขาขึ้น จะเรียงโดย ราคาอยู่บนสุด ตามด้วยเส้นค่าเฉลี่ยที่มีจำนวนวันน้อยเรียงไปหาวันมาก ส่วนตอนขาลงราคาก็ลงก่อนและตามด้วยเส้นจำนวนวันน้อย โดยเส้นที่จำนวนวันมากที่สุดจะอยู่รั้งท้ายลงช้าที่สุด สำหรับกรณีที่แนวโน้มเริ่มไม่ชัดเจน มีการขอลตัว หรือถึงขั้นไร้แนวโน้ม เส้นก็จะพันกันสับสนไปหมด

ดังนั้น ใน Ichimoku Clouds ก็ทำให้ดูง่ายๆ โดยใช้ 1 เส้น กับ 1 พื้นที่ คือ ราคา และพื้นที่เมฆ (เส้น Leading Span ทั้งสอง)

โดยในแนวโน้มขาขึ้น ราคาก็จะยืนเหนือก้อนเมฆ ส่วนในแนวโน้มขาลง ราคาก็จะอยู่ใต้ก้อนเมฆ เรียกได้ว่ามองแวบเดียวก็รู้ได้ทันที



สำหรับช่วงที่แนวโน้มไม่ชัดเจน ราคาก็จะวนอยู่ภายในก้อนเมฆ เพื่อรอจังหวะเบรคออกมาก

ส่วนเรื่องความแรงของแนวโน้มนั้น ให้ดูจากสีของก้อนเมฆว่าสอดคล้องหรือไม่ เช่น ในขาขึ้น เมื่อราคาอยู่เหนือก้อนเมฆ หากก้อนเมฆเป็นสีเขียว ก็จะแสดงถึงแนวโน้มขาขึ้นที่ชัดเจนขึ้น กลับกันในขาลงก้อนเมฆเป็นสีแดง ก็จะมีการลงที่รุนแรงกว่า

การบอกแนวรับแนวต้าน

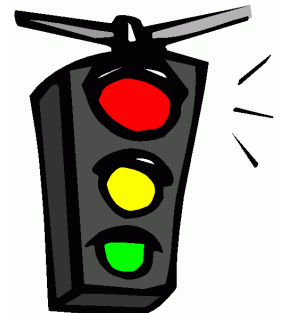
เนื่องจากเราใช้ Clouds เป็นตัวบอกทิศทางของแนวโน้ม และ Clouds นี้ก็คิดมาจากค่าเฉลี่ยของราคาในระยะกลางและยาว ดังนั้น เราจึงใช้ Clouds เป็นระดับแนวรับแนวต้านได้อีกด้วย

โดยในแนวโน้มขาขึ้น Clouds ก็จะทำหน้าที่เป็นแนวรับ และในแนวโน้มขาลงก็จะทำหน้าที่เป็นแนวต้าน

นอกจากนี้ในแนวโน้มขาขึ้น หาก Leading Span A (ขอบบนของเมฆก่อนเขียว) ยกตัวขึ้นตามราคา ก็เหมือนมีแนวรับที่ปรับดันตามราคาขึ้นไปนั่นเองครับ

การบอกสัญญาณซื้อขาย

สำหรับกราฟ Ichimoku Clouds นี้ให้สัญญาณได้ 2 ระดับ คือ สัญญาณการซื้อขายตามแนวโน้ม (Trend) และสัญญาณการซื้อขายตามแรงเหวี่ยง (Momentum) ลงมาดูแต่ละแบบกันครับ



1. การซื้อขายตามแนวโน้ม (Trend Following)

- แบ่งสัญญาณซื้อออกเป็น 2 ระดับ คือ
- สัญญาณนำ เมื่อจากราคาที่แหวกก้อนเมฆขึ้นไปด้านบนได้
- สัญญาณสนับสนุน เมื่อก้อนเมฆเปลี่ยนจากสีแดงเป็นสีเขียว (เส้น Leading Span A ตัดเส้น Leading Span B ขึ้น)

2. การซื้อขายตามแรงเหวี่ยง (Momentum)

- แบ่งสัญญาณซื้อออกเป็น 2 ระดับเช่นกัน คือ
- สัญญาณนำ เมื่อจากราคาตัดเส้น Base Line (Kijun-sen) ขึ้น
- สัญญาณสนับสนุน เมื่อเส้น Conversion Line (Tenkan-sen) ตัดเส้น Base Line (Kijun-sen) ขึ้น

ส่วนแต่ละสัญญาณ จะถูกต้องหรือแม่นยำสักแค่ไหน

ผมได้ลองทดสอบให้เรียบร้อยแล้วครับ มาดูผลกันเลยดีกว่า
ข้อมูลที่ใช้ทดสอบ คือ SET Index ตั้งแต่ต้นปี 2004 จนถึงสิ้นปี 2013 รวม 10 ปี ดัชนีจาก 774.19 จบที่ 1298.71 จุด คิดเป็นผลตอบแทนรวม 67.75% หรือตก 5.3% ต่อปี (ไม่นับเรื่องเงินปันผล) ถ้าเงินต้น 10,000 จะไปจบที่ 16,775 บาท

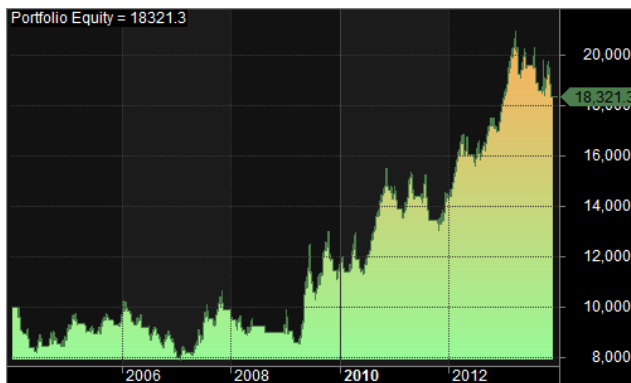
สัญญาณซื้อขายรอบสั้น ตามแรงเหวี่ยง

1. ใช้การตัดของ ราคา และเส้น Base Line (Kijun-sen) เป็นตัวบอกสัญญาณซื้อขาย คือ

ราคาปิดตัดเส้น Base Line (Kijun-sen) ขึ้น ก็ซื้อ
ราคาเปิดเช้าวันรุ่งขึ้น และเมื่อ

ราคาปิดตัดเส้น Base Line (Kijun-sen) ลง ก็ขายที่
ราคาเปิดเช้าวันรุ่งขึ้นเช่นกัน
นี่คือผลลัพธ์ที่ได้ครับ

| | |
|------------------|-------|
| ซื้อ/ขาย (ครั้ง) | 92 |
| % Win | 30 |
| กำไร (%) | 83.21 |
| กำไรต่อปี (%) | 6.25 |



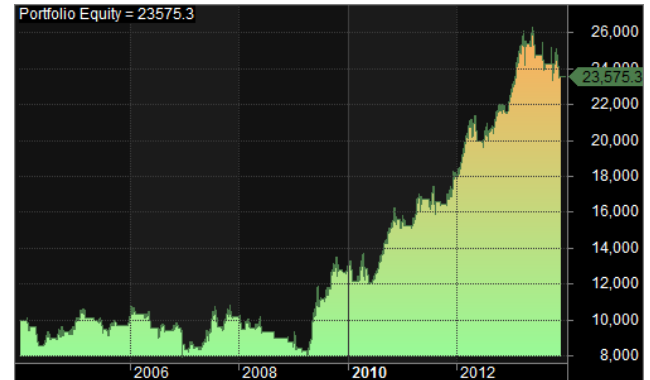
เงินต้น 10,000 จะไปจบที่ 18,321 บาท เรียกได้ว่า
ชนะดัชนีนิดหน่อยครับ

2. ใช้การตัดของ เส้น Conversion Line (Tenkan-sen) และเส้น Base Line (Kijun-sen) เป็นตัวบอกสัญญาณซื้อขาย
นี่คือผลลัพธ์ที่ได้ครับ

| | |
|------------------|--------|
| ซื้อ/ขาย (ครั้ง) | 46 |
| % Win | 43 |
| กำไร (%) | 135.75 |
| กำไรต่อปี (%) | 8.97 |

จะเห็นว่า จำนวนครั้งที่เกิดสัญญาณจะลดลง (เพราะ

เส้น Conversion Line วิ่งช้ากว่าราคา แต่ว่าเข้าทำนอง ช้าแต่ชัวร์ จึงมีความแม่นยำกว่า ผลรวมดีกว่าแบบแรก คือเงินต้น 10,000 จะไปจบที่ 23,575 บาท



สัญญาณซื้อขายรอบยาว ตามแนวโน้ม

1. ใช้การตัดของ ราคา และก้อนเมฆ Cloud (Kumo) เป็นตัวบอกสัญญาณซื้อขาย คือ

ราคาปิด พ้นก้อนเมฆ (ไม่ว่าสีใดก็ตาม) ขึ้นไปด้านบน ก็ซื้อราคาเปิดเช้าวันรุ่งขึ้น

ราคาปิด ตกกลับมาในก้อนเมฆ (ไม่ว่าสีใดก็ตาม) ก็ขายราคาเปิดเช้าวันรุ่งขึ้น

ได้ผลลัพธ์ คือพอร์ตจะไปจบที่ 20,726 บาท

| | |
|------------------|--------|
| ซื้อ/ขาย (ครั้ง) | 49 |
| % Win | 38 |
| กำไร (%) | 107.26 |
| กำไรต่อปี (%) | 7.57 |

2. ใช้สีเมฆในการเทรด คือ ซื้อเมื่อเมฆเป็นสีเขียว และขายเมื่อเมฆเป็นสีแดง

ได้ผลลัพธ์ คือพอร์ตจะไปจบที่ 16,496 บาท

| | |
|------------------|-------|
| ซื้อ/ขาย (ครั้ง) | 27 |
| % Win | 62 |
| กำไร (%) | 64.96 |
| กำไรต่อปี (%) | 5.14 |

โดยส่วนตัวแล้ว ผมว่าวิธีแรกของทั้ง 2 แบบ ไม่สู้ดีนัก เพราะการใช้ราคา สัญญาณจะเกิดง่ายไป ไม่ค่อยแม่นยำ

สำหรับวิธีที่ 2 ของแบบที่ 2 นั้น แม้ผลตอบแทนจะดูน้อย แต่แม่นยำสูง ซึ่งในทางปฏิบัติ อาจหาสัญญาณลงทุนเพิ่มจากหลักทริพย์ตัวอื่นต่อ แทนที่จะรอสัญญาณจากหลักทริพย์ตัวเดียว ก็จะทำให้เงินได้ทำงานหลายรอบขึ้นครับ...จารย์ดี

รายงานฉบับนี้จัดทำขึ้นโดยข้อมูลเท่าที่ปรากฏและเชื่อว่าเป็นที่น่าเชื่อถือได้แต่ไม่ถือเป็นการยืนยันความถูกต้องและความสมบูรณ์ของข้อมูลใดๆ โดยบริษัทหลักทรัพย์ ยูเอสบี เคย์ ฮีเนียน (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) ผู้จัดทำขอสงวนสิทธิ์ในการเปลี่ยนแปลงความเห็นหรือประมาณการณี่ต่างๆที่ปรากฏในรายงานฉบับนี้ โดยไม่ต้องแจ้งล่วงหน้า รายงานฉบับนี้มีวัตถุประสงค์เพื่อประกอบการตัดสินใจของนักลงทุน โดยไม่ได้เป็นการชักชวนให้นักลงทุนทำการซื้อหรือขายหลักทรัพย์ หรือตราสารทางการเงินใดๆที่ปรากฏในรายงาน