

TRADING CONCEPT ตอน มนุษย์ค้างคาว

“ห่วงเรอกินซูป กินซูปค้างคาว” พี่ตึก ซีโร่ เคยร้องเตือนไว้เมื่อ 30 ปีที่แล้ว ใครจะเชื่อว่าวันนี้ เชื้อไวรัสโคโรนาสายพันธุ์ใหม่ ซึ่งยืนยันกว่า 85% มีความคล้ายกับเชื้อไวรัสโคโรนาที่พบในค้างคาว จะคร่าชีวิตคนไปแล้วกว่าพัน เจ็บป่วยกว่าครึ่งแสน และกระทบกับวิถีชีวิตผู้คนทั้งรายนแบบไม่เลือกหน้านับพันล้านคนเลยทีเดียว

กระทบแค่นั้น เอาจริงๆ หากเดือนนี้จารย์ตั้งจะจัดรดกั้วรชัคคิน ชวนท่านนักलगกุน ไปทำบุญที่วัดหลวงพรหมาวาส พนัสนิคม ชลบุรี พร้อมชมค้างคาวแม่ไก่เป็นพันๆตัว...จารย์ตั้งว่าได้สักครั้งคืนก็เก่งแล้ว



ช่วงนี้ ด้านนอก...ค้างคาว...อาจดูน่ากลัว แต่ด้านใน (ตลาดหุ้น)...ค้างคาว...ช่วยเรียกทรัพย์ได้ ทำได้ยังไง ฉบับนี้จารย์ตั้งมีคำตอบให้แน่นอน

Trend vs Non-Trend

ถ้าถามท่านนักलगกุนว่า

ตลาดแบบไหน เทรดกำทำไร้ง่ายที่สุด ??

1. ตลาดที่มีแนวโน้ม (Trend)
2. ตลาดไร้แนวโน้ม (Non-Trend) หรือ Sideways

เชื่อว่า แทบร้อยละร้อย ชอบตลาดมีแนวโน้มมากกว่า เพราะกำทำไร้ง่ายได้เต็มเม็ดเต็มหน่วย แถมไม่ต้องยึกยัก เข้าๆ ออกๆ โดยเฉพาะนักलगกุนสายเทคนิค ที่สอนต่อๆ กันมาว่า

“ซื้อแพง...แล้วหวังไปขายแพงกว่า”

แต่สิ่งที่ต้องเผชิญจริงๆ คือ

“ซื้อแพง...ขายถูก” (คัทลอส)

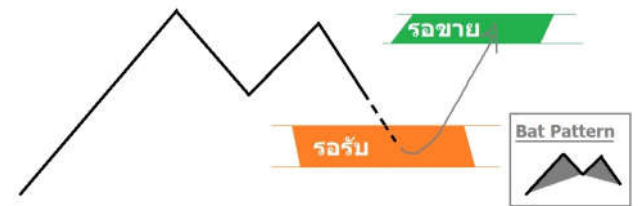
“ซื้อแพง...ขายถูก” (คัทลอส)

“ซื้อแพง...ขายถูก” (คัทลอส)

เรียกได้ว่า ต้องกัดฟันทน จนฟันหัก แนวโน้มจริงก็ยังไม่มา ชักที จะไม่ซื้อก็กลัวตกรถ เดี่ยวแนวโน้มจริงมา จะอดทำไรชุดใหญ่ไป ชดเชยที่เสียไปทั้งหมด (กลยุทธ์ Trend Following มี %Win ต่ำ)

พี่ค้างคาวจะมาช่วยเราตรงนี้ครับ

เดิมปัญหาคือช่วง sideways นั้น ราคาวิ่งไปไม่ไกล การใช้เทคนิคอย่างเส้นค่าเฉลี่ย หรือกลยุทธ์ break high อย่าง Donchian channel จะเข้าซื้อได้ช้าเกินไป เข้าเป็นโดน เพราะเข้าตอนราคาใกล้จะถลาลงแล้ว แต่พี่ค้างคาวจะมาช่วยเสริมให้เราทำกำไรมาชดเชยในช่วงที่ตลาดไม่มีแนวโน้ม ทำยังไง...มาดูแนวคิดก่อน



เป้าหมายของวิธีนี้ คือ หาววิธีเข้าซื้อให้เร็วที่สุด

จากภาพตัวอย่างด้านบน เราจะหาวิธีวัดระยะ- เพื่อสร้างพื้นที่โซนสีส้ม (ปลายปีกด้านขวาของค้างคาว) และรอเข้าซื้อเมื่อมีสัญญาณกลับตัวเช่นจากแท่งเทียนในบริเวณนี้ และวัดระยะ- เพื่อสร้างพื้นที่โซนสีเขียว (ราคาเป้าหมายของ bat pattern) รอขายกำทำไร

กรณีที่ราคาขึ้นไปต่ออีก เราอาจขายหยุดด้วยกลยุทธ์นี้ แต่ก็ได้กำทำไรเป็นกอบเป็นกำ จากกลยุทธ์ตามแนวโน้มแบบอื่น มาดูวิธีวัดระยะ- เพื่อสร้างโซนทั้งสองกันดีกว่าครับ

The Bat Pattern

ถูกนำเสนอโดย Scott M. Carney ซึ่งหลักการวัดระยะ-นั้น จะใช้ตัวเลขของ Fibonacci มาช่วย (สามารถอ่านเพิ่มเติมได้จากบทความ Technical Magic ฉบับที่ 23-27) ดังนี้

1. จุด B ทำ Retracement ลงมาจาก XA ในช่วง 38.2-50%

ภาพตัวอย่าง จุด B ย่อตัวลงจากยอด A เป็นระยะ 50%



2. จุด C ทำ Retracement จากช่วง AB ในช่วงระยะ 38.2-88.6%



ภาพตัวอย่าง จุด C ย่อตัวลงจากยอด B เป็นระยะ 61.8%

3. โซนเป้าหมายที่จะเกิดจุด D ดูจาก 3 ปัจจัย

- 3.1 Retracement ของ XA ที่ 88.6%
- 3.2 Extension ของ CB ที่ 161.8-261.8%
- 3.3 CD = AB หรือมากกว่า

ภาพตัวอย่าง พื้นที่เป้าหมาย ที่ช่วงของราคาที่สุดคล้องกับทั้ง 3 ปัจจัย โดยเรียกว่า **Potential Reversal Zone (PRZ)**



4. โซนเป้าหมายของจุดทำกำไร/คัทลอส

เมื่อจุด D เกิดขึ้นแล้ว ก็กำหนดระยะสำหรับ ทำกำไรขึ้นต้น และระยะคัทลอส ดังนี้

4.1 จำกัดขาดทุน **Stop Loss Zone (SLZ)** คือ ระดับราคาใต้พื้นที่เป้าหมาย การที่ราคาลงมาแตะระดับนี้ แสดงว่า PRZ ที่เรากำหนดไว้ล้มเหลว ราคาไม่ได้เกิดการกลับตัว

4.2 ทำกำไร

Profit Protection Zone (PPZ) คือ ระดับราคาสำหรับแบ่งขายทำกำไร เพื่อให้มั่นใจว่า การเทรดรอบนี้จะไม่พลิกกลับเป็นขาดทุน โดยอาจกำหนดด้วย เส้น AC, หรือระยะ Retracement ของช่วง AD ที่ 38.2 หรือ 61.8%

Let Profit Run คือ ให้หุ้นอีกครั้งที่ยังค้างอยู่ในพอร์ตเก็บกำไรให้มากที่สุด โดยสามารถใช้ระยะ Retracement 38.2% จากระยะ D ถึงยอดสูงสุดที่ราคาทำได้ เป็นช่วง Trailing Stop



ตัวอย่างจากภาพ เมื่อเราได้จุด D และเข้าซื้อแล้ว

ใช้พื้นที่ใต้เส้น **SLZ** สี่เหลี่ยมด้านล่าง เป็นจุดตัดขาดทุน (เส้น SLZ อยู่ใต้ พื้นที่เป้าหมาย ในภาพที่แล้ว)

ลาก Retracement ของ AD ระยะ 38.2% และ 61.8%

ลากเส้น AC ต่อลงมาเป็นเส้นแนวต้าน

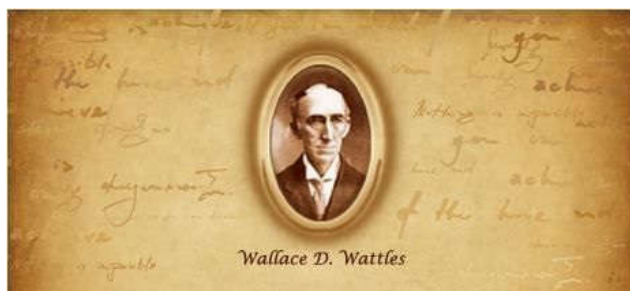
ทำให้ได้พื้นที่สี่เหลี่ยม เป็นพื้นที่เป้าหมายแรกของการทำกำไร เพื่อปิดความเสี่ยงขาดทุนของพอร์ต

Harmonic Pattern เมื่อค้างคาวกลายเป็นจิ้งจอก

อ่านมาถึงตรงนี้ บางคนอาจคิดว่า เงื่อนไขขนาดนี้ แล้วเวลาจริงๆ ราคาจะเข้าเงื่อนไขทั้งหมดได้หรือ...

แน่นอนว่า ไม่ทุกครั้งครับที่ราคาจะเข้าเงื่อนไขทั้งหมด ดังนั้นรูปแบบ **Bat Pattern** นี้ จึงถูกแตกออกเป็นรูปแบบย่อยอื่นๆ แม้จะมีความแตกต่างกันเพียงเล็กน้อย แต่นำไปสู่ การวัดพื้นที่เข้าซื้อและพื้นที่ทำกำไรที่แตกต่างกันไป โดยรูปแบบย่อยๆ ทั้งหมดนี้ รวมเรียกว่า **Harmonic Pattern** ไว้ฉบับหน้าจะมาเล่าให้ฟังต่อครับ...จารย์ดี

คำคมเขียนหุ่น



วอลเลซ วัตเทิลส์ (Wallace D. Wattles)

“มันอาจ...จำเป็น
สำหรับการมีเครื่องมือที่ดี
แต่มัน...จำเป็นอย่างยิ่ง
สำหรับการใช้มันอย่างถูกวิธี”

“It is essential to have good tools, but it is also essential that the tools should be used in the right way.”

รายงานฉบับนี้จัดทำขึ้นโดยข้อมูลเท่าที่ปรากฏและเชื่อว่าเป็นที่น่าเชื่อถือได้แต่ไม่ถือเป็นการยืนยันความถูกต้องและความสมบูรณ์ของข้อมูลใดๆ โดยบริษัทหลักทรัพย์ ยูเอสบี เคย์ ฮีเนียน (ประเทศไทย) จำกัด (สมาชิก) ผู้จัดทำขอสงวนสิทธิ์ในการเปลี่ยนแปลงความเห็นหรือประมาณการในครั้งถัดๆไปที่ปรากฏในรายงานฉบับนี้ โดยไม่ต้องแจ้งล่วงหน้า รายงานฉบับนี้มีวัตถุประสงค์เพื่อใช้ประกอบการตัดสินใจของนักลงทุน โดยไม่ได้เป็นการชี้แนะชักชวนให้นักลงทุนทำการซื้อหรือขายหลักทรัพย์ หรือตราสารทางการเงินใดๆ ที่ปรากฏในรายงาน