

TRADING CONCEPT ตอน ทำไรผัว?...อาจซิลลกว่า

โลกนี้ล้วนหลอกลวง เดือนนี้กองทุนต่างประเทศหลายกองที่เคยทำตัวเป็นพระเอก เริ่มออกอาการผู้ร้ายให้เห็น

ในภาวะที่ตลาดผันผวน เงินทุนไหลเปลี่ยนกลุ่มกันให้วุ่น บางทีการล้มตัวลงบนหมอนโดยไม่ได้ถือสถานะใดๆ ไม่ต้องไปพะวงว่า FED จะออกมาประกาศอะไร อาจทำให้เรานอนหลับได้สบายกว่า

วันนี้ จารย์ตี เลยจะมานำเสนอเทคนิคการลงทุนอีกแบบหนึ่งที่ไม่ใช่ทั้งการถือยาวเพื่อรีเทิร์นถาวรอย่างโลกสวย และก็ไม่ใช่การเข้าบิ้นสวนกรนเหมือนหมูไม่กลัวน้ำร้อน แต่เป็นกลยุทธ์ที่เรียกว่า **Scalping** จะมีจุดเด่นจุดด้อยอย่างไร และใช้เครื่องมืออะไรประกอบ ไปดูกันครับ



ทำไมต้อง Scalping

เรื่องมันเริ่มที่เราอุตสาหกรรมเจอหุ้นเห็ดสักตัว ถือจนรวยอยู่หลายปี (let profit run) หวังมันยิ่งกว่าแฟน แต่พอเหตุการณ์ไม่คาดคิด หรือโควิดมาเยือน ไม่ใช่แค่ทำอะไรหมด แต่ทุนก็หดด้วย

ถึงจะจัดพอร์ต แบ่งถือสรรสินทรัพย์กระจายแค่นั้น ยามดวงแตก โชคร้ายมาเยือนได้เสมอ ความเสี่ยงมีได้ตลอด เสี่ยงยากตราบเท่าที่ยังมีสถานะ (เช่นถือหุ้นอยู่) เรียกกันว่ามี Risk Exposure เหตุไม่คาดฝัน ที่เป็นฝั่งลบ (Adverse Events) จึงทำร้ายเงินเราได้

ทางหนึ่งที่จะจำกัดความเสี่ยงแบบนี้ คือ...อย่าไปถือ หรือ**เอาตัวไปอยู่ในจุดที่มีความเสี่ยง...ให้น้อยที่สุด**

ยามซื้อหุ้น ก็ถือเพียงเวลาสั้นๆ...ทำนองเข้าเร็วออกไว ใจเย็นนะครับ...นี่ไม่ใช่ แคกลยุทธ์หาค่ากับข้าว

Scalping มีอะไรดีกว่านั้นอีกเยอะครับ

Scalping เห็นอนาคตง่าย

นอกจากเรื่อง **limit risk** แล้ว ข้อดีอีกอย่างที่จารย์ตีชอบวิธีนี้ คือ เล่นง่าย (ตอนนี้คุยข้อดีกันก่อน ส่วนข้อเสียค่อยเล่า 55)

การถือสั้นๆ เข้าเร็วออกเร็ว แปลว่า ระยะจากราคาเข้า ไปถึงราคาออกไม่ต่างกันมาก...แบบนี้ **คาดการณ์อนาคตง่าย**

ลองนึกถึงรถสักคัน วิ่งผ่านหน้าบ้านเรา การจะบอกว่ารถคัน

นี้ จะวิ่งไปทางเดิมอีก 100 เมตร น่าจะคาดเดาได้ง่ายกว่า การจะไปพันรงว่า รถนั้นต้องไว้ไปทางเดิมอีก 100 กิโลเมตร โดยไม่เปลี่ยนแปลง

ใครจะรู้...100 กิโลเมตรข้างหน้า อาจมีเหตุการณ์อื่นๆ มีจุดแวะพัก มีที่หมาย หรือแม้แต่การรถกลับ

แต่สำหรับ...แค่ระยะ...100 เมตรข้างหน้า โอกาสเกิดเหตุการณ์ที่วุ่นน้อยกว่ามาก ว่าไหมครับ



ราคาหุ้นก็เช่นกัน การที่เห็นหุ้นสักตัว วิ่งจาก 9.80 บาท มาที่ 10 บาท อย่างร้อนแรง ถ้าจะเหมาว่ามันจะไปต่อถึง 10.20 บาทคงมีโอกาสดูกสูงกว่า การไปรอขายที่ 20 บาท มากนัก

ระยะไกลๆ ต้องอาศัยทั้งพื้นฐานกิจการ ภาวะตลาด ฯลฯ แต่**แค่ระยะไม่กี่ช่อง แทบจะเป็นผลของอารมณ์ตลาดตอนนั้นส่วนๆ**

Scalping ได้ทำไรน้อย

เมื่อรู้แล้วว่า **Scalping** ช่วย **limit risk** แคมแคดการณื เป้าหมายง่าย ไม่ค่อยผิดพลาด เลยทำให้ค่า **%Win** สูงอีก

แต่ การออกไว ทำไรน้อย ทำให้พอร์ตมี**ผลตอบแทนรวมต่ำ** นักเทรดสาย **Scalping** ยังพอมี**หลายวิธีเข้าช่วย** เช่น

- เทรดด้วยไม้ที่ใหญ่ ทั่วไปเข้าออกด้วยไม้เดียว หรือถึงขั้นใช้ leverage มาช่วย

- เทรดด้วยจำนวนครั้งที่มาก อาจใช้เครื่องมือที่เกดสัญญาณซื้อขายบ่อย หรือ ใช้

ทุนก้อนเดียว ฝารอโอกาสทำ **Scalping** ในหุ้นหลายๆ ตัว พร้อมกัน



จุดด้อยของ Scalping

สิ่งแรกที่ต้องระวังคือ **ต้นทุน** ถึงเราพอใจแค่ทำไรสั้นๆ แต่ค่าธรรมเนียมซื้อขายไม่ได้สั้นไปด้วย ดังนั้น ต้นทุนการซื้อขาย จึงนับเป็นปัจจัยสำคัญมากอันดับต้นๆ

ต่อมาคือ ต้อง**ควบคุม risk/reward** ให้ดี เนื่องจากทำไรที่

สั้นมาก ดังนั้นจึงต้องควบคุมส่วนของ risk ให้สั้นด้วย
จากหัวข้อก่อนด้วย %Win ที่สูงกว่า 50% แต่เราควบคุมให้
Risk/Reward Ratio ไม่เกิน 1 ก็สามารถรับระบบนี้ให้รอดได้แล้ว
ปกติจึงนิยม กำหนดระยะกำไรให้เท่ากับระยะคัทลอส
เตือนก่อนว่า ใครเล่นหุ้นแล้ว **คัทลอสไม่เป็น...** ไม่จ่ายไม่
ขาดทุน วิธี **Scalping** อาจเป็นหนทางสู่ **หายหน้า** สำหรับท่านได้

การนำไปใช้

เท่าที่เห็นจะใช้สองแบบ สายไหน ก็จัด **Scalping** เป็นกลยุทธ์
หลักไปเลย อันนี้ต้องแม่น และมีวินัยอย่างสูง ฝึมาจอตลอด...เครียด
อีกแบบจารย์ที่ชอบกว่า เพราะสบายใจ คือใช้ประกอบพอร์ต
ที่ถือลงทุน แทนที่จะถือตลอด อาจแบ่งครึ่งหนึ่ง มาเก็บจังหวะ
Scalping เพื่อเก็บกำไรเอาไปลดต้นทุนลงได้ โดยเฉพาะช่วงที่หุ้นพักตัว
sideway

สำหรับเครื่องมือที่ใช้บอกจังหวะเข้าออกของกลยุทธ์ **Scalping** ก็เช่น

1. เส้นค่าเฉลี่ย

สมมติ ใช้ **SMA 200 วัน บอก Trend ใหญ่** จากนั้นใช้เส้นสั้น
5 และ 20 วัน บอกจุดเข้าทำ **Scalping** (Entry point) โดยใช้จุดต่ำ



สุดก่อนตัดขึ้น เป็นระยะคัทลอส และใช้ระยะเดียวกันกำหนดจุด take
profit (Exit Target) โดยจากภาพ รับบนกราฟ 5 นาที

2. RSI หรือ Stochastic Oscillator

สมมติ ใช้ RSI ปกติ คู่กับเส้น SMA 200 วัน ในกราฟ 5
นาที เช่นเดิม ให้ **SMA 200 วัน บอก Trend ใหญ่** ว่าเป็นขาขึ้น หรือ
จังหวะเข้าซื้อลักษณะ Buy on dip คือรอให้ราคาเกิดการย่อ จน **RSI**
เข้าเขต **Oversold** และเมื่อ **RSI** พลิกกลับมาเหนือ 30 จึงค่อยเข้าซื้อ
ใช้การกำหนดจุดออก เช่นเดียวกับตัวอย่างที่แล้ว



สังเกตให้ดีจะพบว่า ทั้งหมด **จุดเข้าเป็นการเข้าตามแนวโน้ม**
สไตล์ Trend Following ที่ระยะออกสั้น **แต่ไม่ทิ้งกรอบ แต่ก็ไม่สวนเทรน**
หากใครชอบ Stochastic ก็ทำคล้ายกัน โดยอาจใช้การตัด
ของ %K และ %D ในการบอกจุดเข้าก็ได้ครับ

จากที่ลองรีวิวดูด้วยตากับหุ้นหลายตัว พบว่าสัญญาณ
ลักษณะนี้ ถูกต้องเป็นส่วนใหญ่ครับ (Backtest ระยะไกลๆ จะลำบาก
ด้วยข้อจำกัดเรื่องข้อมูลรายนาทีของหุ้น)

ส่วนใครจะลองนำไปใช้ จารย์ต้องย้ำอีกที...ห้ามลืมเรื่อง
วินัยอย่างเด็ดขาดเชียวนะครับ...จารย์ดี

คำคมเขียนหุ้น



อีลอน มัสก์ (Elon R. Musk)

“คุณสามารถ...
รวมไข่ไว้ในตะกร้าใบเดียว
ตราบเท่าที่...
คุณควบคุมสิ่งที่เกิดกับตะกร้าได้”

“It’s OK to have your eggs in one basket as long
as you control what happens to that basket.”

รายงานฉบับนี้จัดทำขึ้นโดยข้อมูลเท่าที่ปรากฏและเชื่อว่าเป็นที่น่าเชื่อถือได้แต่ไม่ถือเป็นการยืนยันความถูกต้องและความสมบูรณ์ของข้อมูลใดๆ โดยบริษัทหลักทรัพย์ ยูโอบี เคย์ เฮียน (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) ผู้จัดทำขอสงวนสิทธิ์ในการเปลี่ยนแปลงความเห็นหรือประมาณการดังกล่าวที่ปรากฏในรายงานฉบับนี้ โดยไม่ต้องแจ้งล่วงหน้า รายงานฉบับนี้มิควรดูประสงคเพื่อใช้ประกอบการตัดสินใจลงทุน โดยไม่ได้เป็นการชี้นำชักชวนให้นักลงทุนทำการซื้อหรือขายหลักทรัพย์ หรือตราสารทางการเงินใดๆ ที่ปรากฏในรายงาน