

TRADING CONCEPT ตอน ของขวัญปีใหม่

๑ ปีใหม่ ๑ สำนักรับ ๑ กว่าปี
มีอะไรให้ ด้วยปี ใหม่
ทั้ง รวด รวด รวด รวด รวด
แต่คนรับ กลับ รวด รวด รวด รวด

ฉบับใหม่ พัดมา หนาวสะท้านไปถึงทรวง หอบคุณมิตรรัก
แฟนเพลง ที่ติดตาม Trading Wizard อย่างเหนียวแน่นจนเข้าปีที่ 9
เชื่อว่าแฟนๆ คอลัมน์น่าจะเข้าสู่สภาพทางการเงินกันเรียบร้อยแล้ว

ส่วนใครที่เพิ่ง ผ่านมาเห็น เข้ามาอ่าน เอากลางทาง
ลองติดตามความรู้ดีๆ แบบนี้ต่อไปนะ
ว่ากันว่า เก่งขึ้นวันละ 1% ปีหนึ่งผ่านไป
จะเทียบคณค่าเดิมถึง 37 เท่าทีเดียว

$$1.01^{365} = 37.8$$

$$0.99^{365} = 0.03$$

ฉบับนี้ จารย์ตีมีของขวัญ
เป็นสูตรหุ้นเด็ด สูตรเก่าแก่...เรียกว่าเป็นกรุสมบัติก็ได้ เอามาฝาก
สูตรหุ้นเด็ดที่ว่าถูกห่อใส่มาในบทวิเคราะห์ มาฝากทุกท่าน
ตลอด 10 ปี จาก 2012 จน 2021 เสียหาย คนมาที่หลังไม่ได้แกะห่อ
ออกดู หรือแกะแล้วอ่านไม่รู้เรื่อง เลยพลาดสมบัตินี้ไป

วันนี้ จารย์ตีเลยจะเอามา unboxed ให้ดูชัดๆ ครับ



The Magic Signal จับสัญญาณหุ้นติดชาร์ต

พูดถึงสูตรลอยน้ำ หรือสูตร 5-3-5 คงเคยผ่านตามาบ้าง
ทาง UTRADE Channel ไม่ว่าจะเป็นช่องทาง Facebook, Telegram
หรือ Line....ใครเคยเห็น แต่ไม่เคยอ่าน...ยกมือขึ้น!!!

มาดูสิ่งที่ท่านพลาดไปกัน...ผลตอบแทนจากหุ้นของทั้ง 2
สูตรนี้ เทียบกับผลตอบแทนดัชนีอ้างอิง เฉพาะปี 63 เป็นต้นไป

SET Index ปีที่แล้ว ซื้อแล้วถือ จะขาดทุน 8.3%

ซื้อขายตาม สูตร 5-3-5 ได้กำไร 11.4%

ซื้อขายตาม สูตร ลอยน้ำ ได้กำไร 30.8%

หรือถ้าวัดยอดสะสมเริ่มจนตอนนี้ รวม 9 ปี ด้วยเงินทุน 1 ล้านบาท

SET Index ซื้อแล้วถือ จนถึงนัฟพอร์ตโตเป็น 1.17 ล้านบาท (ต้น 1
ล้าน บวกกำไร 0.17 ล้าน)

สูตร 5-3-5 พอร์ตโตเป็น 2.13 ล้านบาท

สูตร ลอยน้ำ พอร์ตโตเป็น 4.50 ล้านบาท

เรียกว่าผลตอบแทนมากกว่าตลาด 6 เท่า และ 20 เท่าตามลำดับ

ตย. รายละเอียดผลตอบแทน (ยกมาจากบทวิเคราะห์หุ้นจันทร์ที่ผ่านมา)

ผลตอบแทนย้อนหลังตั้งแต่เริ่มโครงการ			
	SET Index	สูตร ลอยน้ำ	สูตร 5-3-5
ยอดสะสม	17.14%	350.71%	112.99%
ความแม่นยำ		41%	44%
ความคุ้มค่า		2.14	1.54

Period	SET Index	สูตร ลอยน้ำ	สูตร 5-3-5
2012	12.51%	27.24%	
2013	-6.70%	54.11%	9.95%
2014	15.32%	19.23%	26.28%
2015	-14.00%	4.16%	16.01%
2016	19.79%	12.68%	15.33%
2017	13.66%	2.63%	3.22%
2018	-10.82%	19.07%	3.45%
2019	1.02%	2.69%	-3.64%
2020			
Jan	-4.16%	0.41%	1.93%
Feb	-11.47%	-1.21%	-2.74%
Mar	-16.01%	0.47%	-1.33%
Apr	15.61%	11.65%	3.44%
May	3.16%	1.12%	-0.48%
Jun	-0.28%	1.15%	0.62%
Jul	-0.78%	2.69%	-2.38%
Aug	-1.35%	1.83%	3.30%
Sep	-5.62%	1.99%	0.10%
Oct	-3.40%	2.93%	0.93%
Nov	17.86%	3.71%	3.11%
Dec	2.91%	1.01%	4.69%

ตารางแสดงผลตอบแทนแต่ละเดือน และสรุปรวมยอดกำไรแต่ละปี
ยอดกำไรสะสมทั้งหมด โดยใช้หลักการคิดผลตอบแทนแบบทบต้น

(ตย. เดือนธันวาคม 63 ตลาด +2.91% สูตรลอยน้ำได้กำไร 1.01% ส่วนสูตร
5-3-5 ได้กำไร 4.69%)

มาดูคลิกของแต่ละสูตรกัน

ลอยน้ำ		สูตร 5-3-5	
Net Profit	1.006%	Net Profit	4.688%
%Win	50%	%Win	67%
Profit Factor	1.368	Profit Factor	1.170
Max Profit	11.8%	Max Profit	5.4%
Avg Profit	4.7%	Avg Profit	5.1%
Avg Loss	-3.4%	Avg Loss	-4.4%
Max Loss	-3.5%	Max Loss	-8.0%

จากรูป **Net Profit** คือ กำไรรวมในเดือนนั้น (ตรงกับ Dec ภาพแรก)

% **Win** หรือ **ความแม่นยำ** คือ จำนวนหุ้นที่กำไร / จำนวนหุ้นที่เลือก
(ตย. ลอยน้ำ รค. เลือก 8 ตัว ได้กำไร 4 ตัว %Win = 4/8 = 50%)

Max Profit, Avg.Profit คือ กำไรสูงสุด, กำไรเฉลี่ยต่อหุ้น 1 ตัว

(ตย. ลอยน้ำ เดือนรค. มีกำไร 4 ตัวคือ

SPRC +11.8% BEAUTY +4.8%

TPCH +0.8% SGF +1.3%

ดังนั้น Max Profit = 11.8% และ Avg.Profit = 4.7%)

Max Loss, Avg.Loss ก็เป็นหลักการเดียวกันแต่ดูตัวที่ขาดทุน

Profit Factor หรือ **ความคุ้มค่า** คือ เอา Avg.Profit / Avg.Loss

โดยปกติค่านี้น่าจะมากกว่า 1

(ตย. ลอยน้ำ เดือนรค. กำไรเฉลี่ย 4.7% ขาดทุนเฉลี่ย 3.4%

ดังนั้น Profit Factor = 4.7 / 3.4 = 1.368 เท่า)

แต่ละเดือน จำนวนหุ้นที่เลือกน้อย ดังนั้น การดูสโตร์ของ

สูตร ควรดูจากยอดรวมมากกว่า

ภาพแรก **สูตรลอยน้ำ** แม่นยำ 41% คุ่มค่า 2.14 เท่า

แสดงว่า ถูกไม่ถึงครึ่ง แต่เน้นถือจน กินกำไรใหญ่ (**Let Profit Run**)

ส่วน **สูตร 5-3-5** ใช้แล้วสบายใจกว่าหน่อย แม่นยำขึ้น แต่คุ่มค่าน้อยกว่า (แต่ก็ยังเกิน 1) เพราะเน้นเข้าออกไว เก็บกำไรที่ 5% และตัดที่ 3%

ลอยน้ำ และ 5-3-5 คืออะไร

สูตรลอยน้ำ คัดหุ้นที่มีโอกาสแกว่งตัวขึ้นไกล กำหนดแต่จุดถือถาวรด้านข้าง เพื่อจำกัดขาดทุน แต่ไม่จำกัดกำไร

สูตร 5-3-5 คัดหุ้นถึงกำไรระยะสั้น จะมีทั้งจุดทำกำไรและถือถาวรที่ชัดเจน (5% และ 3% ตามลำดับ) จำกัดทั้งกำไรและขาดทุน อยู่ที่ราคากำหนดโดนเป่าไต่ก่อน

ทั้งนี้ หากราคาไปไม่ถึงเป้าใดเป่าหนึ่ง หรือไม่เคลื่อนไหวติดต่อกัน 5 วัน ก็จะขายเช่นกัน

นอกจากนี้จะใช้เทคนิค Trailing Stop ที่ยกจุดถือถาวรตามเมื่อราคาปรับตัวขึ้น

ตย. การอ่านบทวิเคราะห์ 3/12/20 ที่เป็นผลการสแกน ณ สิ้นวันที่ 2/12/20

	สูตรลอยน้ำ	สูตร 5-3-5
Scan วันที่	02/12/20	02/12/20
Last Price	7.65	12.20
Exit Strategy		
1) Stop Loss	7.40	11.80
2) Lock in Profit	-	12.80
3) Let Profit Run		T+5
Alternative	JWD	
Sell		BOL [+5%]

สูตรลอยน้ำ สแกนได้หุ้น SPRC เข้าพอร์ต ที่ราคาปิด 7.65 บาท ณ วันที่ 2/12 กำหนดจุดถือถาวรไว้ที่ 7.40 บาท (JWD เป็นอีกหุ้นที่สแกนเข้าเงื่อนไขแต่คะแนนน้อยกว่า)

รุ่งขึ้นวันที่ 3/12/20 ราคาต่ำสุด 7.60 บาทและปิดที่ 7.95 บาท แสดงว่าระหว่างวันแกว่งไม่ถึงจุดถือถาวรบทวิเคราะห์วันถัดไป จารยตีจึงแจ้งจุดถือใหม่ ซึ่งในที่นี้เป็น 7.75 บาท

วันที่ 4/12/20 ยังขึ้นต่อ ต่ำสุด 7.90 บาท เห็นว่าจุดถือถาวรปิดที่ 8 บาท ก็เลื่อนจุดถือใหม่ตามไปที่ 7.85 บาท

ราคาค่อยๆ ปรับขึ้นไป 8.30 และสูงสุดที่ 8.70 บาท (เขียวยาวแท่งสุดท้าย) จุดถือถูกยกตามไปที่ 8.55 บาท

วันที่ 14/12 ราคาเปิด 8.75 บาท แล้วลงมาจุดถือ 8.55 บาท จึงขายออก ที่ 8.55 บาท

(กรณี เปิด gap ลงแรง ทะลุไปใต้จุดถือเลย ในโมเดลจะถือราคาเปิดที่ต่ำนั้นเป็นราคาขายแทน)



ถ้าปวดหัว ดูภาพด้านบนประกอบครับ

ส่วนจุดถือที่เลื่อน จารยตีจะอัปเดตในบทวิเคราะห์วันถัดไป

อันดับ		Buy		T+1		T+2		T+3		T+4		T+5		Exit Price
No	หลักทรัพย์	Date	Price	P	%	P	%	P	%	P	%	P	%	
1	BGC	02/12/20	11.50	11.30	-2%	11.30	-2%	11.10	-3%					11.10
2	SPRC	03/12/20	7.65	7.95	4%	8.00	5%	8.30	5%	8.70	14%			8.55
3	BEAUTY	04/12/20	1.65	1.65	0%	1.69	2%	1.68	2%					1.64
4	TMB	09/12/20	1.24	1.22	-2%									1.20

สูตร 5-3-5 สแกนได้หุ้น ASIAN ราคาปิด 12.20 บาท ณ วันที่ 2/12 กำหนดจุดถือถาวร 11.80 บาท และจุดทำกำไร 12.80 บาท



จากภาพหลังจากมีสัญญาณ 2 วันราคาแกว่งขึ้นไป 12.40 บาท ซึ่งยังไม่ถึงเป้า ยังไม่เคยอดสูงกว่าที่เลือกเลย จึงไม่มีการยกจุดถือถาวร (การปรับ trailing stop จะดูจากราคาปิด ไม่สนใจไส้เทียน)

พอถึงวันที่ t+4 (วันที่ 4 นับจากวันเกิดสัญญาณ) ตรงกับวันที่ 9/12 ราคาตกลงถึงจุดถือที่ 10.80 บาท จึงขายออก

การถือถาวร หรือขายทำกำไรจะพิจารณา จากราคาระหว่างวัน เช่น เป้า 12.80 บาท หากเปิด 12.50 บาท แล้ววิ่งไปถึง 12.80 บาท ก็ถือว่าขายได้ที่ 12.80 บาท แม้ตอนเย็นจะปิด 13.00 บาทก็ตาม

มาถึงตอนนี้ ทุกท่านคงอดครหาได้สำเร็จ
รู้ประสิทธิภาพและสโตร์ของแต่ละสูตร จากหน้าผลตอบแทน และ
รู้หุ้นที่เลือก และการตั้งจุดขายจากหน้าสแกนรายวัน
เหลือปัญหาสุดท้ายคือ...การซื้อตามสูตร

อยากซื้อตามต้องทำอะไร ?

ปัญหาส่วนใหญ่ เวลาลงทุนตามบทวิเคราะห์คือ...หุ้นเยอะ
หุ้นเด็ดมีทุกวัน...ซื้อตามกัน จนเงินหมด
พอจะเลิกซื้อ...ไอ้ตัวที่ไม่ได้ซื้อ...ดัน...แดง
แต่ก็ซื้อเต็มพอร์ตนั่น...ดัน...ดอย



ยิ่งปวดใจตอนนักวิเคราะห์มาเคลมว่า...ตัวที่เคยให้ไว้ เห็น
ไหม วันนี้ไป 3 เด็งแล้ว...!#?^\$

บางทีก็ไม่รู้ครับว่าผิดที่เราหรือนักวิเคราะห์ แต่
...ปัญหานี้जारยต์ แก้ให้เรียบร้อยแล้ว...

ก่อนอื่น แยกสูตรลอยน้ำ และ 5-3-5 ออกจากกันนะครับ
สมมติจะจัดพอร์ตตามสูตรลอยน้ำ จารยต์จะใช้หลักการดังนี้
เรื่องแรก...การแบ่งเงิน ให้แบ่งเงินในพอร์ตออกเป็น 5 ไม้

สมมติวันแรก ซื้อหุ้นตัวที่ 1 แสดงว่า พอร์ตจะประกอบด้วย
เงิน 80% และหุ้น 20% (สังเกตนะครับ หากตลาดกระชากแรงๆ พอร์ตเราจะ
แกว่งมากกว่า ทั้งฝั่งบวกและลบ เพราะถือหุ้นเพียง 20%)

หากวันต่อมา มีสัญญาณอีก ก็ค่อยๆ เก็บตัวอื่นเพิ่ม แต่จะ
ไม่มีครั้งใดที่ในพอร์ตจะถือหุ้นเกิน 5 ตัว เพราะแบ่งเงินไว้แค่ 5 ไม้ หาก
จะมีตัวที่ 6 ได้ แปลว่า 5 ตัวแรกต้องมีสักตัว ถูกขายออกไปแล้วนั่นเอง
เรื่องต่อมา...ผลตอบแทน เนื่องจากเราถือหุ้นแต่ละตัว ด้วยเงิน 1 ใน 5
ของพอร์ต ดังนั้นผลกระทบต่อพอร์ตในรูปเปอร์เซ็นต์จึงไม่เต็มที่ เช่น
ในสูตร 5-3-5 ซื้อหุ้นตัวแรก แล้วทำกำไรที่ 5% ส่วนตัวที่
สองโดนคัทลอสที่ 3%

ผลตอบแทนของทั้งพอร์ต จะเป็น คือ $1\% - 0.6\% = 0.4\%$
(ใครยังงง สมมติ มีเงิน 100 บาท หนึ่งไม้ก็ถึง 20 บาท พอซื้อหุ้นได้
กำไร 5% ของ 20 บาท คือกำไรเข้าพอร์ต 1 บาท จึงคิดเป็น 1%)*
สุดท้าย...การตั้งจุดคัทหรือทำกำไร ก็สามารถตั้ง condition order
ทิ้งไว้ได้เลย ง่ายกว่าไหมครับ แค่นี้...วินัย...ก็พอ

ผมว่า...บทวิเคราะห์นี้...เข้าใจยาก จริงๆ นั่นแหละครับ
แต่ฝากลองไปศึกษาดูครับ โดยเฉพาะมือใหม่ อย่างน้อยก็
ช่วยให้ท่านอยู่รอดในตลาดไปได้ในช่วงเก็บเกี่ยวประสบการณ์
ไม่แมน...ไม่กำไรสูงสุด...แถมผิดมากกว่าถูก แต่การเทรด
บนหลักสถิติ ที่มี expected return เป็นบวก เวลาจะอยู่ข้างเราเสมอ
แล้วพบกันใหม่ตอนหน้าครับ...जारยต์

* ภายในเดือนजारยต์จะคิดผลตอบแทนรวมแบบเลขคณิต เพราะแบ่งไม้ซื้อไปพร้อมๆ กัน
แต่ระหว่างเดือนหรือระหว่างปี เราจะคิดผลตอบแทนรวมแบบเรขาคณิตเพราะใช้ขนาดของ
พอร์ตที่โตต่อเนื่องกันไป...

คำคมเขียนหุ้น



โรบิน ชาร์มา (Robin Sharma)

“จงอย่าแค่เพียง
อยู่กับ...ปีเดิมๆ 75 ครั้ง
แล้วเรียกมันว่า...ชีวิต”

“Don't live the same year 75 times
and call it a life.”

รายงานฉบับนี้จัดทำขึ้นโดยข้อมูลเท่าที่ปรากฏและเชื่อว่าเป็นที่น่าเชื่อถือได้แต่ไม่เป็นการยืนยันความถูกต้องและความสมบูรณ์ของข้อมูลใดๆ โดยบริษัทหลักทรัพย์ ยูโอบี เคย์ เอเชียน (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) ผู้จัดทำขอสงวนสิทธิ์ในการเปลี่ยนแปลงความเห็นหรือประมาณการในรายงานฉบับนี้ โดยไม่ต้องแจ้งล่วงหน้า รายงานฉบับนี้มีวัตถุประสงค์เพื่อใช้ประกอบการตัดสินใจของนักลงทุน โดยไม่ได้เป็นการชี้นำชักชวนให้นักลงทุนทำการซื้อหรือขายหลักทรัพย์ หรือตราสารทางการเงินใดๆ ที่ปรากฏในรายงาน