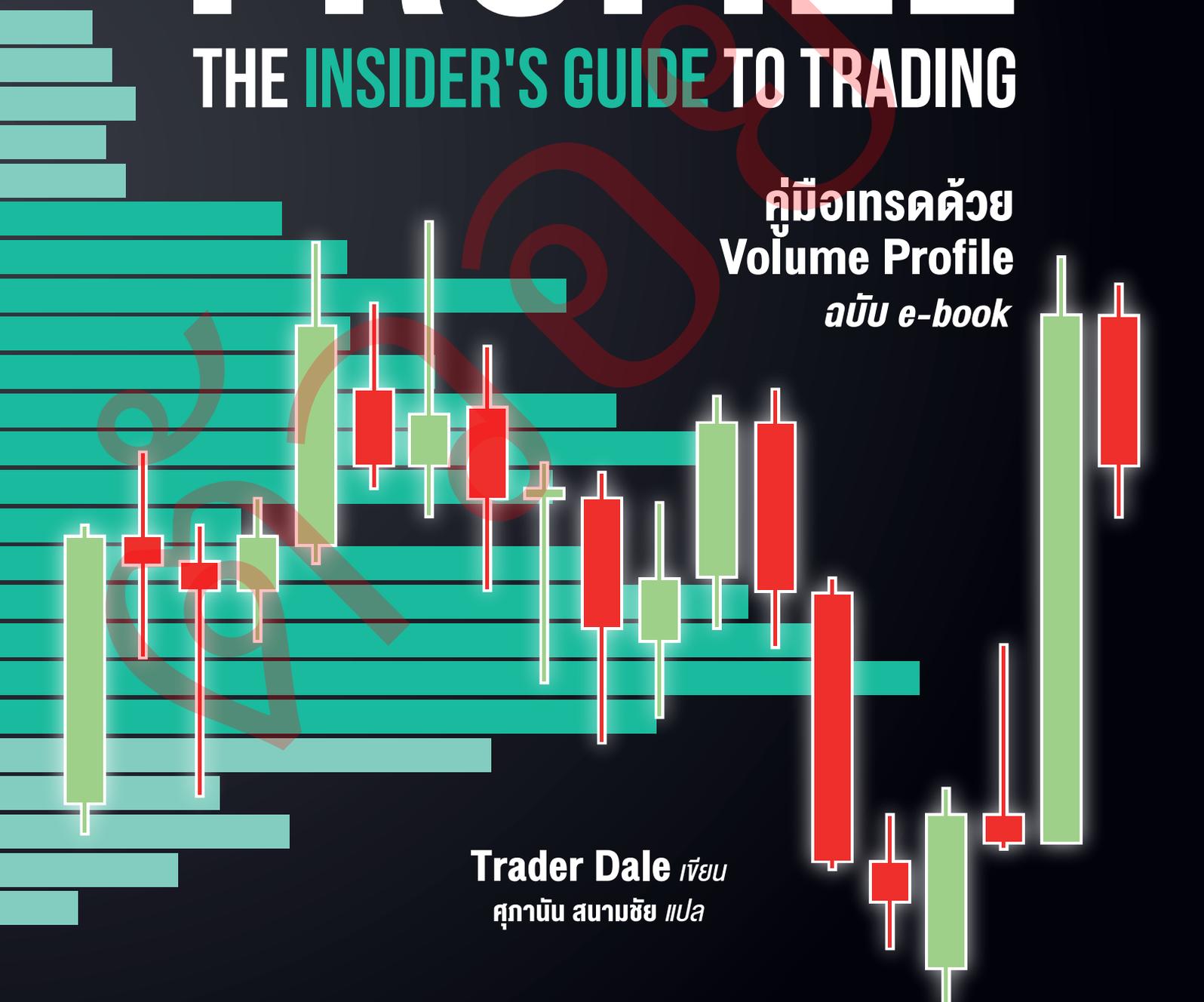


VOLUME PROFILE

THE INSIDER'S GUIDE TO TRADING

คู่มือเทรดด้วย
Volume Profile
ฉบับ e-book

Trader Dale *เดย์น*
สุภาณัน สนาบชัย *แปล*





เหมาะสมกับเทรดเดอร์
ทุกระดับประสบการณ์และคนที่
กำลังอยาการู้เกี่ยวกับ **Volume Profile**
หนังสือเล่มนี้มีครบจบในเล่มเดียว
เต็มไปด้วยข้อมูลดี ๆ
ที่ไม่เคยพบที่ไหนมาก่อน
และยังมีกลยุทธ์การเทรดที่ยอดเยี่ยม
และสามารถนำไปใช้ได้ทันที



► เกี่ยวกับผู้เขียน

Trader Dale

เทรดเดอร์เดลท่านเป็นเทรดเดอร์มืออาชีพมาตั้งแต่ปี 2008 ผู้หลงใหลในการเทรด เศรษฐศาสตร์ และการเงิน ท่านเรียนจบ การศึกษาด้านการเงินแล้วมาเป็นผู้จัดการพอร์ต ผู้จัดการ การลงทุนที่ได้รับการรับรอง และได้รับประกาศนียบัตรด้านอนุพันธ์ ทางการเงิน ท่านเคยมีประสบการณ์ดำรงตำแหน่งเป็นนักวิเคราะห์ ตลาดให้กับโบรกเกอร์เข้าใหญ่ หลังจากลาออกท่านก็ทุ่มเทเวลา ทั้งหมดให้กับ การเทรดทดสอบแผนการเทรดต่างๆมองหาแนวทางการเทรดแบบใหม่ทดลอง Backtest รูปแบบกราฟ ลองใช้เครื่องมือ หลากหลายและเทรดมาหลายแบบ เทรดทั้งหุ้น Investment Certificate และระบบเทรดอัตโนมัติ (บอท) ปัจจุบันนี้ท่านเน้นเทรด Forex เป็นหลัก ท่านมีความเชี่ยวชาญในการใช้รูปแบบการเคลื่อนที่ ของราคา (Price Action) และนำเอา Volume Profile มาประยุกต์ใช้ด้วย ทำให้ท่านได้กำไรจากตลาดอย่างสม่ำเสมอ

www.trader-dale.com

► เกี่ยวกับกองบรรณาธิการฉบับภาษาไทย



คือกองบรรณาธิการผู้จัดทำหนังสือการเงินและการลงทุนคุณภาพของสำนักพิมพ์ริงค์ มียอนด์ บุ๊คส์ มีพันธกิจหลักในการพัฒนาเป้าหมาย Sustainable Development Goals ตามแนวทางของ United Nations โดยเฉพาะด้าน Quality Education และด้าน Decent Work and Economic Growth

TBX มุ่งมั่นพัฒนาการศึกษาที่มีคุณภาพ ส่งเสริมการเรียนรู้ตลอดชีวิตเพื่อประชาชนชาวไทยนำองค์ความรู้ไปใช้ให้เกิดประโยชน์ในระดับสากล ได้รับโอกาสในการทำงานที่ดี มีรายได้ มากขึ้น และช่วยพัฒนาประเทศไทยให้มีความเจริญเติบโตทาง เศรษฐกิจ

www.thinkbeyondbook.com

เนื้อหาเด่นในหนังสือเล่มนี้

- ▶ วิธีการใช้ Price Action
- ▶ แผนการเทรด Price Action ที่ใช้ได้จริง
- ▶ Volume Profile คืออะไร
- ▶ แผนการเทรด Volume Profile ของ Trader Dale
- ▶ วิธีการหาสไตล์และสินค้าที่จะเทรด
- ▶ วิธีเทรดเวลาข่าวออก
- ▶ วิธีการวิเคราะห์ตลาดตั้งแต่ 1 ถึง 10
- ▶ วิธีการบริหารออเดอร์
- ▶ วิธีการบริหารเงินทุน
- ▶ จิตวิทยาการเทรด
- ▶ วิธีการ Backtest และนำมาเริ่มใช้เทรดจริง
- ▶ ข้อผิดพลาดที่เกิดขึ้นบ่อย
- ▶ กฎและวิธีการเทรดที่ Trader Dale ใช้

สะสมหนังสือชุด Technical Analysis จาก TBX Financial ให้ครบชุด



คู่มือวิเคราะห์ทางเทคนิค



เทรดด้วยทรงกราฟ



เทรดด้วยคลื่นอีเลียต



กราฟแท่งเทียน

ISBN (ebook) 978-616-449-592-0



9 786164 495920

ราคา 790 บาท

สารบัญ

บทนำ	11
เกี่ยวกับผู้เขียน	11
สิ่งที่คุณจะได้จากหนังสือเล่มนี้	12
ทำไมผมไม่เก็บความลับนี้ไว้ใช้เองคนเดียว?	13
ข้อควรรู้	13
บทที่ 1 การเคลื่อนที่ของราคา (Price Action)	15
การเคลื่อนที่ของราคา (Price Action)	15
ทำไมราคาถึงเคลื่อนที่?	16
ใครเป็นคนขับเคลื่อนราคา?	17
อินดิเคเตอร์ (Indicator)	19
การใช้รูปแบบการเคลื่อนที่ของราคาในการติดตามความเคลื่อนไหวของสถาบันการเงิน	20
การเคลื่อนที่ออกข้าง หรือ Sideway	20
การเคลื่อนที่อย่างรุนแรงของราคา	22
การปฏิเสธราคาที่รุนแรง (Strong Rejection)	24
ภาพรวม	26
Time Frame ที่ใช้ในการติดตามความเคลื่อนไหวของสถาบันการเงิน	26
วิธีการเข้าเทรดโดยใช้ Price Action	27
วิธีที่ 1 : เมื่อแนวรับกลายเป็นแนวต้าน หรือแนวต้านกลายเป็นแนวรับ	27
วิธีที่ 2 : Open-drive	29
วิธีที่ 3 : AB=CD	32
วิธีที่ 4 : เวลาตลาดเปิด	35
วิธีที่ 5 : ราคาเปิดของวัน	37
วิธีที่ 6 : ราคาสูงสุด (High) และต่ำสุด (Low) ของวัน/สัปดาห์	38
ราคาสูงสุด (High) และต่ำสุด (Low) ที่แข็งแกร่งและไม่แข็งแกร่ง	41
Failed Auction	47
บทที่ 2 Volume Profile	53
Volume Profile ปริมาณการซื้อขาย (Volume) สำคัญอย่างไร?	53
Volume Profile มาจากไหน?	55

บทที่ 5 ข่าวเศรษฐกิจมหภาค (Macroeconomic News)	101
ข่าวเศรษฐกิจมหภาค (Macroeconomic News)	101
เคล็ดลับข้อที่ 1 : อย่าคาดเดาเนื้อหาข่าวและผลกระทบของมัน	102
เคล็ดลับข้อที่ 2 : คอยดูว่าข่าวจะออกตอนไหน	103
เคล็ดลับข้อที่ 3 : วิธีการรับมือกับข่าวนอกตาราง	103
เคล็ดลับข้อที่ 4 : ความสำคัญและผลกระทบของข่าว	104
1. ข่าวล่องแดงที่ไม่สำคัญ	105
2. ข่าวล่องแดงทั่วไป	105
3. ข่าวล่องแดงที่ควรเลี่ยง	106
เคล็ดลับข้อที่ 5 : ข่าวที่ออกมาส่งผลกระทบต่อคู่เงินไหนบ้าง	106
เคล็ดลับข้อที่ 6 : อย่าเทรดตอนที่ข่าวออก	107
เคล็ดลับข้อที่ 7 : วิธีการปิดออเดอร์ก่อนข่าวออก	108
เคล็ดลับข้อที่ 8 : กลับมาเทรดตอนไหนดี	109
เคล็ดลับข้อที่ 9 : ออกออเดอร์ช้าหลังข่าวออก	109
เคล็ดลับข้อที่ 10 : ปรับแผนหลังข่าวออก	111
บทที่ 6 วิเคราะห์ตลาดจาก 1 ถึง 10	113
วิเคราะห์ตลาดสำหรับการเทรด Intraday	113
วิเคราะห์ตลาดสำหรับการเทรดตามรอบและลงทุนระยะยาว	115
บทที่ 7 การบริหารออเดอร์ (Position Management)	119
ราคาเป้าหมาย (Profit Target)	119
Fixed Profit Target	119
Volume-based Profit Target	120
การตั้งจุดตัดขาดทุน (Stop Loss)	122
Fixed Stop Loss	122
Volume-based Stop Loss	122
Volume-based Stop Loss : อีกหนึ่งวิธีในการตัดขาดทุน	124
การบริหาร Stop Loss	126
ปิดออเดอร์ก่อนถึงเป้าหมาย	128

บทที่ 8 การบริหารเงินทุน (Money Management) 131

ความเสี่ยงในการเทรด	131
Risk Reward Ratio (RRR)	132
ขนาดออเดอร์ที่จะเทรด (Position Sizing)	134
คู่เงินที่สัมพันธ์กัน (Correlation)	136

บทที่ 9 จิตวิทยาการเทรด (Trading Psychology) 139

การเทรด 4 ประเภท	140
เทรดดีแล้วชนะ	140
เทรดไม่ดีแต่ชนะ	140
เทรดดีแต่เสีย	141
เทรดไม่ดีแล้วเสีย	141
ทำยังไงถึงจะไม่ผลอแหกกฎ	142
วงจรของความลึ้นหวัง	142
วิธีการรับมือกับการเทรดชนะ	143
วิธีการรับมือกับการเทรดเสีย	144
วิธีการรับมือกับการเทรดเสียทั่วไป	144
วิธีการรับมือกับการเทรดเสียมากกว่าปกติ	144
วิธีการเทรดให้เหมือนเดิม	145

บทที่ 10 การ Backtest และเริ่มเทรด 149

การ Backtest และเริ่มเทรด	149
ขั้นที่ 1 : Backtest คร่าว ๆ	150
ขั้นที่ 2 : Backtest อย่างละเอียด	150
ขั้นที่ 3 : เทรดออเดอร์จิ๋ว	151
ขั้นที่ 4 : เทรดออเดอร์เล็ก	151
ขั้นที่ 5 : เทรดออเดอร์ปกติ	152
บันทึกการเทรด	152

บทที่ 11 ข้อผิดพลาดในการเทรด 10 ประการ 155

ข้อที่ 1 : ใช้อินดิเคเตอร์	155
ข้อที่ 2 : มาร์ติงเกล	156
ข้อที่ 3 : มั่นใจมากเกินไป	157

ข้อที่ 4 : เทรดไม้ใหญ่เกินไป	157
ข้อที่ 5 : ไม่ยอมรับว่าตัวเองพลาด	158
ข้อที่ 6 : ไม่ยอมตั้ง Stop Loss	158
ข้อที่ 7 : เข้าเทรดโดยไม่วางแผน	158
ข้อที่ 8 : เทรดตามคนอื่นแบบไม่ดูหน้าดูหลัง	159
ข้อที่ 9 : เปลี่ยนแผนการเทรดไปเรื่อย ๆ	159
ข้อที่ 10 : เลือกโบรกเกอร์ไม่ดี	159

บทที่ 12 BONUS: วิธีการบริการการเทรด Intraday ของผม 163

วิธีการเข้าออเดอร์ของผม	163
วิธีการตั้ง TP และ SL	165
การขยับ Stop Loss	167
การทดสอบแนวรับแนวต้าน	168
ถือออเดอร์นานแค่ไหน	170
ตลาดเปิดกระโดด	171
เทรดทุก Setup ที่ตรงเงื่อนไข	172

บทที่ 13 การเทรดจริง 175

การเทรดแบบ Intraday	176
เทรดโดยใช้ Setup แบบที่ 1 : การสะสม Volume	176
เทรดโดยใช้ Setup แบบที่ 2 : Trend Setup	180
เทรดโดยใช้ Setup แบบที่ 3 : การปฏิเสธราคา	186
การเทรดสวน	190
การเทรดตามรอบ (Swing Trade)	195
เทรดโดยใช้ Setup แบบที่ 1 : การสะสม Volume	195
เทรดโดยใช้ Setup แบบที่ 2 : Trend Setup	196
เทรดโดยใช้ Setup แบบที่ 3 : การปฏิเสธราคา	197
บทเรียนเพิ่มเติม	198
การนำไปใช้จริง	198
เรียนรู้เพิ่มเติม	199
รีวิวจากผู้เรียนคอร์สจริง	203
Digital Service	206

introduction

บทนำ

เกี่ยวกับผู้เขียน

สวัสดีครับ ผมชื่อ “เดล” (Trader Dale) เป็นเทรดเดอร์อาชีพมาตั้งแต่ปี 2008 ผมหลงใหล การเทรด เศรษฐศาสตร์ และการเงินมาตลอด ผมจบเอกการเงิน แล้วก็ได้รับใบอนุญาตผู้จัดการ กองทุน และได้รับใบอนุญาตด้านอนุพันธ์ทางการเงิน ผมเคยพูดได้เต็มปากว่าผมเป็นเทรดเดอร์ที่เรียน มาตรงสายและได้รับการรับรองแล้ว ไม่เหมือนกับกูรูท่านอื่น ๆ ซึ่งต้องขอขอบคุณผู้ปกครองของผม ที่ช่วยส่งเสริมและช่วยให้ผมตั้งตัวได้

หลังจบมหาวิทยาลัย ผมก็ทำงานเป็นนักวิเคราะห์ตลาดให้กับโบรกเกอร์เจ้าใหญ่เจ้าหนึ่ง หลาย ๆ คนอาจจะมองว่าการได้ทำงานในตำแหน่งนี้ทั้ง ๆ ที่เป็นเด็กจบใหม่นั้นถือว่าดีมากแล้ว แต่ผมกลับ ไม่รู้สึกลอย ๆ เพราะผมขี้ใจอยู่ 2 เรื่อง คือ ผมไม่ชอบการมีหัวหน้ามาคอยสั่ง ผมตั้งใจเรียนด้าน นี้เพื่อที่จะออกมาเป็นนายตัวเอง ไม่ได้มาเป็นลูกน้องคนอื่น อีกเรื่องหนึ่งคือผมไม่ชอบทัศนคติที่บริษัท มีต่อลูกค้า ซึ่งโบรกเกอร์ Forex ส่วนมากเป็นเหมือนกันหมด พวกเขาเห็นแก่ตัวและสนใจเพียงแค่ ค่าคอมมิชชั่นที่ตัวเองจะได้เท่านั้น ลูกค้าจะได้กำไรหรือขาดทุนก็ไม่สำคัญ ผมไม่อยากเป็นเครื่องมือ ให้บริษัทแบบนั้น ผมก็เลยลาออกมา

หลังจากลาออกจากงานมาแล้ว ผมก็ทุ่มเทเวลาทั้งหมดให้กับการเทรด ผมทดสอบแผนการเทรดต่าง ๆ มองหาแนวทางการเทรดแบบใหม่ ๆ ลอง Backtest รูปแบบกราฟ ผมทุ่มเทเวลาวันละ 12 – 15 ชั่วโมงมาใช้ในการทดสอบระบบทุกอย่างที่ผมพอจะนึกออก

ผมลองใช้เครื่องมือมาหลายอย่างและเทรดมาหลายแบบ เทรดทั้งหุ้นและตราสารอื่น ๆ ทั้งด้วยตัวเองและผ่านระบบเทรดอัตโนมัติ (บอท) แต่ตอนนี้ผมเน้นเทรด Forex ด้วยมือเป็นหลัก

ตอนที่ผมเริ่มเทรด Forex ผมเข้าใจว่าผมจะต้องหาสุดยอดอินดิเคเตอร์ที่จะทำให้ผมทำเงินได้เยอะ ๆ เร็ว ๆ แต่หลังจากลองอินดิเคเตอร์แทบหมดตลาด ก็ยังไม่มีอันไหนได้ตั้งใจสักอัน โดยเฉพาะการเทรดในระยะยาว

ผมเริ่มเทรดได้เป็นเรื่องเป็นราวหลังจากที่ผมเริ่มถอดอินดิเคเตอร์ออก แล้วหันมาใช้ Price Action หรือรูปแบบการเคลื่อนที่ของราคา แล้วก็เพิ่งจะมาแจ็กพ็อตแตกเข้าตอนที่ผมเอา Price Action กับ Volume Profile มาใช้ด้วยกันนี่แหละครับ ผมถึงได้เริ่มเทรดได้กำไรได้อย่างสม่ำเสมอ

www.trader-dale.com

สิ่งที่คุณจะได้จากหนังสือเล่มนี้

หนังสือเล่มนี้คือหนังสือที่ผมคิดว่า ถ้ามีคนเอามาให้ผมอ่านเร็วกว่านี้สัก 10 ปีก็คงจะดี หนังสือเล่มนี้จะช่วยสอนสิ่งที่สำคัญที่สุดในการเทรดให้ และทำให้ผมไม่ต้องเสียเวลาไปงมโข่งหาหนังสือยาก ๆ มาอ่าน

สิ่งที่คุณจะได้จากหนังสือเล่มนี้

- ➔ การใช้ Price Action
- ➔ กลยุทธ์ Price Action ที่ใช้ได้จริง
- ➔ Volume Profile ทำงานยังไง
- ➔ กลยุทธ์การใช้ Volume Profile ที่ผมชอบ
- ➔ วิธีการเทรดเมื่อมีข่าวเศรษฐกิจ
- ➔ วิธีการวิเคราะห์ตลาดจาก 1 ถึง 10
- ➔ วิธีการบริหารออเดอร์
- ➔ จิตวิทยาในการเทรด
- ➔ วิธีการทดสอบย้อนหลัง (Backtest) และการนำแผนที่ทดสอบแล้วมาใช้เทรดจริง

- ➔ ข้อผิดพลาดในการเทรดที่เกิดขึ้นบ่อย และวิธีการรับมือ
- ➔ แนวทางและกฎในการเทรดของผม

ผมจะถ่ายทอดเนื้อหาในรูปแบบที่เรียบง่าย อัดแน่น พร้อมด้วยตัวอย่างและภาพประกอบ

ทำไมผมไม่เก็บความลับนี้ไว้ใช้ของคนเดียว?

คุณจะสงสัยก็ไม่แปลก นักลงทุนหลายคนก็คงจะสงสัยอยู่เหมือนกันว่าถ้าแผนของผมดีจริง ทำไมไม่เก็บไว้ใช้ของคนเดียว จะเอาแผนการเทรดของตัวเองมาบอกคนอื่นทำไม?

ผมเคยเจอพวก Scammer มาเยอะ พวกที่เรียกตัวเองว่ากูรูบางคนก็ไม่เคยศึกษาด้านการเงินมาก่อน ไม่มีใบรับรอง ไม่มีความรู้เกี่ยวกับตลาดเลยด้วยซ้ำ พวกเขาไม่ได้สนใจว่าลูกค้าจะเทรดได้หรือเทรดเสีย ซึ่งไม่ต่างจากโบรกเกอร์ที่ผมเคยทำงานด้วยเลย

ผมไม่เห็นด้วยกับเรื่องแบบนี้ ผมอยากจะทำสิ่งที่ต่างออกไปและยังเป็นสิ่งที่มีประโยชน์จริง ๆ การช่วยพวกคุณไม่ได้ทำให้ผมเสียอะไรเลย เพราะอะไรรู้ไหมครับ? คุณรู้ไหมว่าในโลกนี้มีคนเทรดค่าเงินอยู่กี่คน? จำนวน Volume การเทรดของพวกเราคือเท่าไร? ถ้าจากสถิติของ Bank of International Settlement เทรดเดอร์รายย่อยอย่างพวกเรามี Volume การเทรดในแต่ละวันอยู่ที่ 3.5% เท่านั้น ส่วน Volume ที่เหลือนั้นเป็นของ “สถาบัน” ต่างหาก

ดังนั้น การช่วยคุณและเทรดเดอร์รายย่อยคนอื่น ๆ นั้นไม่ได้ส่งผลกระทบต่อตลาดเลย และมันก็ไม่ได้มีผลอะไรกับผมเลยด้วย ผมเลยไม่มีเหตุผลอื่นที่จะต้องเก็บความรู้นี้เอาไว้คนเดียว ถ้าคุณพร้อมที่จะเปิดใจเรียนรู้และฝึกฝนเพื่อพัฒนาการเทรดของคุณ ผมก็ยินดีที่จะถ่ายทอดความรู้นี้ให้

ข้อควรรู้

นี่ไม่ใช่คู่มือ “รวยทางลัด” ผมจะไม่โกหกและสัญญาอะไรกับคุณทั้งนั้น การจะเชี่ยวชาญด้าน Volume Profile และเทรดให้เก่งนั้นจะต้องอาศัยเวลาและการฝึกฝน ถ้าคุณกำลังมองหาสูตรลัดอยู่ คุณก็อ่านหนังสือผิดเล่มแล้วละ ผมจะสอนแนวทางการเทรดของผมให้คุณ แต่ผมไม่สามารถรับประกันได้ว่ามันจะใช้ได้ผลกับทุกคน แต่ผมก็ยังยืนยันคำเดิมว่านี่เป็นแนวทางการเทรดที่ดีที่สุดที่ผมเคยเจอในช่วงเวลา 10 ปีที่ผ่านมา สิ่งที่ผมจะสอนคุณในหนังสือเล่มนี้ คือสุดยอดวิชาที่ผมมีแล้ว

ดังนั้น ถ้าคุณยอมรับได้ว่านี่ไม่ใช่ “คัมภีร์รวยทางลัด” (เพราะมันไม่มีอยู่จริง) เราก็ไปเริ่มกันเลย

01

การเคลื่อนที่ของราคา (Price Action)

Price Action คือ ศาสตร์กราฟเปล่าที่ไม่ใส่อินดิเคเตอร์ ผมแนะนำให้คุณศึกษาเรื่องนี้ก่อนเป็นอย่างแรก เพราะมันเป็นพื้นฐานที่จะถูกนำไปต่อยอดสู่หัวข้ออื่น ๆ ในหนังสือเล่มนี้

วิธีการใช้งาน Price Action ของผมจะต่างจากคนอื่น เพราะผมไม่ได้มองหารูปแบบแท่งเทียน (Candlestick Formation) ถ้าเปรียบเทียบ Price Action เป็นหนังสือ รูปแบบแท่งเทียนก็เหมือนกับตัวอักษรหนึ่งตัวหรือคำหนึ่งคำ ซึ่งเวลาเราจะอ่านอะไร เราก็ต้องอ่านเป็นประโยค ไม่ใช่อ่านแยกเป็นคำ ๆ หรืออ่านแค่ตัวอักษรตัวใดตัวหนึ่ง การอ่านกราฟหรือตลาดก็เหมือนกัน ผมมองว่าราคาเป็นสิ่งที่เคลื่อนที่อยู่ตลอดเวลา ผมจึงมุ่งความสนใจไปที่รูปแบบการเคลื่อนที่ หรือไดนามิก (Dynamic) ของราคามากกว่า

ทำไมราคากถึงเคลื่อนที่?

ก่อนที่จะเราจะไปลงลึกเรื่อง Price Action และ Trade Setup ผมขอถามคำถามก่อนหนึ่งข้อว่า คุณรู้ไหมว่าทำไมราคากถึงเคลื่อนที่? แรงขับเคลื่อนของราคาคืออะไร? คุณกำลังคิดว่า “เพราะมีแรงฝั่งซื้อมากกว่าฝั่งขาย หรือฝั่งขายมากกว่าฝั่งซื้อ” อยู่หรือเปล่า? ถ้าใช่...ผมขอบอกเลยว่า ผิดครับ แต่ไม่ต้องเสียใจไป เพราะมันเป็นความเข้าใจผิดที่เกิดขึ้นบ่อย ๆ แม้แต่ “ผู้เชี่ยวชาญ” ตามทีวีหรือหนังสือพิมพ์ก็ยังเผลอพูดแบบนี้บ่อย ๆ แต่จริง ๆ แล้วคำตอบ คือ ความเร่งรีบ (Aggression) ครับ เมื่อราคาขึ้น ฝั่งผู้ซื้อจะใจร้อนขึ้น และถ้าราคาลง ฝั่งผู้ขายก็จะรีบเข้ามามากขึ้นเช่นกัน

ถ้าคุณกำลังรีบ คุณก็อยากจะรีบเปิดออเดอร์ตอนนั้นเลย พอคุณอยากได้มาก ๆ คุณก็ต้องเปิด Market Order ซึ่งเป็นการเปิดออเดอร์ทันทีตามราคาตลาด ณ ตอนนั้น เพื่อให้แน่ใจว่าคุณจะได้ของแน่ ๆ 100 %

สมมติว่าคุณเป็นผู้ดูแลกองทุน และมีข่าวออกมาว่า EUR/USD กำลังจะขึ้น คุณเลยอยากจะเปิด Long ทั้งหมด 1,000 Lot (เท่ากับ 1,000,000 เหรียญสหรัฐ) แต่คนอื่น ๆ ก็เห็นข่าวและมองเห็นโอกาสนี้เหมือนกัน ราคาก็เลยพุ่งขึ้นไปอย่างรวดเร็ว คุณไม่อยากจะถก ก็เลยจำเป็นต้องรีบเปิด Market Order เพื่อให้ได้เปิดออเดอร์ตามที่ต้องการ ภาพที่ 1.1



ภาพที่ 1.1

ออเดอร์ของคุณจะจับคู่ได้เร็ว และคุณจะได้ครบล็อต แต่ออเดอร์ของคุณจะถูกแบ่งและค่อย ๆ จับคู่ได้ตามราคาที่เคลื่อนที่ขึ้น ออเดอร์ของเทรดเดอร์ที่กำลังรับเข้าเทรดจึงเป็นแรงขับเคลื่อนที่ทำให้ราคาเคลื่อนที่ขึ้นลงนั่นเอง

จริง ๆ แล้วมันยังมีข้อมูลที่ดีกว่านี้อีกเยอะ แต่หลักการเบื้องต้นก็จะประมาณนี้ครับ อย่าลืมว่า **ผู้ซื้อ/ผู้ขายที่รับเปิดออเดอร์คือแรงที่ขับเคลื่อนราคา** ในหนังสือเล่มนี้ผมจะพูดถึงเทรดเดอร์กลุ่มนี้ค่อนข้างบ่อย และถ้าคุณเกิดนึกภาพไม่ออกขึ้นมา ก็ลองนึกถึงตัวอย่าง 1,000 Lot นี้ดูนะครับ

ใครเป็นคนขับเคลื่อนราคา?

“ใครเป็นคนขับเคลื่อนราคา” อาจจะเป็นคำถามทั่วไปที่เหมือนจะไม่มีประโยชน์อะไร แต่จริง ๆ แล้วมันเป็นคำถามที่สำคัญมาก และมันก็เป็นองค์ประกอบที่สำคัญในระบบเทรดของผมด้วย

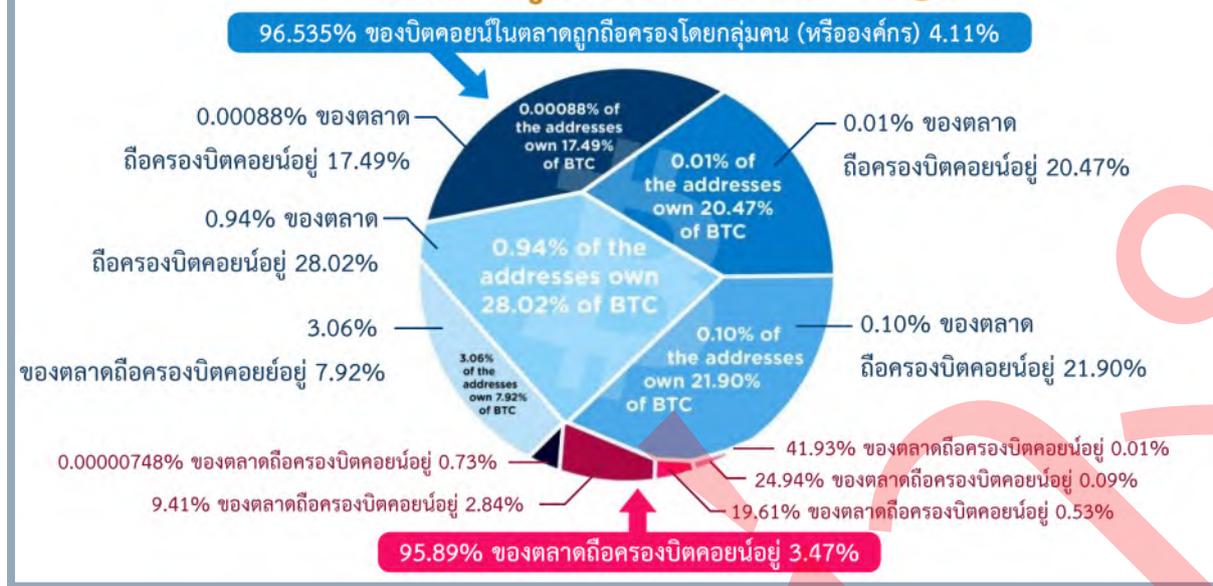
จากภาพที่ 1.2 จะเห็นได้ว่า Volume การเทรดประมาณ 80 เปอร์เซ็นต์ของตลาดนั้นมาจากสถาบันการเงิน นี่จึงเป็นกลุ่มเทรดเดอร์ที่ควบคุมราคาและตลาดอยู่

Rank	Name	Market share
1	 Citi	16.04%
2	 Deutsche Bank	15.67%
3	 Barclays Investment Bank	10.91%
4	 UBS AG	10.88%
5	 HSBC	7.12%
6	 JPMorgan	5.55%
7	 Bank of America Merrill Lynch	4.38%
8	 Royal Bank of Scotland	3.25%
9	 BNP Paribas	3.10%
10	 Goldman Sachs	2.53%

ภาพที่ 1.2

ไม่ใช่เพียงแค่ตลาด Forex เท่านั้น ตลาดอื่น ๆ ก็มีพี่ใหญ่เป็นสถาบันการเงินเช่นกัน ตลาดค่าเงินคริปโตก็เหมือนกัน แม้ว่ามันจะเป็นตลาดที่ค่อนข้างใหม่ แต่สถาบันการเงินก็ยังเป็นกลุ่มที่คุมเกมอยู่ดี ในภาพที่ 1.3 จะเห็นได้ว่าสถาบันการเงิน (4.1 เปอร์เซ็นต์) กำลังถือครอง 96.53 เปอร์เซ็นต์ของบิตคอยน์ทั้งหมดในตลาดอยู่ และเทรดเดอร์รายย่อยอย่างพวกเรา ก็ถือบิตคอยน์สัดส่วนเล็ก ๆ ที่ด้านล่างของกราฟอยู่ ดังนั้น ไม่ว่าจะเทรดตลาดค่าเงิน ค่าเงินคริปโต หุ้น หรือดัชนี...ตลาดก็ยังถูกขับเคลื่อนและมีขาใหญ่เป็นองค์กรและสถาบันการเงินใหญ่ ๆ ไม่ก็เจ้าอยู่ดี

สัดส่วนผู้ถือครองบิตคอยน์ ₿



ภาพที่ 1.3

จะเห็นได้ว่าเทรดเดอร์อย่างพวกเรานั้น ไม่ได้มีบทบาทอะไรในเกมนี้เลย เราไม่สามารถตั้งราคาได้ และไม่สามารถปั่นตลาดได้ **แต่เรายังสามารถทำกำไรจากมันได้นะครับ** เพียงแค่ต้องยอมรับบทบาทของเราในตลาด และจับตามองพีใหญ่อย่างสถาบันการเงินเพื่อหาโอกาสเข้าทำกำไร

แล้วเราจะติดตามความเคลื่อนไหวของสถาบันได้อย่างไร? คำตอบคือ Price Action ครับ เพราะ Price Action และปริมาณการซื้อขาย (Volume) จะเป็นสิ่งที่ช่วยให้เราประเมินความเคลื่อนไหวของสถาบันในอดีต ปัจจุบัน และอนาคตได้

อินดิเคเตอร์ (Indicator)



ภาพที่ 1.4

ในบทที่แล้วผมเคยบอกไว้ว่า Price Action และ Volume จะเป็นตัวช่วยให้เราคาดการณ์ความเคลื่อนไหวของสถาบันการเงินได้ และอินดิเคเตอร์นั้นไม่มีประโยชน์อะไรในการคาดการณ์การเคลื่อนที่ของราคาตลาดในอนาคตเลย

อินดิเคเตอร์พื้นฐานแต่ละตัวจะแสดงให้เห็นการเคลื่อนที่ของตลาดในอดีตแต่มันไม่สามารถบ่งชี้ทิศทางที่เคลื่อนที่ในอนาคตได้ เพราะอินดิเคเตอร์ส่วนมากจะถูกคำนวณขึ้นจาก “เวลา” และ “ราคาในอดีต” มันจึงเป็นเพียงแค่เครื่องมือที่แสดงประวัติการเคลื่อนที่ของราคาในแต่ละช่วงเวลา และเป็นเพียงแค่เส้นเส้นหนึ่งในกราฟเท่านั้น

คุณคงสงสัยว่าแล้วพวกนักวิเคราะห์ของโบรกเกอร์จะใช้อินดิเคเตอร์ไปทำไม? ลองนึกดูสิครับว่านักวิเคราะห์พวกนั้นเป็นใคร พวกเขาก็เป็นคนธรรมดาที่ได้ทำงานแล้วก็กลับบ้านเหมือนกับพวกเราทุกคน หน้าที่ของพวกเขาคือการเขียนบทความอะไรก็ได้ให้ลูกค้า และลูกค้าส่วนมากก็ขาดทุนอยู่แล้ว บทวิเคราะห์พวกนี้จึงเป็นแค่เครื่องมือที่ใช้ในการดึงดูดให้ลูกค้าเทรดมากขึ้น โบรกเกอร์จะได้กำไรเยอะขึ้น และอินดิเคเตอร์ก็เป็นเพียงแค่เครื่องมือที่ทำให้เทรดเดอร์รู้สึกสบายใจมากขึ้นและเทรดมากขึ้นเท่านั้น

ถ้าคุณอยากจะใช้ EMA (Exponential Moving Average) เพื่อดูทิศทางแนวโน้มของราคาผมก็ไม่ติดอะไร แต่ผมไม่แนะนำให้วางแผนการเทรดโดยใช้อินดิเคเตอร์เป็นตัวตัดสินใจ มันไม่ได้ผลหรอกครับ ผมเคยเป็นทั้งเทรดเดอร์ที่นั่งค้นคว้าหาสุดยอดอินดิเคเตอร์และเคยทำงานให้โบรกเกอร์มาแล้ว ดังนั้นเชื่อผมเถอะ ผมลองมาหมดแล้ว

01

02

03

04

05

06

07

08

09

10

11

12

13

19

การใช้รูปแบบการเคลื่อนไหวของราคา ในการติดตามความเคลื่อนไหวของสถาบันการเงิน

ในบทนี้ เราจะมาดูกันว่าเราจะติดตามดูความเคลื่อนไหวของสถาบันการเงินได้อย่างไร เพราะแผนของเราจะขึ้นอยู่กับความเคลื่อนไหวของสถาบัน ดังนั้นเราจึงควรรู้ว่าสถาบันให้ความสำคัญกับอะไร และจะเริ่มเคลื่อนไหวช่วงไหน

Price Action หรือการเคลื่อนไหวที่ของราคาที่เป็นสัญญาณบ่งชี้ความเคลื่อนไหวของสถาบันมี 3 แบบ

1. การเคลื่อนที่ออกข้าง (Sideway)
2. การเคลื่อนที่อย่างรุนแรงของราคา
3. การปฏิเสธราคาที่รุนแรง (Strong Rejection)

การเคลื่อนที่ออกข้าง หรือ Sideway

ความต่างที่สำคัญที่สุดระหว่างเทรดเดอร์รายย่อยอย่างพวกเราและสถาบันการเงินคือ เงินทุน และพอร์ตขนาดใหญ่ของสถาบันก็ทำให้พวกเขาต้องเผชิญกับปัญหาที่พวกเราไม่เคยพบเจอ นั่นก็คือ พวกเขามีเงินทุนมากเกินไป ถ้าสถาบันต้องการจะแอบเปิดออเดอร์ขนาดใหญ่โดยไม่ให้ใครรู้ และไม่ให้ราคาเคลื่อนที่มากเกินไป พวกเขาจะต้องค่อย ๆ ทอยเปิดเพื่อไม่ให้คนอื่น ๆ ในตลาดสังเกตเห็น ซึ่งมันก็ต้องใช้เวลาพอสมควร

ถ้า Citi Bank ซึ่งเป็นสถาบันการเงินขนาดใหญ่ซื้อเงิน EUR ในปริมาณที่มากและรวดเร็ว มันก็จะทำให้ตลาดแตกตื่นและเกิดเป็นแนวโน้มขึ้นมา และพวกเขาก็จะไม่สามารถเปิดออเดอร์ได้ครบตามจำนวนที่ต้องการ หรืออาจจะเปิดได้ครบแต่ไม่ได้ราคาที่ต้องการ

สถาบันการเงินจึงต้องใช้เวลาในการค่อย ๆ แอบเข้าออเดอร์ โดยทอยเปิดออเดอร์เล็ก ๆ ให้ดูเหมือนกับเทรดเดอร์รายย่อย

และจังหวะที่ดีที่สุดในการแอบเปิดออเดอร์ก็คือในช่วงที่ราคาเคลื่อนที่ Sideway นั่นเอง

ดังนั้นเวลาที่คุณเจอ Sideway ก็อย่าได้มองข้ามมันเด็ดขาด เพราะจังหวะที่ราคาเคลื่อนที่ Sideway คือจังหวะที่สถาบันการเงินจะเริ่มเคลื่อนไหว เวลาวิเคราะห์กราฟผมจึงมักจะมองหา Sideway ก่อนเป็นอย่างแรก ๆ

พื้นที่ที่ผมตีกรอบล้อมไว้ในกราฟตามภาพที่ 1.5 คือการเคลื่อนที่ Sideway ที่มีนัยสำคัญ



ภาพที่ 1.5

ภาพต่อไป ภาพที่ 1.6 คือหลักฐานว่าออเดอร์ใหญ่ ๆ จะเกิดขึ้นในบริเวณที่ราคาเคลื่อนที่ Sideway ผมใส่ Volume Profile เข้าไปในกราฟและจะเห็นได้ว่าพื้นที่ที่มี Volume Profile มากที่สุด คือบริเวณที่ราคาเคลื่อนที่ Sideway หมายความว่าออเดอร์ส่วนมากถูกเปิดในบริเวณนี้



ภาพที่ 1.6

01

02

03

04

05

06

07

08

09

10

11

12

13

21

หลักการนี้สามารถใช้ได้กับทุก Time Frame ดังนั้น การเคลื่อนที่ Sideway จึงมีความสำคัญในทุก Time Frame ไม่ว่าจะเป็นกราฟ 1 นาที, 30 นาที, 1 วัน หรือ 1 สัปดาห์

ผมมักจะวิเคราะห์กราฟ 30 นาที ในการเทรดแบบ Intraday และ 1 วัน สำหรับการเทรดตามรอบ

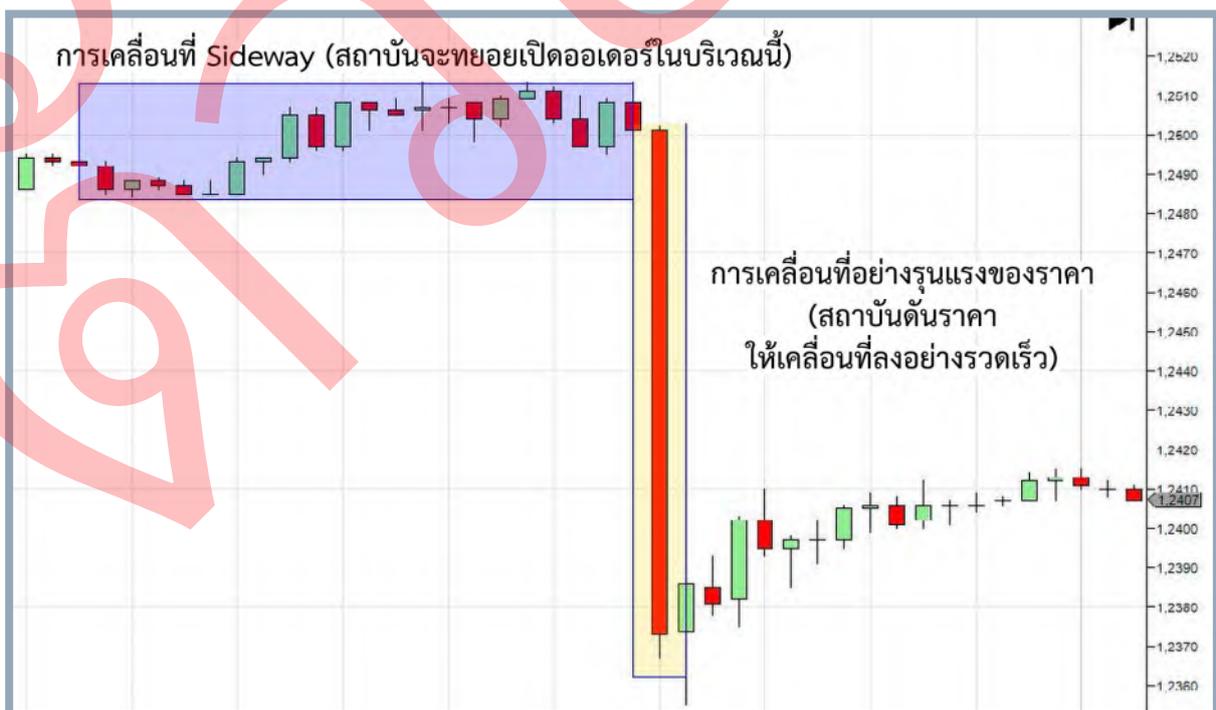
สรุป : การเคลื่อนที่ Sideway มีความสำคัญมาก เพราะมันคือบริเวณที่สถาบันจะทำการเปิดออเดอร์ ดังนั้น ไม่ว่าจะคุณจะใช้กราฟ Time Frame ไหน ก็ควรจะสังเกตบริเวณที่ราคาเคลื่อนที่ Sideway เอาไว้ให้ดี

การเคลื่อนที่อย่างรุนแรงของราคา

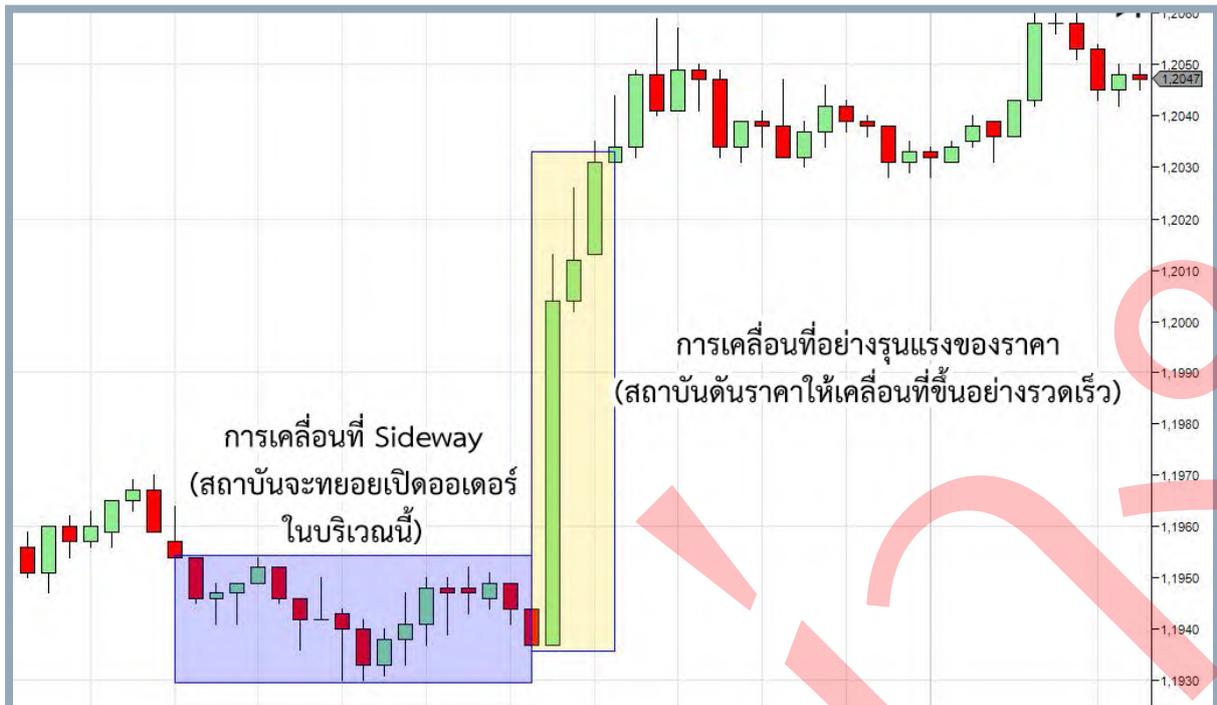
การเคลื่อนที่อย่างรุนแรงของราคาคือการเคลื่อนที่หรือมีแนวโน้มที่มีนัยสำคัญ ซึ่งเกิดจากการที่ฝั่งผู้ซื้อดันราคาให้เคลื่อนที่ขึ้นหรือผู้ขายดันราคาให้เคลื่อนที่ลงอย่างรวดเร็ว หลังจากที่ราคาเคลื่อนที่ Sideway เมื่อสถาบันเปิดออเดอร์ที่ต้องการเรียบร้อยแล้ว (ในช่วงที่ราคาเคลื่อนที่ Sideway) พวกเขาจะเปิดออเดอร์เพื่อดันราคาให้เคลื่อนที่ไปในทิศทางที่ต้องการ การแอบเปิดออเดอร์แล้วค่อยดันราคาเพื่อให้เกิดกำไรนี้แหละครับ คือวิธีที่สถาบันการเงินต่าง ๆ ใช้ในการทำเงิน

สาเหตุที่สถาบันต้องค่อย ๆ เปิดออเดอร์ก่อนที่ราคาจะเคลื่อนที่นั้น เป็นเพราะว่าการเปิดออเดอร์ขนาดใหญ่ในขณะที่ราคาอยู่ในแนวโน้มนั้นเป็นเรื่องยากนั่นเอง

ในกราฟภาพที่ 1.7 และ 1.8 คือตัวอย่างลักษณะการเคลื่อนที่ Sideway ก่อนที่ราคาจะเข้าสู่แนวโน้มที่มักจะเกิดขึ้นในตลาด



ภาพที่ 1.7



ภาพที่ 1.8

การเคลื่อนที่อย่างรุนแรงของราคามีความสำคัญเพราะระหว่างที่ราคาเคลื่อนที่ Sideway เราจะไม่รู้ว่าราคาจะเคลื่อนที่ไปทางไหน แต่พอราคาเริ่มเคลื่อนที่ เราก็จะรู้แล้วว่าออเดอร์ที่สถาบันเปิดไปนั้นเป็น Short หรือ Long

ถ้าราคาเข้าสู่แนวโน้มขาขึ้นที่แข็งแกร่งหลังจากเคลื่อนที่ Sideway แปลว่าออเดอร์ที่สถาบันเปิดเอาไว้คือ Long และถ้าราคาเคลื่อนที่ลงหลังจาก Sideway ก็หมายความว่าออเดอร์ที่สถาบันสะสมเอาไว้ก็คือ Short นั่นเอง

การเคลื่อนที่ที่รุนแรงของราคาเกิดจากการเข้าออเดอร์ของผู้ซื้อหรือผู้ขาย ออเดอร์ของสถาบัน จึงเป็นสิ่งที่ดันราคาให้เคลื่อนที่ขึ้นและลง

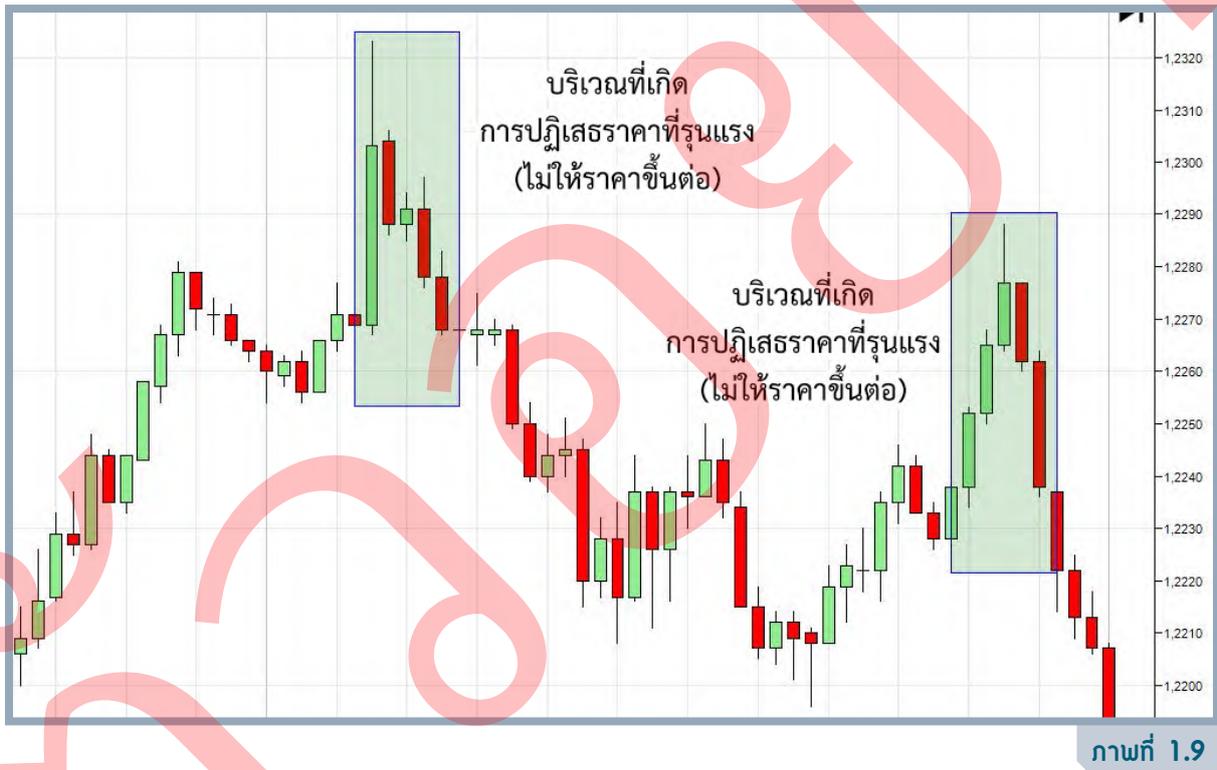
นอกจาก “การเคลื่อนที่ Sideway” และ “การเคลื่อนที่ที่รุนแรงของราคา” แล้ว เบบะแสซันสำคัญที่เราควรมองหาเวลาที่เราวีเคราะห์กราฟได้แก่ “การปฏิเสธราคาที่รุนแรง (Strong Rejection)”

การปฏิเสธราคาที่รุนแรง (Strong Rejection)

การปฏิเสธราคา คือ การกลับตัวอย่างกะทันหันของราคา โดยราคาจะเคลื่อนที่ไปทางใดทางหนึ่งอย่างรุนแรงและกลับตัวไปอีกทางด้วยความเร็วเท่า ๆ กัน ยกตัวอย่างเช่น แท่งเทียนที่ถูกเรียกว่า “Pin Bar” เป็นต้น การปฏิเสธราคามีหลากหลายรูปแบบ แต่คุณสมบัติหลักที่สำคัญที่สุดของการปฏิเสธราคา คือ การกลับตัวอย่างกะทันหันหลังจากที่ราคาเคลื่อนที่อย่างรุนแรง

การปฏิเสธราคาแบบนี้ เกิดขึ้นจากการที่ฝั่งใดฝั่งหนึ่งกำลังดันราคาอยู่ แล้วไปเจอกับแรงจากอีกฝั่งที่แข็งแกร่งและรุนแรงกว่า ทำให้ราคากลับตัวไปอีกทางแทน ซึ่งบริเวณที่ราคากลับตัวนั้นมีความสำคัญมาก เพราะมันคือจุดที่ราคาถูกปฏิเสธและดันกลับอย่างรุนแรง จึงมีโอกาสสูงที่บริเวณนั้นจะกลายเป็นแนวรับแนวต้านใหม่ และเมื่อราคาเคลื่อนที่มาถึงตรงนี้ มันก็มักจะเกิดการดันราคากลับอีก

ภาพที่ 1.9 และ 1.10 คือตัวอย่างของการปฏิเสธราคาที่รุนแรง





ภาพที่ 1.10

จากกราฟตัวอย่างข้างต้น จะเห็นได้ว่าการปฏิเสธราคานี้ไม่จำเป็นต้องมี Pin Bar เสมอไป ส่วนตัวแล้วผมไม่สนใจด้วยซ้ำว่าแท่งเทียนจะมีหน้าตาเป็นยังไง เพราะกราฟจะมีหน้าตาแตกต่างกันไปในแต่ละ Time Frame ซึ่งจริง ๆ แล้ว เราควรจะเห็นการปฏิเสธราคาได้ในหลาย Time Frame ไม่ใช่แค่เพียงใน Time Frame ใด Time Frame หนึ่ง ดังนั้นเงื่อนไขเดียวของผมคือมันจะต้องเป็นการกลับตัวอย่างกะทันหันเท่านั้น อย่าลืมนะครับว่าเรากำลังวิเคราะห์ “ลักษณะและความเร็วของการเคลื่อนที่ของราคา” ไม่ใช่รูปแบบแท่งเทียน

การจะแยกแยะความต่างระหว่างการปฏิเสธราคาที่รุนแรงและการปฏิเสธราคาที่ไม่มีความสำคัญนั้น จะต้องอาศัยประสบการณ์ เมื่อคุณอ่านกราฟจนเชี่ยวชาญแล้ว คุณก็จะสามารถมองเห็นภาพรวมของกราฟได้เอง

จุดที่ราคาเกิดการกลับตัวอย่างกะทันหันนั้นมีความสำคัญมาก และเป็นสิ่งที่เราต้องคอยจับตาดูเวลาที่วิเคราะห์กราฟ

ภาพรวม

รูปแบบการเคลื่อนที่ของราคา 3 แบบที่เราพูดถึงไปก่อนหน้านี้ คือสิ่งที่สำคัญที่สุดในระบบการเทรดของผม มันคือ 3 รูปแบบแรกที่ผมจะมองหาและให้ความสำคัญมากที่สุดเวลาที่วิเคราะห์กราฟ เมื่อคุณฝึกฝนจนเชี่ยวชาญแล้ว คุณก็จะอ่านกราฟได้คล่องขึ้นและหารูปแบบการเคลื่อนที่เหล่านี้ได้เร็วขึ้น เราสามารถฝึกได้โดยการฝึกภาพแบบนี้เอาไว้ในหัวตามภาพที่ 1.11



ภาพที่ 1.11

นี่คือวิธีการจำแนกการเคลื่อนที่ที่ต่าง ๆ ของราคา ซึ่งการเคลื่อนที่แต่ละแบบก็จะช่วยให้เรารู้ว่าสถาบันกำลังทำอะไรอยู่

เดี๋ยวผมจะพูดถึงแผนการเทรดที่อาศัยรูปแบบการเคลื่อนที่ของราคาในหัวข้อ Volume Profile

Time Frame ที่ใช้ในการติดตามความเคลื่อนไหวของสถาบันการเงิน

สถาบันการเงินขนาดใหญ่มีแผนการเทรดหลายแบบและใช้กราฟหลากหลาย Time Frame ไม่ว่าจะเป็น Algorithmic Trading, เทรดรอบสั้น, Swing Trade, หรือลงทุนระยะยาว และยังมีคนที่คอย Hedge และแปลงค่าเงินอีกด้วย แต่แม้ว่าพวกเขาจะมีคนเพียงพอที่จะเทรดได้ทุก Time Frame ตั้งแต่ 1 นาที ไปจนถึง 1 เดือน ปัญหาที่ไม่เปลี่ยนแปลงก็คือเงินทุนขนาดใหญ่ ดังนั้น ไม่ว่าจะอยู่ใน Time Frame ไหน พวกเขาก็ยังคงต้องใช้วิธีเดิมในการเข้าออเดอร์อยู่ดี