

การวิเคราะห์ Forex ด้วย MACD

(Forex Analysis using MACD)

เด็ยวตายพันลั

สารบัญ

บทนำ คำแนะนำเกี่ยวกับการอ่าน	i
คำเตือน	v
ไม่ได้มาขายอะไรที่หาได้ฟรีในเน็ต	vii
ปัญหาของการเทรดไม่ได้อยู่ที่เครื่องมือ	xxi
หนังสือนี้ใช้สำหรับตลาด Forex เท่านั้น.....	xxvii
ข้อตกลงที่ควรรู้เกี่ยวกับหนังสือเล่มนี้	xxxvii
บทที่ 1 MACD คืออะไรสร้างจากอะไร?.....	1
การคำนวณ MACD ที่ต้องรู้.....	1
กระบวนการแบบสุ่มทางสถิติ.....	12
ตัวอย่างคำถามแบบสุ่มในตลาด Forex	25
MACD กับการใช้งาน.....	32
คนอื่นเขาใช้งานกันอย่างไร	41

การวิเคราะห์ Convergence Divergence	42
การวิเคราะห์ Cross Over	45
บทที่ 2 ข้อมูลเบื้องต้น MACD.....	50
ทำไม MACD ต้องเปลี่ยนการตั้งค่าบ่อย ๆ	50
การตั้งค่า MACD.....	59
ความยากอยู่ที่ศาสตร์หรือศิลป์ของการใช้	67
บทที่ 3 หลักการใช้ MACD.....	72
ข้อตกลงแรก.....	73
นิยามของเทรนด์	80
ลักษณะของเทรนด์	84
รูปแบบราคา Buy Sell และ Sideway.....	88
พฤติกรรมราคา Buy กับ Sell แตกต่างกันเพราะอะไร	88
อัตราเร่งปัจจัยสำคัญของ MACD.....	93

อัตราเร่งที่ 1.....	94
อัตราเร่งที่ 2.....	100
อัตราเร่งที่ 3.....	105
บทที่ 4 บทส่งท้าย.....	111
ตัวอย่างกราฟและการวิเคราะห์ MACD	111
ตัวอย่างที่ 1.....	112
ตัวอย่างที่ 2.....	114
ตัวอย่างที่ 3.....	116
ตัวอย่างที่ 4.....	118
ตัวอย่างที่ 5.....	120
ตัวอย่างที่ 6.....	123
ตัวอย่างที่ 7.....	125
ตัวอย่างที่ 8.....	127

ตัวอย่างที่ 9.....	128
ตัวอย่าง 10.....	131
การสลับ Time Frame สำหรับวิเคราะห์ Trend	133
กฎเหล็กการใช้ MACD.....	140
ข้อตกลงเรื่องลิขสิทธิ์	144

บทนำ

คำแนะนำเกี่ยวกับการอ่าน

คำเตือน

หนังสือนี้ไม่เหมาะกับมือใหม่ในตลาด Forex และมีการใช้คำศัพท์ที่ไม่ได้อธิบายไว้พอสมควร ตัวอย่างเช่น MACD ซึ่งเป็น indicator บอกพฤติกรรมราคาชนิดหนึ่งในตลาด Forex การใช้คำศัพท์แบบนี้อาจจะทำให้ท่านงงได้ ถ้าหากท่านเพิ่งเข้ามาในตลาดได้เพียง 1-2 เดือน ยังมีคำศัพท์อีกมากมาย ที่ท่านต้องทำความเข้าใจ ขอให้อยู่ในตลาดไปก่อนและทดลองแบบลองผิดลองถูกไปก่อน ค่อยมาเก็บ Item ที่ละเอียด

หนังสือนี้เป็นหนังสือแบ่งปันประสบการณ์การเทรดและการใช้งาน MACD เพียงอย่างเดียวเท่านั้น และวัตถุประสงค์ของ MACD มีเพียงวัตถุประสงค์เดียวสำหรับผู้เขียน คือ ใช้บอกจุดเข้าเทรดและการถือออเดอร์ได้เพียงอย่างเดียวเท่านั้น ไม่สามารถบอกจุด

นอกจากการเทรด ไม่สามารถบอกเรื่องการจัดการการเงิน ไม่สามารถบอกทิศทางในการเทรดได้ และหนังสือนี้ไม่ได้รับรองว่าท่านจะทำกำไรได้หลังจากที่อ่านมันจบ

สิ่งที่ท่านต้องรับรู้อีกอย่างเกี่ยวกับการเทรดคือ การเทรดไม่สามารถเข้าถึงกำไรได้ด้วยเครื่องมือใดเพียงชนิดเดียว แต่ต้องไล่เก็บองค์ประกอบของการเทรดให้ครบแล้วจึงค่อยฝึกฝีมือ องค์ประกอบของการเทรดแต่ละคนใช้เวลาเก็บไม่เท่ากัน ซึ่งอาจจะใช้เวลา 5-10 ปีได้เลย ดังนั้นท่านต้องเข้าใจว่า เนื้อหาในหนังสือนี้คือองค์ประกอบเล็ก ๆ ของสิ่งที่ต้องใช้ในตลาดทั้งหมด ถ้าหากท่านสนใจในประสบการณ์ของผม ผมแนะนำหนังสือ “หลักการลงทุนใน Forex” และ “หลักการเก็งกำไรในตลาด Forex” ครับ

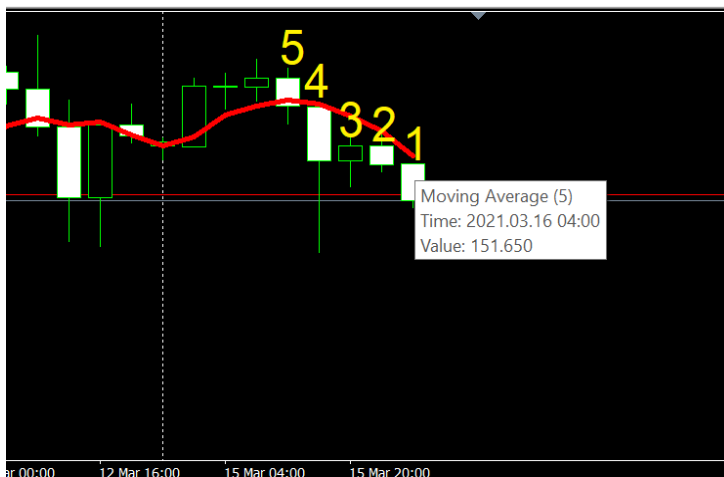
ไม่ได้มาขายอะไรที่หาได้ฟรีในเน็ต

หนังสือเล่มนี้เป็นหนังสือค้นเวลาอ่านครับ ระหว่างที่ผมพัฒนา EA อยู่ฉันพยายามหาเครื่องมือที่บอกเทรนด์โดยใช้ MACD แต่ผมพบรูปแบบอย่างหนึ่ง คือ การเคลื่อนไหวที่ค่อนข้างมีรูปแบบที่ชัดเจน มันทำให้ผมคิดว่า ผมน่าจะทำการบันทึกรูปแบบการเทรดของ MACD ไว้ เออ...เราก็น่าจะทำเป็นหนังสือมันซะเลย ไหน ๆ ก็ไหน ๆ แล้วก็ให้ได้ประโยชน์กันหลาย ๆ ทาง ผมก็ได้ใช้ คนอื่นก็ได้อ่าน นี่จึงเป็นที่มาของหนังสือเล่มนี้ครับ

หนังสือเล่มนี้เกี่ยวกับ MACD แต่ถ้าใครเคยอ่านงานเขียนของผม หนังสือของผมนักจะไม่ได้พูดถึงสิ่งที่มีแจกฟรี หรือหาอ่านได้ตามอินเทอร์เน็ตอยู่แล้ว ของที่มันหาอ่านได้ฟรีตามอินเทอร์เน็ตถ้ามันใช้ได้จริงก็คงรวบกันไปหมดแล้ว บางอย่างมันก็อาจจะมีการพูดถึงบ้าง แต่สำหรับหนังสือของผม ผมคงไม่เอาประวัติของ MACD มาพูด หรือว่าใครเป็นผู้สร้าง ผู้อ่านคงสามารถหาอ่านได้ตาม Google ดีกว่าครับ

หนังสือเล่มนี้เป็นส่วนหนึ่งของการค้นคว้าระบบเทรดโดยใช้การเรียนรู้ของเครื่องจักร (Machine Learning) ส่วนมากผมจะเขียนหนังสือจากประสบการณ์ของผมเองครับ แล้วทำไม Machine Learning มันจะมาเกี่ยวกับ MACD ได้อย่างไรต้องทำความเข้าใจยาวหน่อย ผมเลยเอามาอธิบายในนี้ก็แล้วกันครับ

ปกติแล้ววิธีการที่ใช้ในการเรียนรู้ของเครื่องจักรหรือ Machine Learning นั้นจะใช้วิธีการทางสถิติในการวิเคราะห์ ตัวอย่าง การวิเคราะห์ราคาที่เป็นที่รู้จักดีได้แก่ Time Series Analysis หรือ การวิเคราะห์ที่มีลำดับเวลาต่อเนื่องเหมือนกราฟแท่งเทียนที่เรียงตัวกันนั้นแหละเป็นศาสตร์การวิเคราะห์ราคาโดยใช้ตัวมันเอง หรือ ราคาในอดีตมาวิเคราะห์การเคลื่อนไหวของราคาในอนาคต หรือแม้แต่ Regression หรือ สมการถดถอยในการวิเคราะห์การพยากรณ์ราคาของ Forex โดยใช้หลักการที่เรียกว่า Moving หรือก็คือ การกำหนดจำนวนแท่งในการคำนวณแบบเคลื่อนที่



ภาพที่ 1 การกำหนดจำนวนแท่งในการคำนวณแบบเคลื่อนที่

ที่มา: โปรแกรม Metatrader (MT4)

ผมก็ต้องบอกอย่างนี้ครับ ด้วยหลักการแบบ Moving นี้แหละครับที่ทำให้ระบบเทรด หรือ EA ส่วนใหญ่ใช้ไม่ได้ผลเลย ทำไม่ชนะหรือ ก็เพราะว่าในโลกของความเป็นจริง ทุกสิ่งทุกอย่างมันไม่ได้คงที่หรือตายตัวนะสิครับ

มันหมายความว่าอย่างไร หมายความว่า ในโลกของการเทรด
 ขนาดความยาวของเทรนด์มันไม่แน่นอน บางเทรนด์มันยาวแค่
 10 แท่งเทียน บางเทรนด์มันยาวและกินเวลาถึง 1,000 แท่งเทียน
 ก็มี บางเทรนด์มันเปลี่ยนไปเปลี่ยนมา เช่น ขึ้น 10 แท่ง ลง 20
 แท่ง ขึ้น 30 แท่ง ลง 10 แท่ง สลับกันไป พอนักภาพอกใหม่
 ครับ ว่าปรากฏการณ์ในตลาด Forex เป็นแบบนี้ แต่พอเราจะวัด
 ความยาวเทรนด์ของ MACD เรากลับใช้ค่าคงที่ (ค่าที่ตั้งค่า
 MACD) ในการวัดและใช้มันไปตลอดทุกเทรนด์มันเลยใช้ไม่ได้ ซึ่ง
 ถ้าผู้อ่านคิดว่าปรากฏการณ์แบบนี้เป็นจริง เราก็อาจจะมีส่วนของ
 ความคิดเห็นพ้องกับเนื้อหาในหนังสือเล่มนี้แล้วล่ะครับ



ภาพที่ 2 กราฟแท่งเทียนค่าเงิน GBPJPY

ในภาพเป็นกราฟแท่งเทียนค่าเงิน GBPJPY กราฟ 4H จะเห็นว่าใช้เส้น MA เส้นเดียวค่า 10 MA ในการคำนวณ แต่ว่าจำนวนแท่งของเทรนด์ ความยาวของแท่งไม่ได้เท่ากัน ถ้าเรามองใน Time Frame เล็กอย่าง 4 ชั่วโมงเราอาจจะไม่เข้าใจ แต่ถ้าเรามองไปใน Time Frame ใหญ่ เราจะเห็นเลยว่า การเกิดพฤติกรรมราคา สลับขึ้นลงไปมาใน Time Frame เล็กนั้น มันจะเต็มไปด้วยสัญญาณหลอก และใน Time Frame ใหญ่มันจึงมีสัญญาณชัดเจน ดูรูปต่อไปนี้



ภาพที่ 3 กราฟแท่งเทียนค่าเงิน GBPJPY

นี่เป็นรูปกราฟ GBPJPY ใน Time Frame 4H จะเห็นว่าสัญญาณ
หลอกเต็มไปหมด มันทำให้การเทรดของเราได้ราคาแพงเพราะว่า
MA มันให้สัญญาณเข้า แล้วเราต้องออกจากออเดอร์เทรดเพราะ
มันเปลี่ยนทิศทางตื้อขึ้นตื้อลงเนื่องจากคิดว่ามันจะเปลี่ยนเทรนด์
แล้ว ทั้งนี้ก็เพราะว่าลักษณะของเทรนด์มันมีหลายรูปแบบ ซึ่ง
รูปแบบเทรนด์นี้เราลองไปดู Time Frame ที่เป็นคลื่นเทรนด์จริง
ๆ ของมันในช่วงเวลาเดียวกันนี้



ภาพที่ 4 กราฟ GBP JPY Time Frame Week

ภาพข้างบนเป็นกราฟช่วงเวลาเดียวกัน แต่ว่าเป็น Time Frame Week นั้นเพราะว่าเทรนด์มันเกิดใน Time Frame ใหญ่ แต่กว่าจะขึ้นแค่นั้น ใน Time Frame 4 ชั่วโมงมันแกว่งตัวขึ้น ๆ ลง ๆ ได้เป็นสิบลรอบแล้วจบด้วยการขึ้น เพราะว่า 1 แท่งของ Time Frame Weekly มันเท่ากับ 30 แท่งของ Time Frame 4H เลย

ก็ถ้าหากว่าท่านเห็นว่ามันเป็นแบบนี้จริง ผมก็จะชี้ให้เห็นว่าทำไม indicator ส่วนใหญ่ใช้ไม่ได้ เพราะอะไร? เป็นแบบนี้ครับ ถ้าหากราคาเคลื่อนไหวตามระยะทางที่ไม่แน่นอนอย่างที่ผมว่า เวลาเราใส่ indicator เข้าไป เราจะมีการตั้งค่า Parameter ของ indicator อย่างหนึ่ง เช่น Moving Average (10) หรือก็คือ การใช้ค่าจำนวน Moving Average 10 แท่งสุดท้ายมาคำนวณค่าเฉลี่ย

ลองเอาภาพแรกที่ผมอธิบายมาประกบกับสูตรคำนวณดูครับ สมมติว่าแท่งเทียนยาว 5 แท่งแล้วมันเปลี่ยนเทรนด์ แต่เราใช้

Moving Average 10 แท่ง มันหมายความว่า การใช้ค่าเฉลี่ย 10 แท่งมาคำนวณความเร็วเทรนด์ 5 แท่งที่มันเปลี่ยนแล้วมันก็กลายเป็นว่า Indicator ตัวนั้นจะใช้ไม่ได้ มันก็เลยกลายเป็นปัญหาตามมาทีหลังว่า “ไอ้ Moving Average ที่ว่าจะใช้บอกทิศทาง การเคลื่อนไหวราคาช่วงแกว่งตัวสั้น ๆ แบบนั้นไม่ได้”

เซียนเทรดหลายคนบอกว่า อ้อ!!!! ไอ้ Moving Average มันใช้บอกเทรนด์ เราไปใช้วัดการเคลื่อนไหวช่วง Sideway มันก็ไม่ได้ผลหนะสิ ไม่ใช่ครับ Sideway มันก็แค่เทรนด์ที่ระยะมันสั้นกว่าเท่านั้นเอง ตามที่ผมยกตัวอย่าง Time Frame 4 ชั่วโมงและ Time Frame Week นั้นแหละ ปัญหามันไม่ได้อยู่ที่ตรงนั้น ปัญหาคือ การใช้ indicator เพื่อพยากรณ์ราคานั้น มันยอมเคลื่อนไหวช้ากว่าราคาอยู่แล้ว เพราะว่า Indicator ที่คำนวณมาจากราคามันจะไปเร็วกว่าราคาได้อย่างไร?



ภาพที่ 5 Sideway ใน Time Frame 4 ชั่วโมง

Sideway ในกรอบ Time Frame 4 ชั่วโมง

จากภาพข้างบนถ้าเราขยายไปดู Time Frame เล็กในช่วงเวลาเดียวกัน คุณจะเข้าใจว่า ทำไม Sideway ใน 4 ชั่วโมง ถึงเป็นเทรนด์ใน Time Frame เล็กกว่า เราจะขยายไปที่ 5 นาทีกัน



ภาพที่ 6 กราฟแท่งเทียนค่าเงิน GBPJPY Time Frame 5 นาที

ภาพใน Time Frame 5 นาทีที่คุณจะเห็นเลยว่าไอ้ที่เรียกว่า Sideway มันมีเทรนด์ขึ้นลงชัดเจนเลย เพราะฉะนั้นเทรนด์ ใน 4 ชั่วโมงมันก็ไม่แตกต่างกันหรือครับว่า มันจะเป็นแค่ Sideway แท่งหนึ่งหรือสองแท่งในกราฟ Week หรือกราฟ Month

นี่เป็นปัญหาเบสิกที่เทรดเดอร์ส่วนใหญ่ไม่ค่อยเข้าใจ แล้วก็มักแต่ไปงมหา Indicator เทพ ๆ เพื่อที่จะนำมาตอบโจทย์ทุกอย่าง กล่าวคือ indicator ที่ตั้งค่าครั้งเดียวแล้วมันใช้ได้ตลอดไป หรือก็คือมันเป็นปัญหาการรับรู้ของเทรดเดอร์ที่สำคัญอย่างแรกที่ผมเจอในกลุ่มนักเทรดหน้าใหม่ หรือจริง ๆ แล้วผมก็ไม่รู้เหมือนกันว่าคนอื่นคิดยังไงแบบไหน แต่เอาเป็นว่า หลักการของมันต้องมีเหตุมีผลสอดคล้องกันครับ

เมื่อเทรนด์เปลี่ยน การใช้งานของ Indicator ก็ต้องมีความเหมาะสมตามเหตุและผลของมัน เมื่อความยาวเปลี่ยนก็ควรจะมีการตั้งค่า indicator ให้มันเหมาะสมกับเทรนด์หรือว่าเปลี่ยน indicator ไปเลยจะดีกว่า การใช้ indicator มันจึงเป็นทั้งศาสตร์ของการพยากรณ์ และศิลปะแห่งการใช้งานเครื่องมือในการวิเคราะห์ราคา อย่างนี้แหละครับ

มาถึงตรงนี้หลายคนคงเห็นบ้างแล้วแหละว่า ทำไมปัญหาของการใช้ indicator ในการเทรด Forex มันมาจากอะไร แต่ในหนังสือเล่มนี้ผมก็ไม่ได้พูดแค่นี้หรอกครับ ผมพูดถึงการใช้งาน MACD แบบเจาะลึก ละเอียดอย่างที่ไม่เคยเขียนที่ไหนมาก่อน

ในบรรดา Indicator ทั้งหมดในตลาด Forex เครื่องมือที่ผมถนัดที่สุด มี 3 ตัวคือ Bollinger Band, MACD, และ Stochastic ครับ จะเห็นว่าผมมีทั้งเครื่องมือบอกเทรนด์และบอกการเคลื่อนไหวระยะสั้น หรือที่เรียกว่า Sideway แต่ผมอาจจะเห็นว่ามันเป็นเทรนด์ระยะสั้นครับ เล่มนี้เขียนถึง MACD อย่างเดียวเท่านั้นครับ เพื่อให้ได้ใช้งานกันได้เก่งไปเลย มันจึงมีรายละเอียดพอสมควร

ก่อนจากกันหัวข้อนี้ะครับ จำไว้ “คลื่นในตลาดมันก็ไม่แตกต่างจากคลื่นในอ่างเก็บน้ำ หรือทะเลหรอกครับ ในคลื่นลูกใหญ่จะมีองค์ประกอบเป็นคลื่นลูกเล็กอยู่เสมอ” ขึ้นอยู่กับเรา Focus คลื่น

ลูกไหน ถ้าเราเล่นคลื่นลูกใหญ่ เทรดนาน ๆ ครั้ง มันก็ไม่ทันใจ
 ความอยากรวยเร็วของเราที่เข้ามาในตลาด Forex อีก กว่าคลื่น
 Time Frame weekly จะมา รอจนหัวหงอกเพราะมันมาที่ 3 - 4
 ปีครึ่ง แต่แน่นอนถ้าได้ก็อึดเลยแหละเพราะมันลูกใหญ่

ครั้นพอเราไปเทรดคลื่นลูกเล็ก ๆ แล้วเทรดด้วย lot เล็ก ๆ หรือ?
 ก็ไม่ทันใจทำกำไรไม่ทันรวยครับ ก็ไม่รู้จะเข้ามาเทรดในตลาด
 Forex กันทำไมอีก เทรดเดอร์หน้าใหม่ก็ทนรวยไม่ไหวหรือครับ
 พวกเค้าก็เลยเทรดคลื่นลูกเล็กใน Time Frame เล็ก ๆ แล้วก็ใส่
 Lot ใหญ่ ๆ ผลสุดท้ายคืออะไรนะหรือ??? ล้างพอร์ตสิ

มันก็เหมือนเรือที่คุณท่องอยู่ในทะเลนั่นแหละ คุณมีเรือใหญ่ เจอ
 คลื่นใหญ่ ๆ ไม่บ่อยคุณก็ไม่ตื่นตื่น คุณอยากเจอคลื่น (เทรนด์)
 บ่อย ๆ ทางโบรกเกอร์เขาก็ให้ความสามารถในการหนดขนาดเรือ
 ให้เล็กลง (Leverage สูง ๆ) ทำให้คุณเทรดได้หลายคลื่นมากขึ้น
 แน่نون พอคลื่นลูกใหญ่มาจริง ๆ เอาแค่ระดับ Time Frame 4

ชั่วโมงมา คุณก็ล้างพอร์ตกันเต็มไปหมด เพราะว่าคุณเล่นไปเทรด
ระดับ Time Frame 15 นาที แต่ไปส่ง Lot ขนาดเดียวกันกับที่
ส่งทั้งหมดของ 4 ชั่วโมง มันก็ตายสิครับ เรือล่ม (ล้างพอร์ต)

ในตลาด Forex เทรนด์เป็นคลื่นที่คุณจะต้องขี่คลื่นไปให้ได้ไกล
มากที่สุดเหมือนนักโต้คลื่น จะทำยังไงให้เรือคุณไม่จม คลื่นเป็นสิ่งที่
ที่คุณต้องเรียนรู้ คลื่นเป็นสิ่งที่คุณต้องจับจังหวะและทำความเข้าใจ
เข้าใจ เมื่อคลื่นมันทำให้คุณไปได้ไกล แน่ใจว่าผลตรงข้าม มันก็
จมเรือคุณได้เช่นกัน

การเทรด Forex ก็ไม่ต่างจากกระดานโต้คลื่น มือใหม่เพิ่งเข้ามาก็
อยากจะโต้คลื่นตั้งแต่วันแรกแล้ว ทั้งที่ร่างกายยังไม่แข็งแรง ยืน
บนบอร์ด เอาตัวเองขึ้นบอร์ดยังไม่มีแรงเลย ก็อยากทำกำไรกัน
แล้ว ไม่ต่างจากนักเซิร์ฟบอร์ดหรอกครับ เขาก็ล้มบนบอร์ด หลุด
จากบอร์ดเป็นพัน ๆ ครั้ง การเทรดก็เหมือนกัน คุณจะต้องล้มจน

เข้าใจนุ่นแหละ ผมถึงบอกว่ามันต้องใช้เวลาเป็น 10 ปีถึงจะ
ชำนาญ

ปัญหาของการเทรดไม่ได้อยู่ที่เครื่องมือ

ถึงแม้ว่าจะเขียนเรื่องการใช้ indicator แต่สำหรับผู้อ่านซึ่งผมก็ไม
รู้ว่าท่านเป็นผู้อ่านหน้าใหม่หรือไม่ หรือว่าเป็นผู้อ่านที่เคยอ่าน
หนังสือของผม ผมขอชี้แจงก่อนว่า

**“ถ้าพึ่งแค่ Indicator มันไม่ได้ทำให้ท่านประสบ
ความสำเร็จในการเทรดได้”**

การเทรดมันมีองค์ประกอบหลัก ๆ 4 อย่าง ได้แก่ Mindset,
Money, Method, Management เป็นอย่างน้อย ซึ่ง
องค์ประกอบทั้ง 4 อย่างนี้ ผมทยอยเขียนเป็นหนังสือออกไปเรื่อย
ๆ ให้ผู้อ่านได้ค่อย ๆ ทำความเข้าใจ