

ความเรียบของการเคลื่อนไหวของราคา

ค่าเฉลี่ยเคลื่อนที่ เป็นวิธีธรรมดา ๆ วิธีหนึ่งในการที่จะทำให้การเคลื่อนไหวของราคานั้น ดูเรียบขึ้น คำว่า ค่าเฉลี่ยเคลื่อนที่นั้นหมายความว่าเราจะใช้ ราคาปิดเฉลี่ยของค่าเงินในจำนวนช่วงเวลาใดเวลาหนึ่งขึ้นมา



เหมือนกับ อินดิเคเตอร์ตัวอื่น ๆ (ใช้คำว่า Moving Average แทน ค่าเฉลี่ยเคลื่อนที่) Moving Average ใช้ในการคาดการณ์ราคาในอนาคต โดยดูความชันของค่าเฉลี่ย ซึ่งคุณสามารถทำนายทิศทางราคาว่าจะไปในทิศทางใด

อย่างที่เรบอก Moving Average ทำให้การเคลื่อนไหวของราคาเรียบขึ้น และมีรูปแบบต่าง ๆ ของการใช้ Moving Average ซึ่งแต่ละแบบก็มีความราบเรียบของตัวเองแตกต่างกันไป ซึ่งโดยทั่วไปแล้ว ยิ่งราคามีความราบเรียบมาก ยิ่งทำให้ปฏิกิริยา ของ Moving Average ช้าลง และยิ่ง Moving Average ไม่ราบเรียบมาก ก็จะตอบสนองต่อปฏิกิริยาการเคลื่อนไหวทิศทางราคาของตลาดได้เร็ว

เราจะอธิบายเรื่องนี้อีกที แต่ว่าตอนนี้เรามาดูความแตกต่างของ Moving Average แต่ละชนิด และจะมีหลักการคำนวณหาค่า Moving Average อย่างไร

Simple Moving Average

Simple Moving Average (SMA)

Simple moving average เป็นชนิดที่ธรรมดาที่สุดของเส้น [moving average](#) ปกติแล้ว เส้น Simple moving average จะคำนวณโดยใส่ค่าจำนวน (แท่งเทียน) ของราคาปิดแต่ละช่วงนั้น และหารด้วยจำนวนแท่งนั้น งงรีเปล่า???? งั้นแบบนี้ดีกว่า

ถ้าคุณใช้กราฟ 5 แท่ง ของ Simple Moving Average ใน Timeframe 1 ชั่วโมง คุณจะต้องใช้ค่าราคาปิดของ 5 ชั่วโมงที่แล้ว แล้วหารด้วย 5 คุณก็จะได้ค่า Moving Average ในเวอร์ชันของคุณ

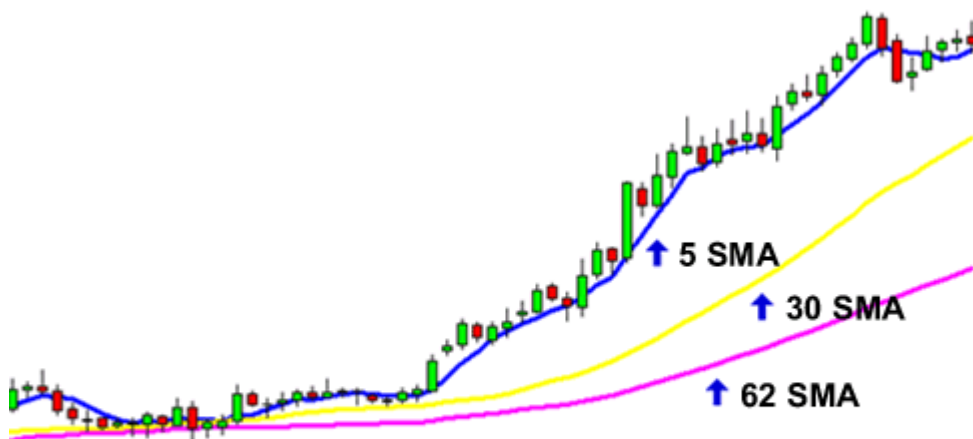
ถ้าคุณใช้กราฟ 5 แท่ง ในการคำนวณ Simple Moving Average ในกราฟ 10 นาที คุณจะต้องใช้ราคาปิด ของ เวลา 50 นาที ก่อนหน้า และหารด้วย 5

ถ้าคุณจะใช้กราฟ 5 แท่งในการคำนวณ Moving Average ในกราฟ 30 คุณจะต้องใช้ราคาปิดของเวลา ทั้งหมด 150 นาทีที่แล้วและ หาด้วยเลข 5

ถ้าคุณ จะใส่กราฟ 5 แท่งในการคำนวณ Simple Moving Average ในกราฟ 4 ชั่วโมง
เอ่อ.....โอเค คิดว่าคุณคงเห็นภาพแล้ว อ๊ะมาเข้าเรื่องกันซักที

ส่วนใหญ่โปรแกรมของคุณก็จะมีอยู่แล้ว แล้วก็ยังคำนวณให้คุณอย่างเสร็จสรรพอีกด้วย ส่วนเห็นผลที่เราเพิ่งจะทำให้คุณเบื่อ(หาว!!) เรื่องการคำนวณค่า Simple Moving Average ไปเมื่อ ก็ เพราะว่า มันสำคัญมาในการที่คุณต้องรู้ว่า ค่าเหล่านั้นหาได้อย่างไร ถ้าคุณเข้าใจแล้วว่าค่าต่าง ๆ เหล่านั้น คุณจะรู้ได้ว่าแบบไหนที่คุณอยากจะใช้

เช่นเดียวกับ อินดิเคเตอร์ ตัวอื่น ๆ Moving Average จะเคลื่อนไหวช้า เพราะว่า เป็นราคาเฉลี่ยของค่าเงินนั้น ๆ คุณทำได้แค่ ทำนายราคาในอนาคต เท่านั้น ไม่ใช่เราจะรู้ราคาในอนาคตได้ จำไว้ว่า Moving Average ไม่สามารถเปลี่ยนให้คุณเป็น Ms Cleo ผู้มีพลังจิต บังคับสิ่งต่าง ๆ ได้ (ไม่รู้เหมือนกันว่า Ms. Cleo คือใคร?)



นี่เป็นตัวอย่างของ Moving Average ทำให้ราคานั้น เรียบขึ้นได้อย่างไร

ในกราฟก่อนหน้านี้ คุณจะเห็น เส้น SMAs(Simple Moving Average) อย่างที่คุณเห็น ยิ่งคุณใช้ระยะเวลามากขึ้นเท่าไร ดูที่เส้น SMA 62 วัน ซึ่งอยู่ห่างจากราคาปัจจุบันมากกว่า เส้น SMA 30 และ เส้น SMA 5 วัน ซึ่งนี่เพราะว่า เส้น SMA 62 ใช้ราคาปิดของ 62 แท่ง แล้วหารด้วย 62 ยิ่งคุณใช้ตัวเลขเยอะเท่าไร ยิ่งทำให้เส้น Moving Average มีปฏิกริยากับราคาลดน้อยลง

เส้น SMA ในกราฟจะแสดงให้คุณถึงอารมณ์ตลาด ณ เวลา นั้น ๆ แทนที่เราจะต้องดูแลราคาปัจจุบันของตลาดปัจจุบัน เส้น Moving Average จะเปิดมุมมองที่กว้างให้คุณได้มากกว่า ทำให้คุณสามารถทำนายราคาได้ชัดเจนมากขึ้น.

Exponential Moving Average

Exponential Moving Average (EMA)

แม้ว่า เส้น [simple moving average](#) จะเป็นเครื่องมือที่ยอดเยียม แต่ก็ยังมีข้อบกพร่องอยู่ด้วยเช่นกัน เพราะว่า Simple moving averages อ่อนไหวเกินไปต่อการเคลื่อนไหวราคาที่เปลี่ยนแปลงเยอะ จึงลองมาดูตัวอย่างกัน

สมมติว่า เราสร้าง เส้น SMA 5 แห่งขึ้นมาในกราฟ Day ในกราฟ EUR/USD และ ราคาปิดของ 5 วันก่อนหน้าดังนี้

Day 1: 1.2345

Day 2: 1.2350

Day 3: 1.2360

Day 4: 1.2365

Day 5: 1.2370

Simple moving average จะถูกคำนวณดังนี้

$(1.2345 + 1.2350 + 1.2360 + 1.2365 + 1.2370) / 5 = 1.2358$

พอเข้าใจบ้างแล้วใช่ไหมล่ะ?

เอาล่ะ ทีนี้ ถ้าวันที่ 2 ราคา 1.2300? ผลก็คือ เส้น SMA จะทำให้เส้น ลดต่ำลงมาก ซึ่งบางครั้ง การเคลื่อนไหวของราคาแบบนั้น อาจเกิดขึ้นแค่วันเดียวเท่านั้น ในความจริง (อย่างเช่นข่าวการประกาศลด หรือ เพิ่มอัตราดอกเบี้ย)

ประเด็นก็คือ บางครั้ง เส้น Simple Moving Average อาจจะไม่ธรรมดาเกินไป และถ้าคุณมีวิธีที่จะกรอง สัญญาณความผิดพลาดของเครื่องมือ ในช่วงที่ราคาเกิดการเคลื่อนไหวอย่างรุนแรง เช่นนี้ คุณก็จะลดความผิดพลาดในการตัดสินใจเทรดของคุณ อืมมมมมมมม เดียวก่อน ไซ มีสิ ยังพอมีทางอยู่!

เราเรียกมันว่า Exponential Moving Average!

Exponential moving averages (EMA) จะให้น้ำหนักมากกว่าในราคาที่เป็นปัจจุบัน จากตัวอย่างข้างบนของเรา เส้น EMA จะให้น้ำหนักมากกว่าบนวันที่ 3-5 ซึ่งราคาที่เปลี่ยนแปลงในวันที่สองจะมีผลน้อยมากกับค่าเฉลี่ย และจะไม่กระทบกับเส้น Moving Average มากนัก ซึ่งตอบสนองความต้องการของเทรดเดอร์ได้มากกว่า



เมื่อเราเทรด สิ่งที่สำคัญที่สุดคือ ราคาตลาดที่เทรดในปัจจุบัน มากกว่าที่เราจะให้ความสำคัญกับราคาที่เกิดขึ้น เมื่อสัปดาห์ที่แล้วหรือ เดือนที่แล้ว

SMA vs. EMA

แล้วอันไหนดีกว่า ระหว่าง : *Simple or Exponential?*

อันดับแรก เราลองมาเริ่มดูตรง [exponential moving average](#) กันก่อน เมื่อคุณต้องการราคาเฉลี่ยที่ตอบสนองต่อราคามากน้อย คุณควรใช้ EMA ที่ใช้ระยะเวลาสั้น มากน้อย ซึ่งจะทำให้คุณ จับเทรนด์ได้เร็วมากขึ้น หมายความว่า คุณก็จะมีโอกาสได้กำไรเยอะเช่นกัน จริง ๆ แล้วยิ่งคุณจับเทรนด์ได้เร็วเท่าไร คุณก็สามารถอยู่ในเทรนด์ได้นานขึ้นเท่านั้น และนั่นหมายความว่า กำไรก็สูงขึ้นด้วย

ส่วนข้อเสียของ การใช้ Moving Average ที่จับเทรนด์ได้เร็ว คือ คุณอาจจะเจอสัญญาณหลอก เพราะว่า เส้น Moving Average นั้น ตอบสนองการเคลื่อนไหวของราคาเร็วเกินไป คุณอาจจะคิดว่า เทรนด์กำลังเกิดขึ้น แท้จริงแล้วมันอาจจะเป็นช่วงที่ราคากระชากลงเท่านั้นเอง

และ ถ้าเป็น [simple moving average](#) เมื่อคุณต้องการให้ Moving Average นั้นมีความราบเรียบกว่า การตอบสนองต่อราคาของตลาด ซึ่งยิ่งเราใช้ SMA ในช่วงเวลาที่สูงขึ้นเพียงใด ก็ จะมีความเรียบของสัญญาณมากขึ้นเท่านั้น

แม้ว่า เส้น Simple Moving Average จะตอบสนองต่อพฤติกรรมราคาของตลาดช้า แต่ว่า มันก็จะทำให้คุณปลอดภัยจากสัญญาณหลอก หลาย ๆ สัญญาณ แต่ข้อเสียของมัน คือ มันอาจจะให้สัญญาณช้าเกินไป และ ทำให้คุณพลาดโอกาสในการได้เข้าเทรดที่ราคาที่ดีที่สุดไป

	SMA	EMA
ข้อดี	ให้สัญญาณที่เรียบ และขจัดสัญญาณหลอกได้ดี	เคลื่อนไหวได้เร็ว และแสดงปฏิกิริยากับราคาที่เคลื่อนไหวปัจจุบันได้ดี
ข้อเสีย	เคลื่อนไหวช้าเกินไปซึ่งทำให้เราเข้าส่งออเดอร์ ไม่ว่าจะ Buy หรือ Sell	สัญญาณหลอกอาจจะมาก และทำให้เกิดสัญญาณผิดพลาด

แล้วแบบไหนดีกว่า มันขึ้นอยู่กับคุณว่าจะตัดสินใจเทรดเดอร์หลาย ๆ คนใส่เข้าไปทั้งสองชนิด โดยใช้ข้อดีของทั้งสองด้าน และอาจจะใช้ระยะเวลานานขึ้นในเส้น Simple Moving Average ในการหาเทรนด์ และใช้ เส้น Exponential Moving Average ในการหาจุดเข้าที่ดี

จริง ๆ แล้ว ระบบเทรดหลาย ๆ ระบบ ก็ถูกสร้างโดยใช้แนวคิดนี้ ซึ่งเราเรียกว่า “Moving Average Crossovers”. และในบทต่อ ๆ ไปในบทเรียนของเรา ก็จะมีตัวอย่างนี้เข้ามาซึ่งคุณก็จะได้รู้ว่า คุณจะใช้ Moving Average ในการสร้างระบบของคุณอย่างไร

เริ่มมองเห็นหนทางกันบ้างแล้วใช่ไหม เปิดกราฟขึ้นมา แล้ว ลองใส่ กราฟ Moving Average เข้าไปซักอันสองอัน แล้วลองเทียบความแตกต่างของมันใน เส้น Moving Average ที่มีอยู่ในโปรแกรมเทรดของคุณ ว่ามันแตกต่างกันอย่างไร ในช่วงเวลาที่เราใช้ในการคำนวณค่าเฉลี่ยเคลื่อนที่ และ คุณก็จะรู้ว่า คุณควรจะใช้ Moving Average แบบไหน ที่จะเหมาะกับตัวคุณมากที่สุด เลิกเรียนได้!!!!

สรุป

- เส้น [moving average](#) เป็นวิธีการหนึ่งที่ทำให้ทิศทางราคาดูเรียบขึ้นและง่ายต่อการทำความเข้าใจ
- มี เส้น Moving Average มีหลายประเภท แต่ว่า มีสองประเภท หลัก ๆ คือ [Simple Moving Average](#) และ [Exponential Moving Average](#).
- Simple moving averages เป็นเครื่องมือที่สามัญที่สุดของ เส้น moving averages, แต่ก็ยังมีจุดบอดอยู่
- Exponential moving averages ให้น้ำหนักมากกว่า และให้ความสำคัญมากกว่า ที่ราคา ณ จุดปัจจุบัน ดังนั้น มันจึงแสดงอารมณ์ตลาดที่เกิดขึ้นตอนนั้น
- เป็นเรื่องสำคัญมากที่เราต้องรู้ว่าเทรดเดอร์กำลังคิดและทำอะไรกันตอนนี้ มากกว่า ที่จะให้ความสำคัญกับสิ่งที่เกิดขึ้น สัปดาห์ที่แล้ว
- Simple moving averages นั้นให้สัญญาณที่เรียบกว่า Exponential moving averages.
- ยิ่งใช้เวลาที่มากขึ้นในการคำนวณ กราฟที่ออกมา ก็มีความเรียบของสัญญาณ มากกว่า กราฟที่ใช้เวลาในการคำนวณค่าเฉลี่ยเคลื่อนที่น้อยวัน

- ค่าเฉลี่ยเคลื่อนที่ ที่ใช้ค่าใก้การคำนวณน้อย นั้น จะสามารถจับเทรนด์ได้เร็ว และตอบสนองต่อการจับเทรนด์ได้รวดเร็ว อย่างไรก็ตาม เพราะว่าด้วยปฏิกิริยาที่จับความเคลื่อนไหวของตลาดได้เร็วนี้ ทำให้เกิดสัญญาณหลอกมากมาย
- moving averages ที่มีสัญญาณเรียบนั้น จะตอบสนองพฤติกรรมของราคาได้ช้า แต่ว่าจะช่วยคุณจากสัญญาณหลอกได้ อย่างไรก็ตาม เพราะว่า ด้วยปฏิกิริยาที่ช้านี้ทำให้คุณอาจจะตัดสินใจได้ช้าและพลาดโอกาสดี ๆ ไป
- วิธีที่ดีที่สุดในการใช้เส้น Moving Average คือ การใส่กราฟ Moving Average หลาย ๆ ชนิดเข้าไปในกราฟ ดังนั้นคุณจะเห็นทั้งการเคลื่อนไหวเทรนด์ระยะยาว และกราฟเคลื่อนไหวในช่วงสั้น ๆ

www.thailandinvestorclub.com