

Breakout and Rebound scouter

By Tiger Morbucks

แนวคิด

[Desktop]

ต้องการที่จะเทรดไปกับความผันผวนของราคาโดยไม่ต้อง Bias ไปกับราคาขึ้นหรือลงมากนัก ก็จะมีวิธีหนึ่งที่คุ้นเคยกัน ก็คือ Breakout กับ Rebound

อยากจะรู้ว่า ถ้าใช้แค่ 2 อย่างนี้ ผลการเทรดจะเป็นอย่างไรบ้าง ก็เอา 2 อย่างนี้มาทำระบบ โดยเอา Periods มาจับ

[Metatrader 4]

Periods คือจำนวน Bar chart จำนวน Bar ที่ผ่าน Higher high กับ Lower low ก็จะเปลี่ยนไปเปลี่ยนเป็น Bar ถัดมาเรื่อยๆ ถ้าราคาขึ้นไปมากกว่า Higher high หรือลงเกินกว่า Lower low เกินกว่าเส้น Signal ก็จะเป็น Breakout หรือถ้ายังเคลื่อนไหวอยู่ในกรอบเส้น Signal ก็จะเป็น Rebound

ดาวน์โหลด

[Github]

https://github.com/Phatsin/Breakout_and_Rebound_scouter

Code > Download ZIP

[Desktop]

จะมีอยู่ 2 Directory คือ Indicators จะมีไฟล์ Braekout_and_rebound_scouter.ex4 ไฟล์นี้จะเป็น indicator ให้เอาไปไว้ที่ Directory MQL4/Indicators และไฟล์ Braekout_and_rebound.ex4 ใน Experts ไฟล์นี้จะเป็น Robot ให้เอาไปไว้ที่ MQL4/Experts ใน Directory ของ MT4 เช่นกัน

วิธีการใช้งาน

[Metatrader 4]

Periods คือจำนวน Bar ดังที่กล่าวมาข้างต้น

Breakout point

Rebound point

Start bar คือ Bar เริ่มต้นที่เราต้องการจะดูนับย้อนหลังไปจาก Bar ปัจจุบัน 1000 คือนับย้อนไป(ทางซ้าย) Bar ที่ 1000 ที่เราจะเริ่มดู

Bars range คือจำนวน Bar ที่เราต้องการดู เช่น 100 คือ เราจะดู 100 Bar โดยเริ่มจาก Start bar แล้วนับไป(ทางขวา) จำนวน 100 Bar

Notification คือการแจ้งเตือนผ่าน app

Save คือการบันทึกค่า Inputs นี้ไว้ ใ้ภายหลังได้ด้วยการ Load

ที่หน้า Chart สามารถแก้ไขและกด Apply เพื่อดู Result ได้ แต่จะ Save Inputs ต่างๆ ไม่ได้ หากต้องการบันทึกไว้ให้เปิดหน้า Inputs แก้ไขแล้ว Save ไว้เป็น .set

การเปิดหน้า Input ได้โดยการ Double click ที่เส้น Signal หรือ คลิกขวาที่ Chart > Indicators List เลือก Braekout_and_rebound_scouter > Edit แก้ไข Input หรือ Load หรือ Save > OK

Reset จะเป็นการแก้ไขเป็นค่าตาม Inputs

Data จะเก็บ Result ของ indicator ไว้ที่ File breakout_and_rebound.csv ใน Directory Files ของ Metatrader 4

[Metatrader 4]

ย้อนดู Chart

ความหมายของเส้น

Upper คือเส้นบน เป็น Signal Higher high

Lower คือเส้นล่าง เป็น Signal Lower low

ทั้ง 2 เส้น จะมี 3 สี คือ สีน้ำเงิน, สีแดง, สีขาว

สีน้ำเงิน คือ ช่วงของ Signal ที่เป็น Up trend สีแดง คือ ช่วงของ Signal ที่เป็น Down trend และสีขาว คือ ช่วงที่ไม่มี Signal

จุดสีเหลือง คือ Entry เป็นสัญญาณการเข้า Order และเส้นสีเหลืองจะลากไปจนกว่าจะปิด Order คือ Exit เป็นสัญญาณวงกลมหรือสี่เหลี่ยมสีแดง ซึ่งวงกลมเป็นสัญญาณของ Breakout และสี่เหลี่ยมเป็นสัญญาณของ Rebound

การ Entry จะเกิดขึ้นเมื่อ Signal เปลี่ยน ส่วนการ Exit จะมี 2 กรณี คือ 1) Signal เปลี่ยน พร้อมกับการเข้า Order ใหม่ และ 2) เมื่อระยะถึงตาม Breakout points หรือ Rebound points ที่กำหนด ซึ่งผมมักจะเรียกว่า Full breakout หรือ Full rebound

ตัวเลขต่างๆ ของ Result

ตัวเลขต่างๆ นี้ มาจากผลที่ Indicator ทำงาน เปรียบได้เหมือนกับการ Back test ซึ่งต้องขออภัยว่าเป็นผลมาจากข้อมูลที่เกิดขึ้นมาก่อนหน้านี้แล้ว

Breakout counter คือ จำนวนการ ปิด Order ที่เป็น Breakout

Rebound counter คือ จำนวนการ ปิด Order ที่เป็น Rebound

Percentage ทั้ง 2 คำนวณมาจากทั้ง 2 ค่าออกมาเป็น Percentage รวมกันจะเท่ากับ 100

Breakout points คือ จำนวน Points จากการปิด Order ที่เป็น Breakout

Rebound points คือ จำนวน Points จากการปิด Order ที่เป็น Rebound

Percentage ทั้ง 2 คำนวณมาจากทั้ง 2 ค่าออกมาเป็น Percentage รวมกันจะเท่ากับ 100

ทั้งนี้ ค่าต่างๆ เหล่านี้คือการ Back test ได้มาจากข้อมูลในอดีต การจะนำข้อมูลมาใช้งานควรทำการ Back test อย่างสม่ำเสมอเพื่อปรับปรุงค่า Parameter ต่างๆ ซึ่งสิ่งนี้เองที่เป็นประโยชน์ของ Indicator นี้ เพื่อให้เราสามารถทำการ Back test เพื่อหาค่า Parameter ได้อย่างสะดวก

[Metatrader 4]

และสะดวกมากขึ้นด้วยการใช้ Short cut key ซึ่งมีคำแนะนำการใช้งานอยู่ที่หน้ากรอก Inputs

Number0 = "Alternate Breakout points and Rebound points";

เป็นการ สลับค่าระหว่าง Breakout points กับ Rebound points

Number1 = "Increase Bars range";

เป็นการเพิ่มค่า Bars range มากขึ้นด้วยการ + ค่าแรกของ Inputs

Number2 = "Reset";

คืนค่าเป็น Inputs แรก

Number3 = "Decrease Bars range";

เป็นการลดค่า Bars range ลงด้วยการ - ค่าแรกของ Inputs

Number4 = "Increase Start bar";

เป็นการเพิ่มค่า Start bar มากขึ้นด้วยการ + ค่าแรกของ Inputs

Number5 = "Apply";

Apply แล้วผลของ Indicator จะมาแสดงผลด้านล่าง

Number6 = "Decrease Start bar";

เป็นการลดค่า Start bar ลงด้วยการ - ค่าแรกของ Inputs

Number7 = "Move chart to start bar";

เป็นการเลื่อน Chart ไปที่ Start bar

Number8 = "Store data to .CSV file";

บันทึกค่าผลของ Indicator ไว้ที่ไฟล์ breakout_and_rebound.csv

Number9 = "Test sound";

ทดสอบเสียงการเตือน

ตัวอย่างการใช้งาน

[Metatrader 4]

Market Watch > XAUUSD > Chart Window > M5 TimeFrames > Shift end of the chart from right border > Zoom out

Navigator > Indicators > Breakout_and_Rebiund_scouter > Attach to a chart > Inputs > OK

Time Frames 5 นาที ที่ 5760 Bar range คือประมาณ 1 เดือน ที่ Periods 88 จะมี Transactions อยู่ที่ Breakout 1x บวก Rebound 3x คือ 4x Transactions ส่วน Points จะต่างกันอยู่ที่ 3xxx Points โดยทางฝั่ง Rebound ชนะ โดยดูจากสัญลักษณ์ กลมคือ Breakout สีเหลี่ยมคือ Rebound คราวนี้เราอยากดู Bars range ที่มากขึ้น ให้กดที่แป้น Numpad 4 เพื่อเพิ่ม Start ไปอีก 5760 Bars แล้วกด Numpad 5 เพื่อ Apply จะเห็นว่าเส้นหายไป เพราะว่าเส้นไปอยู่ที่ Start bar 11520 และ วาดมา 5760 ตาม Bars range ซึ่งไม่ถึงปัจจุบัน ซึ่งกรณีแบบนี้คือการย้อนไปดู Start bar ที่มากขึ้น เช่น 1 ปี แล้วดู Bars range ที่ละ 1 เดือน

คราวนี้เราลองกด Numpad 1 เพื่อเพิ่ม Bars range แล้วกด Numpad 5 จะเห็นว่าเส้นวาดมาถึง ปัจจุบัน และถ้ากดไปมาจนสับสนก็สามารถกด Numpad 2 เพื่อ Reset เป็นค่า Inputs เดิมได้

จากนี้จะทำการ บันทึกผล ให้กด Numpad 8 หรือปุ่ม DATA แล้วไปที่ดูที่ไฟล์ breakout_and_rebound.csv

[Desktop]

ไฟล์นี้จะอยู่ที่ Directory MQL4/File ของ Metetrader 4 เปิดดูจะเป็นไฟล์ CSV

การใช้งานข้อมูล

[LibreOffice]

ตัวอย่าง Chart

New Calc

select cell A:1 > Sheet > Link to External data > Browse > open เลือกไฟล์ breakout_and_rebound.csv เพื่อนำเข้าข้อมูล

select cell B:1 = A:A ลากไปประมาณ เท่าที่จำนวนเทรตหรือมากกว่าเยอะก็ได้ เพื่อที่จะ Copy ข้อมูลจาก column A มาทำ Chart ถ้าหากใช้ข้อมูลจาก Column A โดยตรงเลยจะมีปัญหาตอน Update ข้อมูล

select cell C:1 = B:1

select cell C:2 = C:1 + B:2 ลากไปเยอะๆเช่นเดียวกัน

select some cell For =SUM B:B ไว้ดูผล SUM ทั้งหมด

select some cell For =COUNT(A:A) ไว้ดูว่ามีกี่ Transactions

Insert > Chart... > Column > Select data range B and C > Data Series > Next > Deselect Display legend ไม่ต้องแสดงผลว่า Data ชื่ออะไร เพราะถ้าแสดง มันก็จะขึ้นแค่ Column B,

Column C > Finish

Add the Icon of Link to external file to Toolbar

เพราะว่า Toolbar เดิมไม่มี Icon Link to external file to Toolbar เราจึงจะทำการดึงเอา Icon นี้เข้ามาให้กดได้สะดวก

คลิกขวาที่ Toolbar > Customize Toolbar... > Search “Link” select Links to External Files and add to Assigned commands and Modify to change Icon

สามารถใช้ Command นี้เพื่อ Update ข้อมูลใหม่มาให้ Chart ได้โดยง่าย เพียงคลิก Update

การ Update Data Chart

[Metatrader 4]

ลองเปลี่ยนค่า Inputs เช่นลองเปลี่ยน Rebound points เป็น 500 กด Numpad 5 เพื่อ Apply กด Numpad 8 เพื่อเก็บ Data แล้วย้อนไปดู Data Chart ของเรา

[LibreOffice]

กด Icon Links to External Files ที่ทำไว้ แล้วกด Update จะเห็นข้อมูลที่เปลี่ยนไป

ลองกลับไปที่ Metatrader 4 กด 0 เพื่อสลับค่าระหว่าง Breakout points กับ Rebound points กด Numpad 5 เพื่อ Apply กด Numpad 8 เพื่อเก็บ Data แล้วย้อนไปดู Data Chart ของเรา

[LibreOffice]

กด Icon Links to External Files แล้วกด Update จะเห็นข้อมูลที่เปลี่ยนไป

ข้อควรระมัดระวัง

Indicator นี้ไม่ได้ใช้ Spread มาคำนวณด้วย ผู้ใช้ต้องคำนึงถึงจำนวน Transactions รวมกับ Spread ที่น่าจะเกิดขึ้น

Expert Advisors

[Metatrader 4]

Navigator > Expert Advisors > Braekout_and_rebound > Attach to a chart > Inputs > OK

ไฟล์ Braekout_and_rebound.ex4 เป็น Robot ที่จะเทรดอัตโนมัติโดยใช้สัญญาณการเข้าออก Order จาก Indicator Braekout_and_rebound_scouter.ex4 โดยเราสามารถเลือก Action ได้ 3 อย่าง คือ None ก็จะไม่ทำอะไร ใส่ไว้รอไปก่อน ส่วน Breakout คือการเลือกเทรดตามสัญญาณ Breakout และตัวเลือก Rebound คือการเลือกเทรดไปตามสัญญาณ Rebound โดยเลือกจำนวน Lot ได้จากช่อง Lots ในส่วนของ Open magic number เป็นการกำหนดหมายเลขให้ Order เพื่อให้ Robot รู้ว่า Order ไหน Bot เป็นผู้เปิด และ Close magic number คือการกำหนดให้บอทสามารถปิด Order ได้เฉพาะหมายเลขที่กำหนด หรือถ้าไม่กำหนด คือปล่อยให้ค่าว่าง บอทจะสามารถปิดได้ทุก Order