

ปริญญานิพนธ์เรื่อง	ระบบซื้อขายอัตโนมัติหลายสกุลเงิน
ชื่อนักศึกษา	นายพร้อมพันธุ์ ชัยมงคล นายกิตติชัย แสนหลวง
อาจารย์ที่ปรึกษา	อาจารย์ กิตตินันท์ น้อยมณี
หลักสูตร	วิศวกรรมศาสตรบัณฑิต
สาขาวิชา	วิศวกรรมคอมพิวเตอร์
ปีการศึกษา	2563

บทคัดย่อ

โครงการนี้ได้ทำการศึกษาปัญหาของการใช้ระบบเทรดอัตโนมัติทั่วไปนั้นจะใช้แนวคิดแบบไม่คำนึงถึงความเสี่ยงหรือการเปิดการซื้อขายโดยไม่คำนึงถึงหลักการบริหารทุน เทรดตามอารมณ์เป็นหลักซึ่งส่วนใหญ่ซึ่งผลที่ได้ก็คือ จะได้ระบบการเข้าคำสั่งซื้อที่ส่งผลเสียให้กับบัญชีของผู้ลงทุนและระบบไม่ยั่งยืนมีการขาดทุนสะสมที่มากพอจะทำให้หมดเงินลงทุนได้ง่ายดังนั้นในระบบของเราได้จัดทำขึ้นเพื่อเพื่ออำนวยความสะดวกในการค้าขายอัตราแลกเปลี่ยนระหว่างประเทศโดยใช้แนวคิดของค่าความสัมพันธ์ของคู่เงิน เป็นการอธิบายการเคลื่อนไหวระหว่าง 2 โปรดัคส์ทางการเงิน (คู่สกุลเงิน) เมื่อราคาของ 2 โปรดัคส์นั้นเคลื่อนไหวไปในทิศทางเดียวกันจะมีค่าความสัมพันธ์เป็นบวก และเมื่อราคาของ 2 โปรดัคส์นั้นเคลื่อนไหวในทิศทางตรงกันข้ามจะมีค่าความสัมพันธ์เป็นลบ

ผลการทดสอบโปรแกรมเทรดระบบซื้อขายอัตโนมัติหลายสกุลเงิน สรุปโดยภาพรวมคือการนำเอาค่าความสัมพันธ์ของคู่สกุลเงิน (Forex Correlations) EURUSD GBPUSD USDCHE สำหรับการซื้อขายรวมถึงการใช้กลยุทธ์ตัวบ่งชี้ (Indicator bollinger Band) เพื่อหาจุดซื้อขาย (Unique Selling Point) และปรับปรุงผลลัพธ์เพื่อให้มีประสิทธิภาพผ่านโปรแกรมเมต้าเทรดเดอร์ไฟว์ (Metatrader 5) เพื่อหาค่าอัตราส่วนของผลกำไรและผลขาดทุน (Profit Factor) และ เพอร์เซ็นต์การขาดทุนสะสม (Drawdown) ที่เหมาะสมมาวิเคราะห์ข้อมูล ผ่านโปรแกรมควินท์อนาไลเซอร์ (Quant Analyzer) เพื่อสรุปผลการทำงานของระบบ

คำสำคัญ: โปรแกรมเทรดอัตโนมัติสำหรับฟอเร็กซ์, การซื้อขาย, เงินตรา, อัตโนมัติ, อัตราการแลกเปลี่ยน