

การดำเนินการตามขอบเขตที่กำหนดผ่านตัวชี้วัด CCI บนรูปแบบการบริหารจัดการเงิน

An Implementation of Zoning Method with CCI Indicator Based on Money Management

กิตตินันท์ น้อยมณี¹, อนุพงษ์ ไพโรจน์², ปรัชญ์ ปิยะวงศ์วิศาล³, เจษฎาพงศ์ รัตน⁴, พรชัย กำแดง⁵
สาขาวิชาวิศวกรรมคอมพิวเตอร์ คณะวิศวกรรมศาสตร์ มหาวิทยาลัยเทคโนโลยีราชมงคลล้านนา เชียงใหม่
128 ถนนห้วยแก้ว ตำบลช้างเผือก อำเภอเมือง จังหวัดเชียงใหม่ 50300 โทรศัพท์ 053-921444 ต่อ 2130

E-mail thailandfxwarrior@gmail.com¹, anupong@gmail.com², piyawong@gmail.com³, mvhitt@gmail.com⁴, pangliverpool1991@gmail.com⁵

บทคัดย่อ

การใช้ระบบเทรดอัตโนมัติทั่วไปนั้นจะใช้แนวคิดแบบ Return base หรือ การเปิดการซื้อขายโดยการคำนึงถึง EGO เทรดตามอารมณ์เป็นหลักซึ่งส่วนใหญ่ซึ่งผลที่ได้ก็คือ จะได้ระบบการเข้า order ที่ส่งผลเสียให้กับบัญชีของผู้ลงทุนและระบบไม่ยั่งยืนมี drawdown ที่มาก ดังนั้นระบบของโครงการพบว่ามีอีกวิธีอีกทางเลือก คือ การใช้แนวคิดแบบ Risk base จะคำนึงด้านการบริหารเงินในบัญชีของผู้ใช้งานควบคู่กับการบริหารจัดการความเสี่ยง ซึ่งการนำแนวคิดนี้จะรวมไปถึงการเลือกโซนในระหว่างกราฟของราคาแท่งเทียนที่ปิดสูงสุดและปิดต่ำสุดของโซน 25 – 50 % กราฟ ซึ่งระบบของโครงการใช้แนวคิด KZM แบบ C หรือ Killer Zone Model แบบ C ซึ่งเป็น Close system โดยใช้ ตัวชี้วัดแบบ CCI รวมเข้ากับระบบที่บริหารดูแลตัวเองได้แบบยั่งยืนและปลอดภัย

คำสำคัญ : โปรแกรมเทรดอัตโนมัติสำหรับ forex, forex ea, ระบบเทรด KZM

Abstract

This project was conducted to develop and design close system followed Killer Zone by Mudleygroup (KZM model) for investment in forex run on Expert Advisor (EA) with Metatrader 4. Implementation of Zoning Method and ordered BUY only, No stop loss, No port clearing, and make a cash flow forever. Based on money management in a sense is risk base mainly, this model every zone will planed by Max Loss following KZM type A but only strategy This project will go by type c. KZM type C will trading with CCI Indicator by witting every signal before traded. After all. This close system will created in Expert Advisor (EA) in the KZM type C pattern as before.

Keyword: forex, KZM model, Zone trading, Expert Advisor, Forex close system

1. บทนำ

ในตลาด forex ว่ากันว่าถ้าอยากจะเป็นนักเก็งกำไรที่เก่งกาจจะต้องฝึกโดยเฉพาะกับการฝึกดูกราฟให้ชำนาญ อย่างไรก็ตามเหตุผลบางอย่างที่ว่า เหตุใดในปัจจุบันนักลงทุนจึงไม่ค่อยเห็นด้วยกับการฝึก ดูกราฟ ดูกราฟ ลากเส้นกราฟ แบบดั้งเดิมมากสักเท่าไรนัก งานทดลองที่ชี้ให้เห็นว่านักลงทุนสามารถที่จะสรุปผลและวิเคราะห์กราฟออกมาได้ต่างกัน ถึงแม้ว่ากราฟที่นักลงทุนเห็นนั้นจะเป็นกราฟของหุ้นตัวเดิมๆในช่วงเวลาเดิมๆไม่เปลี่ยนแปลง โดยความไม่สม่ำเสมอในการประมวลผลเหล่านี้สามารถเกิดขึ้นได้จากหลายๆสาเหตุ ไม่ว่าจะเป็นสภาพแวดล้อม, อารมณ์ และความเหนื่อยล้าของสมอง

งานวิจัยที่ชี้ให้เห็นว่าสมองของนักลงทุนนั้นถูกออกแบบมาเพื่อมองหารูปแบบบางอย่างอยู่เสมอ ซึ่งทำให้ในหลายๆครั้งนักลงทุนทำการสรุปถึงรูปแบบบางอย่างขึ้นมาโดยที่มันไม่มีจริง หรือมีอยู่จริงแต่ไม่มีประโยชน์ในการทำกำไร ดังนั้นเพื่อเป็นการเอาชนะความไม่สม่ำเสมอของอารมณ์และความเหนื่อยล้าทางเลือกหนึ่งที่ดีคงหนีไม่พ้นการนำระบบที่ได้จากการวิจัยและวิเคราะห์ มาแล้วมาทำให้เป็นโปรแกรมช่วยในการซื้อขายโดยอัตโนมัติซึ่งตัวโปรแกรมจะถูกสร้างจาก โปรแกรมการซื้อขายอย่าง Metatrader 4 โดยใช้การแก้ไขจากภาษา MQL4 มาทำการสร้าง Expert หรือ หุ่นยนต์ สำหรับการเทรด forex โดยเฉพาะ

2. ทฤษฎีที่เกี่ยวข้อง

ความสำเร็จจากการเทรด Forex นั้นไม่สามารถเกิดขึ้นได้เพียงแค่นักลงทุนมีแผนการเทรดที่ดีเท่านั้น อีกสิ่งที่สำคัญ และจำเป็น นั่นคือนักลงทุนต้องทำตามแผนนั้นอย่างมีวินัยด้วย เทรดตามแผน และไม่เทรดตามอารมณ์ ถึง ในขณะที่ ความกลัว อาจจะทำให้พลาดโอกาสที่ดีในตลาดได้เช่นกันถ้าหากจากตลาด Forex นั้นสูง และ เร็ว กว่าเทรดชนิดอื่นมาก อย่างไม่ต้องสงสัย การเข้าถึงตลาดนั้นก็ไม่มีข้อจำกัด, ความสั้นไหลของตลาด, เป็นการลงทุน โดยไม่จำเป็นต้องใช้เงินทุนมาก ด้วยอัตรา leverage ที่สูง และ ไม่มีข้อจำกัดในการ Short Selling ทำให้ตลาด Forex สามารถทำกำไรได้สูงมาก การวางแผนการลงทุนอย่างฉลาด

บทความวิจัย

การประชุมวิชาการเครือข่ายวิศวกรรมไฟฟ้ามหาวิทยาลัยเทคโนโลยีราชมงคล

Proceeding of The Conference of Electrical Engineering Network of Rajamangala University of Technology (EENET)

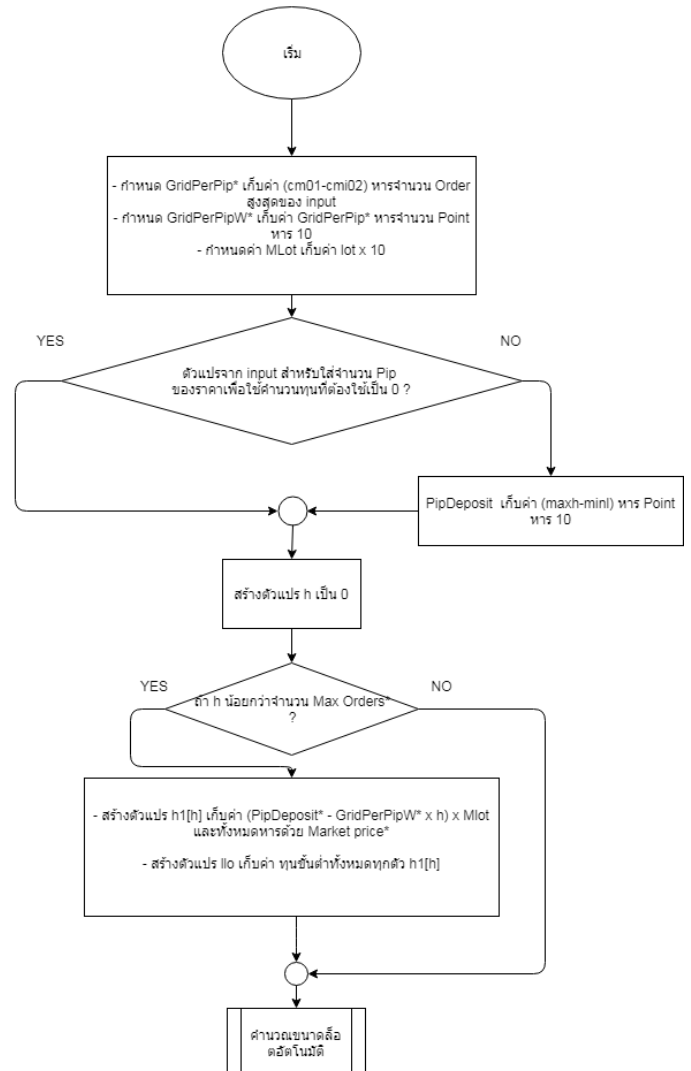
2.1 รายงานการศึกษาที่เกี่ยวข้อง

จากการได้ศึกษาหัวข้อบรรยายเรื่อง How to reduce Drawdowns ข้อมูลซึ่งเผยแพร่เมื่อวันที่ 12 พฤษภาคม 2017 โดยคุณเอก จาก YouTube Channel ที่มีชื่อว่า cwayinvestment ซึ่งได้ให้ข้อมูลเกี่ยวกับ How to reduce Drawdowns โดยมีรายละเอียด 5 ข้อสำคัญดังนี้ 1) วางแผน จำกัด Drawdowns ที่มีโอกาสเกิดขึ้นพร้อมรับมือ ตัวอย่างเช่น 50%, 40% และ 35% เป็นต้น จากนั้นวางระดับความคุมปริมาณ Drawdowns ออกเป็น 3 ระดับ (Level 1, Level 2 และ Level 3) โดยแต่ละระดับก็แบ่ง ออกเป็นสัดส่วนเปอร์เซ็นต์ตาม Drawdowns ที่ยอมรับได้ และวางแผน รองรับในแต่ละระดับ ค่า Drawdowns ปัจจัยหนึ่งที่มีผลคือ ค่าความผันผวนตลาด (Volatility of Market) และ ความผิดพลาดของผู้เทรด 2) ติดตามอย่างสม่ำเสมอผ่าน เว็บไซต์หรือแอปพลิเคชัน Myfxbook ซึ่งเป็น เว็บไซต์เก็บค่าสถิติของข้อมูลการเทรดต่างๆ รวมถึงค่า Drawdowns ในหัวข้อที่ทาการศึกษา ของส่วนขั้นตอนการลด 3) กระบวนการแก้ไข กรณี หากเกิดค่า Drawdowns เกินระดับที่ไว้วางแผนไว้ รู้ระดับ Drawdowns ที่เกิด หาเป้าหมายที่จะลด Drawdowns ในระดับนั้นๆ เช่นการทา ClashFlow ที่ได้ไปพบในส่วนทุนที่เกิด Drawdowns ตัวอย่างเช่น Drawdowns 20% ของทุนต้นที่ 1,000 \$ ก็หมายความว่า โอกาสเสี่ยงขาดทุนอยู่ที่ 200\$ โดยวางแผนไว้ล่วงหน้าว่าจะต้องใช้ ClashFlow ที่ส่วนของ 200\$ เพื่อนำไปลงทุนที่มีโอกาสดังกล่าว แผนการลงมือ หนึ่งในแผนพื้นฐานคือ การใช้ประโยชน์จากรอบเทรด โดยการลด Positions size ลง แล้วใช้จำนวนรอบในเทรดเพิ่มขึ้น โดยการเทรดในลักษณะนี้ ผู้เทรด ต้องใช้ความอดทนสูงเพราะระยะเวลาเข้าเทรดเพื่อลด Drawdowns จะนาน 4) การป้องกันการเพิ่มขึ้นของค่า Drawdowns โดยระดับที่ควรแก้คือ ที่ 20% ของค่า Drawdowns สูงสุด ถ้ามากกว่านี้อาจมีโอกาที่จะถูกเหวี่ยงจนเกิด Maximum Drawdowns ได้[10]

3. วิธีการออกแบบ

โดยทั่วไปการเทรดฟอเร็กซ์นั้นเราจะต้องมีความรู้ขั้นพื้นฐานมาก่อนรวมไปถึงปัญหาที่พบเจอในเรื่องของการทำกำไรกับตลาดได้แบบยั่งยืนและการควบคุมเงินทุนให้เปิดการซื้อขายในล็อตที่เหมาะสมรวมไปถึงมีการวิเคราะห์การหาค่าของ Drawdown ควบคุมให้คงที่หรือน้อยลงดังนั้นในบทนี้จะเริ่มอธิบายถึงปัญหาที่ต้องการที่จะต้องแก้ไขก่อนเป็นอันดับแรกและรวมไปถึงการอธิบายกระบวนการการแก้ไขปัญหาที่จะเกิดขึ้นให้ได้ผลลัพธ์ที่ตลาดหวังไว้โดยจะอธิบายถึงสาเหตุและปัญหาที่พบเจอในการเทรดฟอเร็กซ์อย่างไรให้สามารถมีโอกาสลดความเสี่ยงลงได้มากกว่าระบบทั่วไปและอธิบายถึงหลักการของการแก้ไขปัญหาที่เกิดขึ้นให้บรรลุผลตามความคาดหมาย

3.1 การสร้างระบบเทรดที่ยั่งยืน



รูปที่ 1 ผังงานการหาเงินทุนขั้นต่ำ

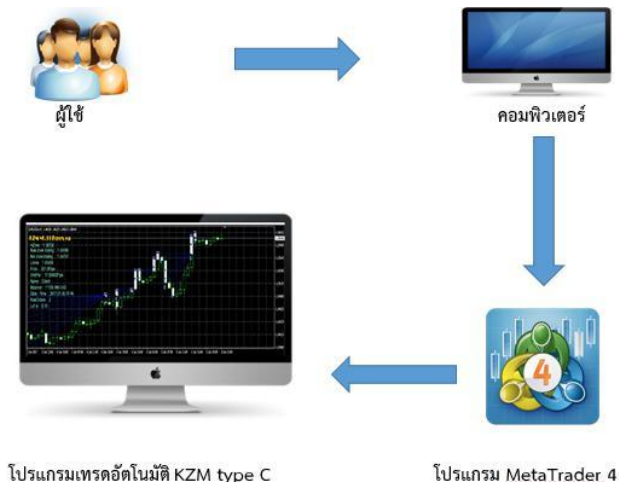
จากรูปที่ 1 ผังงานการแก้ไขปัญหาเพื่อสร้างระบบเทรดที่ยั่งยืน กับการคำนวณระบบล็อต จากรูปดังกล่าวจะแสดงให้เห็นว่าเมื่อทราบจำนวนทุนเงินฝากขั้นต่ำที่ระบบได้แนะนำให้ทราบแล้ว การที่จะเปิดขนาดคำสั่งการซื้อขายนั้นจะคำนวณจากเงินทุนที่ระบบมีอยู่ นำไปหารกับทุนที่ระบบแนะนำหรือทุนขั้นต่ำแล้วก็มาคูณค่าล็อตก็จะได้จำนวนล็อตที่เหมาะสมกับการบริหารความเสี่ยงร่วมด้วยกับการคำนวณทุนขั้นต่ำที่จะอยู่ในระบบเทรดแบบปิด

บทความวิจัย

การประชุมวิชาการเครือข่ายวิศวกรรมไฟฟ้ามหาวิทยาลัยเทคโนโลยีราชมงคล

Proceeding of The Conference of Electrical Engineering Network of Rajamangala University of Technology (EENET)

3.2 การออกแบบโปรแกรม



รูปที่ 2 บล็อกไดอะแกรม (Block Diagram) วิธีการใช้งานรวมของระบบ

จากรูปที่ 2 เป็นบล็อกไดอะแกรม (Block Diagram) แสดงภาพวิธีการใช้งานรวมของโปรแกรมระบบเทรดอัตโนมัติที่ทำงานตามแบบระบบการซื้อตามโซนโดยที่ผู้ใช้งานต้องทำการติดตั้งตัวโปรแกรมระบบเทรดอัตโนมัติที่ทำงานตามแบบ Killer Zone Model ประเภทของ C ลงในคอมพิวเตอร์ผ่านโปรแกรมเทรดฟอเร็กซ์อย่างโปรแกรม MetaTrader 4 เพื่อทำการติดตั้งและเปิดใช้งานระบบเทรดอัตโนมัติที่ทำงานตามแบบการซื้อตามโซนโดยมีตัวบ่งชี้ CCI มาช่วยในการเปิดคำสั่งซื้อและปิดการทำกำไร

3.2 ส่วนติดต่อผู้ใช้

Variable	Value
KZM_Order_Set_1	Order Setting
MagicExpert	8025
UseZoneClose	true
CommentOrder	FOREX KZM
Lot	0.01
AutoMaticLot	false
CommentEA	true
MaxOrders	20
ZoneTime	1 Hour
IndicatorTime	15 Minute
Range_Percent_MaxMin_Set_2	Percent Of Zone Order
UseCandleHighPercent	true
MaximumZone	50 %
UseCandleLowPercent	true
MinimumZone	25 %
RangeCandlestick	0
UseLowZone	true
Manager_Profile_Set_3	Management Accountant
Slippage	1
Min_Deposit_4	Good capital for deposit
PivDepositTest	0.0

รูปที่ 3 ระบบการป้อนข้อมูล

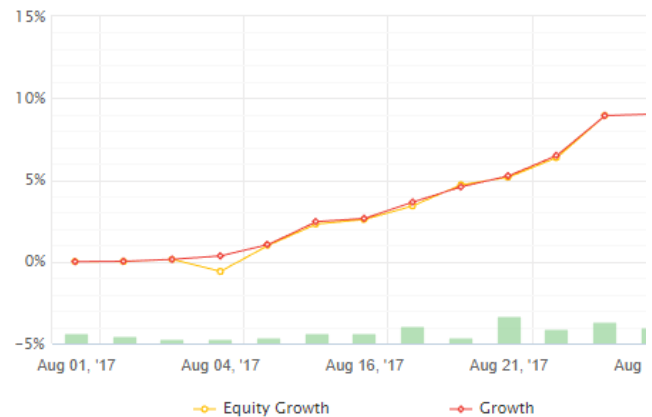
ระบบป้อนข้อมูลจะใช้ในการเก็บข้อมูลที่ได้จากการกำหนดข้อมูลพารามิเตอร์ส่งให้ตัวโปรแกรมทำการประมวลผลตามพารามิเตอร์ที่ได้รับมูลค่า

4. ผลการทดลอง

ในบทนี้จะกล่าวถึงผลการทดลองของโปรแกรม KZM_V.011 โดยมีการทดสอบประสิทธิภาพของโปรแกรมในแต่ละสภาวะของตลาดและทำการบันทึกผลการทดลอง

4.1 ผลการทำงานจริงของระบบตามสภาวะตลาดปัจจุบัน

ทำการทดสอบย้อนหลังตั้งแต่วันที่ 1 เดือนสิงหาคม 2017 ถึงวันที่ 15 กันยายน 2017 วิเคราะห์และประเมินผลโดยเว็บไซต์ Myfxbook URL: www.myfxbook.com และติดตามผลการทำงานจริงได้ที่ลิงค์ https://www.myfxbook.com/members/KZM_SYSTEM/kzm-ea-version01/2203251



รูปที่ 4 ภาพ Chart ในส่วนของ Growth

จากรูปที่ 5 แสดงให้เห็นว่าค่าขาดทุนสะสมสูงสุดยังอยู่ในระบบที่น้อยกว่าขอบเขตงานที่ได้วางเอาไว้ จากผลวิเคราะห์ที่ออกมาได้จากเว็บแอปพลิเคชัน Myfxbook นั้นได้แสดงให้เห็นว่าค่าขาดทุนสะสมสูงสุดของระบบอยู่ที่ร้อยละ 7.78 เท่านั้น ซึ่งน้อยกว่าค่าร้อยละ 50 ที่ตั้งเป้าสูงสุดเอาไว้เป็นอย่างมาก

บทความวิจัย

การประชุมวิชาการเครือข่ายวิศวกรรมไฟฟ้ามหาวิทยาลัยเทคโนโลยีราชมงคล

Proceeding of The Conference of Electrical Engineering Network of Rajamangala University of Technology (EENET)

Gain:	+12.5%
Abs. Gain:	+12.5%
Daily:	0.26%
Monthly:	8.07%
Drawdown:	7.78%
Balance:	\$22500.21
Equity:	(99.44%) \$22375.01
Highest:	(Sep 15) \$22500.21
Profit:	\$2500.21
Interest:	-\$198.47
Deposits:	\$20000.00
Withdrawals:	\$0.00

รูปที่ 5 ภาพแสดงค่าสถิติของภาพรวมระบบ

5. สรุปผลการทดลอง

โปรแกรมระบบเทรดอัตโนมัติ KZM EA ได้รับค่าทดสอบการประเมินจากการทบทวนหรือเปอร์เซ็นต์ Drawdown ผ่านการติดตามการทดสอบ forward test ผ่านเว็บไซต์ myfxbook.com น้อยกว่า 50 เปอร์เซ็นต์ได้

6. กิตติกรรมประกาศ

ปริญญานิพนธ์ฉบับนี้สำเร็จลุล่วงไปได้ด้วยความช่วยเหลืออย่างดียิ่งของ อ. กิตตินันท์ น้อยมณี อาจารย์ที่ปรึกษาปริญญานิพนธ์ที่ได้ให้คำแนะนำและข้อคิดเห็นต่าง ๆ ของการทำโครงการมาโดยตลอด และทุนการทำโครงการบางส่วน ได้รับจากทุนอุดหนุนทำโครงการของมหาวิทยาลัยเทคโนโลยีราชมงคลล้านนา จึงขอขอบพระคุณมหาวิทยาลัยที่ได้ให้ทุนอุดหนุนทำโครงการครั้งนี้มา ณ ที่นี้ด้วย

ขอขอบคุณบุคคลที่ช่วยในการสืบค้นข้อมูลแลกเปลี่ยนความรู้ ความคิด และให้กำลังใจในการศึกษาค้นคว้าตลอดมา

ท้ายนี้ผู้วิจัยใคร่ขอกราบขอบพระคุณบิดา มารดา ซึ่งสนับสนุนในด้านการเงินและให้กำลังใจแก่ผู้วิจัยเสมอมาจนสำเร็จการศึกษา

เอกสารอ้างอิง

- [1] คีตสังโยชน์ วงษ์ขุนเณร “2 เทคนิคพิชิตตลาด Forex”. znipertrade. เผยแพร่วันที่ 6 มิถุนายน 2016 . <http://www.znipertrade.com/beginner/technical-analysis/>. สืบค้นเมื่อวันอังคารที่ 3 เมษายน 2560.
- [2] ด้าน “Close System +”. Mudley Channel. เผยแพร่วันที่ 9 มิถุนายน 2016. <https://youtu.be/VqW8Wheud3g>. สืบค้นเมื่อวัน อังคารที่ 3 เมษายน 2560.
- [3] มนสิข จันทนปุม “ความผันผวน (แพะของตลาดหุ้น)”. mangmaoclub. เผยแพร่วันที่ 8 2012 . <http://mangmaoclub.com/volatility-and-investment-risk/>. สืบค้นเมื่อวันอังคารที่ 3 เมษายน 2560.
- [4] เอก “How to reduce Drawdowns”. cwayinvestment. เผยแพร่ วันที่ 12 พฤษภาคม 2017. <https://www.youtube.com/watch?v=oONV8o9BMpw>. สืบค้นเมื่อวัน อังคารที่ 3 เมษายน 2560.
- [5] เอก “Trading system evaluation”. cwayinvestment. เผยแพร่ วันที่ 24 มกราคม 2015. <https://www.youtube.com/watch?v=oONV8o9BMpw>. สืบค้นเมื่อวัน อังคารที่ 14 มีนาคม 2560.
- [6] Dadabada Pradeepkumar and Dr. Vadlamani Ravi, “FOREX Rate Prediction using Chaos and Quantile Regression Random Forest” University of Hyderabad and Institute for Development and Research in Banking Technology, 2016.
- [7] Edgar Buenrostro, Alberto Mateo and Adrian Ramirez, “Worcester Polytechnic Institute (WPI)”, 2012.
- [8] Joshua A. Lambert Fred E. Seymour and Pak H. Wu, “Investment, Trading, and Portfolio Management”, Worcester Polytechnic Institute (WPI), 2012. Kimberly Maciejczyk and Xianjing Hu, “Forex Analysis and Money Management”, Worcester Polytechnic Institute (WPI), 2012.
- [9] Michael Poon, Austin Alibozek and Michael Guarino Forex, “Trading System Development”, Worcester Polytechnic Institute (WPI), 2014.
- [10] Yeaww “TRADING ZONE”. shinestock168. เผยแพร่วันที่ 21 มีนาคม 2016. <http://www.shinestock168.com/คลังความรู้/trading-zone-ตอนที่-1-3-สรุปคร่าวๆ/> สืบค้นเมื่อวัน อังคารที่ 3 เมษายน 2560.

บทความวิจัย

การประชุมวิชาการเครือข่ายวิศวกรรมไฟฟ้ามหาวิทยาลัยเทคโนโลยีราชมงคล

Proceeding of The Conference of Electrical Engineering Network of Rajamangala University of Technology (EENET)



ประวัติผู้เขียนบทความ

ชื่อ-นามสกุล : กิตตินันท์ น้อยมณี

ประวัติทางการศึกษา :

พ.ศ. 2548 วิศวกรรมศาสตรบัณฑิต
สาขาวิชาวิศวกรรมคอมพิวเตอร์
มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
พ.ศ. 2552 วิศวกรรมศาสตรบัณฑิต
สาขาวิชาวิศวกรรมชีวการแพทย์
พระจอมเกล้าลาดกระบัง



ประวัติผู้เขียนบทความ

ชื่อ-นามสกุล : นาย เจษฎาพงศ์ รัตนา

ประวัติทางการศึกษา :

พ.ศ.2555 มัธยมศึกษาปีที่ 6 สาขาวิทย์-
คณิต โรงเรียนสาริต แพร่
พ.ศ.2560 วิศวกรรมศาสตรบัณฑิต
สาขาวิชาวิศวกรรมคอมพิวเตอร์
มหาวิทยาลัยเทคโนโลยีราชมงคล
ล้านนา เชียงใหม่



ประวัติผู้เขียนบทความ

ชื่อ-นามสกุล : นายพรชัย คำแดง

ประวัติทางการศึกษา :

พ.ศ.2555 มัธยมศึกษาปีที่ 6 สาขาวิทย์-
คณิต โรงเรียนยุพราชวิทยาลัย
เชียงใหม่
พ.ศ.2560 วิศวกรรมศาสตรบัณฑิต
สาขาวิชาวิศวกรรมคอมพิวเตอร์
มหาวิทยาลัยเทคโนโลยีราชมงคล
ล้านนา เชียงใหม่
ผลงานทางวิชาการ : ระบบแจ้งเตือนระยะทางที่
กำหนดผ่านสัญญาณเสียง