

บทที่ 1

บทนำ

1.1 ความเป็นมาของปัญหา

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

งานวิจัยที่ชี้ให้เห็นว่าสมองของนักลงทุนนั้นถูกออกแบบมาเพื่อมองหารูปแบบบางอย่างอยู่เสมอ ซึ่งทำให้ในหลายๆครั้งนักลงทุนทำการสรุปถึงรูปแบบบางอย่างขึ้นมาโดยที่มันไม่มีจริง หรือมีอยู่จริงแต่ไม่มีประโยชน์ในการทำกำไรดังนั้นเพื่อเป็นการเอาชนะความไม่สม่ำเสมอของอารมณ์และความเหนื่อยล้าทางเลือกหนึ่งที่คิดหาไม่พ้นการนำระบบที่ได้จากการวิจัยและวิเคราะห์ มาแล้วมาทำให้เป็นโปรแกรมช่วยในการซื้อขายโดยอัตโนมัติซึ่งตัวโปรแกรมจะถูกสร้างจาก โปรแกรม การซื้อขายอย่าง Metatrader 4 โดยการใช้การแก้ไขจากภาษา MQL4 มาทำการสร้าง Expert หรือ หุ่นยนต์สำหรับการเทรด forex โดยเฉพาะ

- ฮาร์ดแวร์ในส่วน of หน่วยประมวลผลทางนั้นจะใช้ คอมพิวเตอร์เป็นตัวประมวลผลและเก็บข้อมูลรวมถึงการติดตั้งโปรแกรมสำหรับการซื้อขาย
- ซอฟแวร์ในการทำงานนักลงทุนใช้โปรแกรม Metatrader 4.

ระบบเทรดอัตโนมัติทั่วไปนั้นจะใช้แนวคิดแบบ Return base หรือ การเปิดการซื้อขายโดยการคำนึงถึง EGO เป็นหลักซะส่วนใหญ่ซึ่งผลที่ได้ก็คือ จะได้ระบบการเข้า order ที่ส่งผลเสียให้กับ account ของผู้ลงทุนและระบบไม่ยั่งยืนมี drawdown ที่มากพอจะทำให้ล้างพอร์ตได้ง่าย ดังนั้นในระบบของนักลงทุนพบว่ามีอีกวิธีอีกทางเลือกคือ การใช้แนวคิดแบบ Risk base ซึ่ง Risk base นั้นจะค่อนข้างครอบคลุมและปลอดภัยกว่าแบบ Return base เพราะ Risk base จะคำนึงด้านการ

บริหารเงินใน account ของผู้ใช้งานควบคู่กับการบริหารจัดการความเสี่ยงโดยใช้ ความเสี่ยงเป็นเงื่อนไขในการพิจารณาการควบคุมการเปิด order โดยภาพรวมซึ่งการวิเคราะห์แบบ Risk base นั้นจะรวมไปถึงการเลือกโซนที่ได้อยู่ระหว่างกลางระหว่างกรณีของราคาแท่งเทียนที่ปิดสูงสุดและปิดต่ำสุดของภาพรวมของ time frame เดือนนั้นเริ่ม ที่โซน 25 – 50 % ของกราฟเป็นโซนสำหรับการซื้อขายรวมถึงการใช้กลยุทธ์ตัวบ่งชี้ หรือ indicator ในการเพิ่มความน่าจะเป็นเพื่อให้ order ที่ถือนั้นไปถูกทางตามคาดซึ่งระบบของเราจะใช้แนวคิดของ KZM แบบกล่อง C หรือ Killer Zone Model แบบกล่อง C ซึ่งจะเป็น Close system โดยใช้ ตัวชี้วัด หรือ indicator รวมเข้าระบบที่บริหารดูแลตัวเองได้แบบยั่งยืนและปลอดภัย

1.2 วัตถุประสงค์ของโครงการ

1.2.1 เพื่อให้ระบบเทรดแบบการซื้อขายตามโซนประเภทกล่อง C สามารถนำมาทำเป็นระบบเทรดการซื้อขายตามโซนแบบอัตโนมัติ

1.2.2 เพื่อให้ระบบเทรดการซื้อขายตามโซนแบบอัตโนมัติสามารถเลือกพื้นที่ทางโซนเพื่อทำการซื้อในตลาด forex ตามสัญญาณการชี้วัดจากอินดิเคเตอร์ cci (Commodity Channel Index)

1.3 ขอบเขตของโครงการ

1.3.1 สร้างระบบเทรดอัตโนมัติทำงานตามแบบการดำเนินการตามขอบเขตที่กำหนดผ่านตัวชี้วัด CCI

1.3.1.1 โปรแกรมระบบเทรดอัตโนมัติการซื้อขายตามโซนสามารถเลือกใช้โซน 25 เปอร์เซนต์จนถึง 50 เปอร์เซนต์ของโซนสำหรับการซื้อขายได้อย่างถูกต้องตามกรอบเวลาทำการติดตั้งและทำการซื้อขายในโซนที่ระบุไว้

1.3.1.2 โปรแกรมระบบเทรดอัตโนมัติการซื้อขายตามโซนสามารถทำการใช้ตัวชี้วัด Commodity Channel Index ในการเป็นเงื่อนไขในการเข้าคำสั่งการซื้อขายในโซนที่ระบุไว้ได้อย่างถูกต้อง

1.3.1.3 โปรแกรมระบบเทรดอัตโนมัติการซื้อขายตามโซนสามารถทำการคำนวณการเปิดขนาดของ Lot ของคำสั่งการซื้อขายถัดไปได้เองเพื่อทำการปิดคำสั่งการซื้อขายทั้งหมดให้ไม่มีค่าของกำไรที่ติดลบ

1.3.1.4 โปรแกรมระบบเทรดอัตโนมัติการซื้อตามโซนได้รับค่าทดสอบการประเมินจากการทนการขาดทุนหรือเปอร์เซ็นต์ Drawdown ผ่านตัวโปรแกรม Metatrader 4 backtesting น้อยกว่า 50 เปอร์เซนต์

1.3.1.5 โปรแกรมระบบเทรดอัตโนมัติการซื้อตามโซนได้รับค่าทดสอบการประเมินจากการทนการขาดทุนหรือเปอร์เซ็นต์ Drawdown ผ่านการติดตามการทดสอบ forward test ผ่านเว็บไซต์ myfxbook.com น้อยกว่า 50 เปอร์เซนต์

1.3.2 สร้างโซนการปิดทำกำไรและโซนป้องกันความเสี่ยงตามแบบฉบับของระบบเทรดแบบ การดำเนินการตามขอบเขตที่กำหนดผ่านตัวชี้วัด CCI บนรูปแบบการบริหารจัดการเงินแบบอัตโนมัติ

1.3.2.1 โปรแกรมระบบเทรดอัตโนมัติการซื้อตามโซนสามารถปิดทำกำไรในโซนที่มีค่ามากกว่า 50 เปอร์เซนต์ของโซน สำหรับการซื้อขายทั้งหมดได้อย่างถูกต้อง

1.3.2.2 โปรแกรมระบบเทรดอัตโนมัติการซื้อตามโซนสามารถป้องกันความเสี่ยงในโซนที่มีค่าของทุนที่น้อยกว่า 50 เปอร์เซนต์ของทุนขั้นต่ำของระบบเทรดในโซนที่มีค่าน้อยกว่า 25 เปอร์เซนต์ของโซนสำหรับการซื้อขายทั้งหมดได้อย่างถูกต้อง

1.4 ขั้นตอนการดำเนินงาน

เริ่มแรกเราจะทำการเข้าศึกษาระบบเทรดการซื้อขายตามโซนและทำการระบุโซนสำหรับการซื้อขายในกรอบเวลาที่เรากำหนด

1.4.1 ศึกษาระบบการทำงานและขีดจำกัดของระบบการซื้อขายตามโซน และทำการค้นคว้าข้อมูลเกี่ยวกับจุดเริ่มต้นของระบบเทรดการซื้อขายตามโซนในอินเทอร์เน็ตและเนื้อหาจากอาจารย์ที่ปรึกษาหรือผู้เชี่ยวชาญเรื่องระบบนี้

1.4.2 ศึกษาและทำการวิเคราะห์และหาโซนที่เหมาะสมสำหรับการซื้อขายของระบบเทรด การซื้อขายตามโซนทำการระบุโซนที่ได้วิเคราะห์และทำการเขียนโปรแกรมในโซนที่กำหนดให้สามารถกำหนดขอบเขตการเปิดคำสั่งซื้อได้

1.4.3 ออกแบบเพิ่มตัวชี้วัดในโซนที่ได้รับไว้ และทำการเขียนโปรแกรมหลังจากศึกษาระบบโซนที่ได้วิเคราะห์และทำการทดลองเขียนโปรแกรมในโซนที่กำหนดแล้วจะทำการเพิ่มเงื่อนไขหรือเพิ่มตัวชี้วัด Commodity Channel Index (cci) ในโซนที่ระบุไว้

1.4.4 เพิ่มการใช้คำสั่ง Send Order ให้กับตัวโปรแกรมและทำการเขียนโปรแกรมหลังจากระบุโซนสำหรับการซื้อขายในแบบการซื้อขายตามโซนและเพิ่มเงื่อนไขด้วยตัวชี้วัด Commodity Channel Index (cci) หลังจากนั้นจะทำการเพิ่มคำสั่งการเปิดในโซนที่ระบุไว้ตามเงื่อนไขของตัวชี้วัด Commodity Channel Index (cci)

1.4.5 ออกแบบเพิ่มโซนสำหรับการปิดกำไรและทำการเขียนโปรแกรมเพราะหลังจากกำหนดโซนและเพิ่มอินดิเคเตอร์แล้วรวมไปถึงการเปิดคำสั่งซื้อ เราจะทำการกำหนดโซนการปิดกำไรและทำการเขียนโปรแกรมให้ตัวระบบปิดทำกำไรในโซนที่ระบุและทำการเขียนโปรแกรม

1.4.6 ศึกษาและวิเคราะห์การเพิ่มปริมาณของขนาดสัญญาณซื้อของของคำสั่งและทำการเขียนโปรแกรมเพราะหลังจากตัวระบบเทรดอัตโนมัติสามารถทำการเปิดคำสั่งซื้อตามเงื่อนไขและสามารถปิดได้ตามเงื่อนไขที่ระบุจะทำการวิเคราะห์หาจุดและจำนวนปริมาณขนาดสัญญาณซื้อที่เหมาะสมสำหรับคำสั่งซื้อที่สองและทำการเขียนโปรแกรม

1.4.7 เพิ่มระบบการหยุดการขาดทุนและทำการเขียนโปรแกรมหลังจากตัวระบบเทรดอัตโนมัติพร้อมทำการซื้อขายเราจะเพิ่มโซนสำหรับการปิดคำสั่งซื้อเพิ่มการลดและป้องกันความเสี่ยงและทำการเขียนโปรแกรม

1.4.8 ทำการทดสอบระบบโดยทดสอบผ่านโปรแกรม Metatrader 4 หลังจากระบบเทรดอัตโนมัติเสร็จพร้อมทำงาน ก็จะทดสอบเพื่อหาค่าร้อยละขาดทุนสะสม (Drawdown) ผ่านตัว Metatrader 4 backtesting เพื่อสรุปผล

1.4.9 สรุปผล หลังจากทำการสร้างระบบและเขียนเป็นระบบเทรดอัตโนมัติ และทำการทดสอบผ่านโปรแกรม Backtesting ของ Metatrader 4 เราจะทำการสรุปผลการทดลอง

1.5 ประโยชน์ที่ได้รับจากโครงการ

1.5.2 บุคคลธรรมดาหรือประชาชน สามารถนำโปรแกรมมาใช้เพื่อทำรายได้เสริม

1.5.3 โปรแกรมเหมาะสำหรับช่วยนักวิเคราะห์หรือนักวิจัยให้วิเคราะห์ตลาดตลาดได้แม่นยำเพิ่มขึ้น