

ปริญญานิพนธ์เรื่อง	การดำเนินการตามขอบเขตที่กำหนดผ่านตัวชี้วัด CCI บนรูปแบบการบริหารจัดการเงิน
ชื่อนักศึกษา	นายเจษฎาพงศ์ รัตนา นายพรชัย คำแดง
อาจารย์ที่ปรึกษา	อาจารย์กิตตินันท์ น้อยมณี
หลักสูตร	วิศวกรรมศาสตรบัณฑิต
สาขาวิชา	วิศวกรรมคอมพิวเตอร์
ปีการศึกษา	2560

บทคัดย่อ

โครงการนี้ได้ทำการศึกษาปัญหาของการใช้ระบบเทรดอัตโนมัติทั่วไปนั้นจะใช้แนวคิดแบบไม่คำนึงถึงความเสี่ยง (Return base) หรือ การเปิดการซื้อขายโดยไม่คำนึงถึงหลักการบริหารทุน เทรดตามอารมณ์เป็นหลักซึ่งส่วนใหญ่ซึ่งผลที่ได้ก็คือ จะได้ระบบการเข้าคำสั่งซื้อที่ส่งผลเสียให้กับบัญชีของผู้ลงทุนและระบบไม่ยั่งยืนมีการขาดทุนสะสมที่มากพอจะทำให้หมดเงินลงทุนได้ง่าย ดังนั้นในระบบของเรา เรา พบว่ายังมีอีกวิธีอีกทางเลือกคือ การใช้แนวคิดแบบยึดความเสี่ยงเป็นหลัก (Risk base) ซึ่ง Risk base นั้นจะค่อนข้างครอบคลุมและปลอดภัยกว่าแบบ Return base เพราะ Risk base จะคำนึงด้านการบริหารเงินในบัญชีของผู้ใช้งานควบคู่กับการบริหารจัดการความเสี่ยงโดยใช้ความเสี่ยงเป็นเงื่อนไขในการพิจารณาการควบคุมการเปิดคำสั่งซื้อผ่านโปรแกรม Metatrader 4

ผลการทดสอบโปรแกรมเทรด Killer zone model นั้นโดยภาพรวม คือการนำแนวคิดแบบ Risk base มาใช้กับระบบ รวมไปถึงการเลือกระยะของราคาขั้นต่ำและอยู่ระหว่างกลางกรณีของราคาแท่งเทียนที่ปิดสูงสุดและปิดต่ำสุดของโซนรวมของกรอบเวลาชั่วโมงนั้นเริ่ม ที่โซนร้อยละ 25 ถึง 50 ของกราฟเป็นโซนสำหรับการซื้อขายรวมถึงการใช้กลยุทธ์ตัวบ่งชี้ หรือ indicator ในการเพิ่มความน่าจะเป็นเพื่อให้คำสั่งซื้อที่ถือนั้นไปถูกทางตามคาดซึ่งการดำเนินการตามขอบเขตที่กำหนดผ่านตัวชี้วัด CCI บนรูปแบบการบริหารจัดการเงิน จะใช้แนวคิด KZM แบบ C หรือ Killer Zone Model แบบ C โดยใช้ตัวชี้วัด หรือ indicator รวมเข้าระบบที่บริหารดูแลตัวเองได้แบบยั่งยืนและปลอดภัยซึ่งในการทดสอบระบบนั้นผลที่ได้จากการซื้อขายจริงให้ค่าการขาดทุนสะสมสูงสุดที่ร้อยละ 10.85 และจากการทดสอบการซื้อขายย้อนหลังให้ค่าการขาดทุนสะสมสูงสุดที่ร้อยละ 21.92

คำสำคัญ : โปรแกรมเทรดอัตโนมัติสำหรับฟอเร็กซ์, ระบบเทรดคลุมโซน, การจัดการความเสี่ยง