บทที่ 3   
วิธีการออกแบบ

ในปัจจุบันความเจริญก้าวหน้าของอินเทอร์เน็ต (Internet) ได้ส่งผลกระทบต่อการดำรงชีวิตประจำวันของคนเราอย่างมาก เป็นผลทำให้คนเข้าถึงการลงทุนได้มากขึ้น เห็นได้จากการค้นหาคำว่า “ForEx” (ตลาดแลกเปลี่ยนเงินตราสากล)และ “Stock Market” (ตลาดหุ้น)ในกูเกิลเทรนด์(Google Trend) ตั้งแต่ปี 2014 - 2018 จะเห็นว่ามีการค้นหาคำว่า “ForEx” ที่มากขึ้นทุกปีจนใกล้เคียงกับคำว่า “Stock Market” ทำให้เห็นว่ามีคนเข้ามาลงทุนกันมากขึ้น ซึ่งสามารถหาความรู้ทั่วไปได้จากทางอินเทอร์เน็ต หรือ หนังสือตามร้านหนังสือทั่วไป แต่ปัญหาของนักลงทุนส่วนใหญ่โดยเฉพาะมือใหม่คือ ไม่รู้จะเริ่มทำการซื้อขายอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราระหว่างประเทศ (ForEx : Foreign Exchange) อย่างไร จะใช้ตัวช่วยอะไรในการตัดสินใจในการส่งคำสั่งซื้อขาย (Trading Order) เมื่อทำการซื้อขายแล้วเงินติดลบหรือขาดทุนไม่รู้จะแก้อย่างไร และเมื่อเงินเป็นบวกหรือได้กำไรก็ไม่รู้จะออกตรงไหน หรือว่าไม่มีเงื่อนไข (Logic) ในการทำการซื้อขาย รวมไปถึงอารมณ์ของนักลงทุนในขณะนั้น ทำให้นักลงทุนมือใหม่ไม่สามารถควบคุมอารมณ์ตัวเองได้ และไม่สามารถทำตามแผนที่วางไว้ได้ รวมถึงการไม่มีการบริหารเงิน(Money Management) ที่มีอย่างจำกัดได้ จึงทำให้นักลงทุนมือใหม่เหล่านี้ตกเป็นเหยื่อของตลาดซื้อขายอัตราแลกเปลี่ยนระหว่างประเทศ

จากปัญหาดังกล่าว จึงเกิดไอเดียการพัฒนาการเทรดอย่างนึงที่มีการประกันความเสี่ยงโดยทำการเทรดเป็น “คู่” เวลาเปิด order ก็จะมีการเปิดสถานะ long และ short พร้อมๆกัน บนคู่หุ้นที่ต้องการ” โดยใช้หลักการ Pair trading ถือเป็นเทคนิคการ hedging อย่างหนึ่งที่ได้รับความนิยมกันอย่างแพร่หลายในกลุ่ม hedge funds ซึ่ง Pair trading ทำงานภายใต้พื้นฐานการคำนวณทางคณิตศาสตร์ ในหาคู่ของหุ้นที่จะมาเทรดร่วมกันจะต้องผ่านการคำนวณทางคณิตศาสตร์ ถึงความเหมาะสม และ เป็นไปได้ในการทำกำไรในอนาคตของคู่หุ้นที่เลือกมา โดยอาศัยค่า Cointegration เข้ามาช่วยเพื่อหาค่าเงินที่มี “Economic link” ต่อกัน โดยที่ ค่าเงิน 2 ตัวจะ Cointegrated กันก็ต่อเมื่อความแตกต่างของข้อมูล 2 ชุด มีลักษณะเป็น “Mean Reverting” ก็คือ ค่าวิ่งไปมาอยู่รอบๆ ค่า Mean ของตัวเอง

3.1 แผนผังสาเหตุและผล (Cause and Effect Diagram)

จากการศึกษาพบว่าการเทรดฟอเร็กซ์โดยใช้โปรแกรมช่วยเทรดส่วนใหญ่มีปัญหาในการดาเนินงาน ดังแสดงในรูปที่ 3.1

สาเหตุและปัญหาของการสร้างระบบเทรดหลายสกุลเงิน

จากรูปที่ 3.1 แผนผังสาเหตุและผลแสดงปัญหาเพื่อสร้างระบบเทรดหลายสกุลเงิน นั่นได้แสดงให้เห็นว่ามีปัญหาในเรื่องของการสร้างระบบเทรดหลายสกุลเงิน คือ เรื่องระบบจัดการด้านเงินทุน , เรื่องระบบแจ้งเตือน , เรื่องข่าวสารของค่าเงินที่กำลังเทรดอยู่ และ เรื่องการทดสอบคุณภาพของระบบเทรด



รูปที่ 3.1 แผนผังสาเหตุและผลแสดงปัญหาของการสร้างระบบเทรดหลายสกุลเงิน

วิธีการแก้ไขปัญหาของการสร้างระบบเทรดหลายสกุลเงิน

ปัญหาไม่มีระบบจัดการเงินทุน

การบริหารจัดการเงินทุนของคุณสำหรับการเทรด ช่วยให้เราบริหารเงินหรือพอร์ตของเราได้อย่างมีระบบ ทำไมเราถึงต้องมีการบริหารเงินทุนของเราเพราะ

1.) ไม่มีใครสามารถรู้ผลการเทรดล่วงหน้า ว่าผลจะออกมาในรูปกำไรหรือขาดทุน ดังนั้นการวางแผนล่วงหน้าเมื่อเกิดเหตุการณ์ที่คาดฝันจึงเป็นเรื่องสำคัญมาก

2.) เงินทุนมีจำกัด มันจะมีโอกาสในการเทรดเข้ามาอย่างต่อเนื่องตลอดเวลา อาจทำให้ไม่สามารถเทรดได้ทุกโอกาสที่เข้ามา อย่างที่แย่สุดคือเงินลงทุนของคุณอาจเป็น 0 ได้ภายในไม่กี่นาทีหากขาด MM

3.) แม้ในการเทรดครั้งนั้นของคุณจะขาดทุน แต่พอร์ตลงทุนจะไม่เสียหายหนัก

4.) หากเราขาดทุนในการเทรดนั้น โอกาสที่จะทำให้ทุนนั้นกลับมาเท่าเดิมนั้นยากกว่า

แต่อย่างไรก็ตามการวางแผน Money Management ที่ดีควรคำนึงถึงความเสี่ยงเป็นอันดับแรก จะเห็นได้ว่านักลงทุนจะต้องพบกับข้อจำกัดและความไม่แน่นอนต่างๆ ที่เกิดขึ้นในอนาคต ทำให้แนวทางในการบริหารเงินลงทุนถูกกำหนดขึ้นมาเพื่อวัตถุประสงค์ดังต่อไปนี้

1.)เพื่อจำกัดความเสี่ยงในการลงทุนแต่ละครั้ง ลดผลเสียหายจากการขาดทุนต่อพอร์ตของคุณ

2.)เพื่อกระจายความเสี่ยงในการเทรด

3.)เพื่อกระจายโอกาสในการเทรด ทำให้สามารถลงทุนได้หลายตัวในเวลาเดียวกัน

ปัญหาไม่มีระบบแจ้งเตือน

Line Notify คือ บริการที่ทาง Line ได้เตรียมไว้ให้ในรูปแบบของ API ให้กับเหล่านักพัฒนานั้นสามารถนำไปใช้ต่อยอด พัฒนาโปรเจค ที่มีความต้องการส่งข้อความในการแจ้งเตือนเข้าไปยัง กลุ่ม หรือบัญชีส่วนตัวของเราได้

ฟังช์นตรวจสอบข่าว

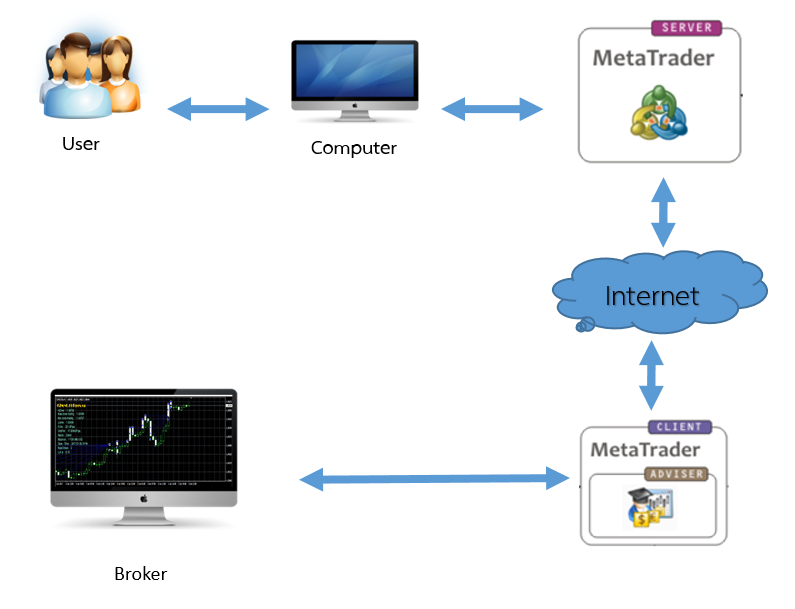
เปลียนไปให้ระบบ TakeProfit และ StopLoss เพื่อให้สามารถทำกำไรในช่วงที่มีข่าวได้

ปัญหาการทดสอบระบบ

เปลียนไปใช้ MetaQuotes Languagues เวอร์ชั่น 5 เพราะสามารถ ทำการทดสอบย้อนหลัง พร้อมกันหลายคู่เงินได้

3.2 การออกแบบโปรแกรม

3.2.1 บล็อกไดอะแกรม ของวิธีการใช้งานระบบโปรแกรมระบบเทรดอัตโนมัติ



รูปที่ 3.3 การออกแบบการใช้งานโปรแกรมระบบเทรดอัตโนมัติ

จากรูปที่ 3.17 เป็นบล็อกไดอะแกรม (Block Diagram) แสดงภาพวิธีการใช่งานรวมของโปรแกรมระบบเทรดอัตโนมัติโดยผู้ใช้งานใช้คอมพิวเตอร์ติดตั้งโปรแกรม MetaTrader และใช้ Expert Advisors (EAs) ที่เราจัดทำขึ้น ผ่าน โบรกเกอร์ หรือ ตัวกลางเชื่อมต่อการซื้อขายระหว่างนักเทรดฟอเร็กซ์รายย่อย กับตลาดฟอเร็กซ์

**3.2.2 ส่วนของระบบการป้อนข้อมูลและตัวแปร**

ระบบป้อนข้อมูลจะใช้ในการเก็บข้อมูลที่ได้จากการกำหนดข้อมูลตัวแปรส่งให้ตัวโปรแกรมทำการปะมวลผลตามตัวแปรที่ได้ระบุค่า ในลักษณะดังตารางที่ 3.1

ตารางที่ 3.1ข้อมูลตัวแปร

|  |  |
| --- | --- |
| **ตัวแปร** | **รายละเอียด** |
| Symbol Setting | ================================= |
| Symbol 1 |  |
| Lot 1 |  |
| Symbol 2 |  |
| Lot 2 |  |
| Symbol 3 |  |
| Lot 3 |  |
| TP SL Setting | ================================= |
| Use TPSL |  |
| TakeProfit |  |
| StopLoss |  |
| Trailing Stop Setting | ================================= |
| Use Trailing Stop |  |
| Trailing Start |  |
| Trailing Step |  |
| Tradeing Setting | ================================= |
| Magic Number |  |
| Slippage |  |
| Profit Target Setting | ================================= |
| Profit Target |  |
| CutLoss TargetSetting | ================================= |
| CutLoss Target |  |
| Indicator Setting | ================================= |
| Period MA |  |
| Time Frame MA |  |
| Shift MA |  |
| Method MA |  |
| Price MA |  |
| Line Notify Setting | ================================= |
| Use LineNotify |  |
| Please Add Link |  |
| Line Token |  |
| News Setting | ================================= |
| Use NewsAvoid |  |
| Use AutoStopMartingaleBreakNews |  |
| Stop TradeBeforeNews\_Min |  |
| Continue TradeAfterNews\_Min |  |
| Setting Forex Factory Calender Indicator | ================================= |
| IncludeHigh |  |
| IncludeMedium |  |
| IncludeLow |  |
| OffsetHours |  |
| AllowTimeUpdateNewsMinutes |  |
| ReportAllForAUD |  |
| ReportAllForCAD |  |
| ReportAllForCHF |  |
| ReportAllForEUR |  |
| ReportAllForGBP |  |
| ReportAllForJYP |  |
| ReportAllForNZD |  |
| ReportAllForUSD |  |
| ReportAllForCNY |  |

**3.2.3 Flowchart ฟังก์ชั่นหลักของโปรแกรมระบบซื้อขายอัตโนมัติหลายสกุลเงิน**

3.2.3.1 Flowchart การทำงานของผู้ใช้งาน

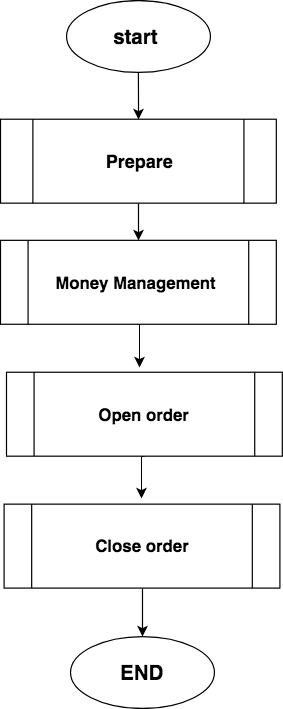
จากรูปที่ 3.4 ผังงานแสดงขั้นตอนแรกของการทำงานของโปรแกรมระบบซื้อขายอัตโนมัติหลายสกุลเงิน โดยเริ่มจากผู้ใช้ Login เข้า Meta Trader เลือกคู่เงินที่ต้องการเทรดแล้วตั้งค่า EA จากนั้นรัน EA



รูปที่ 3.4 Flowchart การทำงานของผู้ใช้งาน

3.2.3.2 Flowchart การทำงานของระบบ

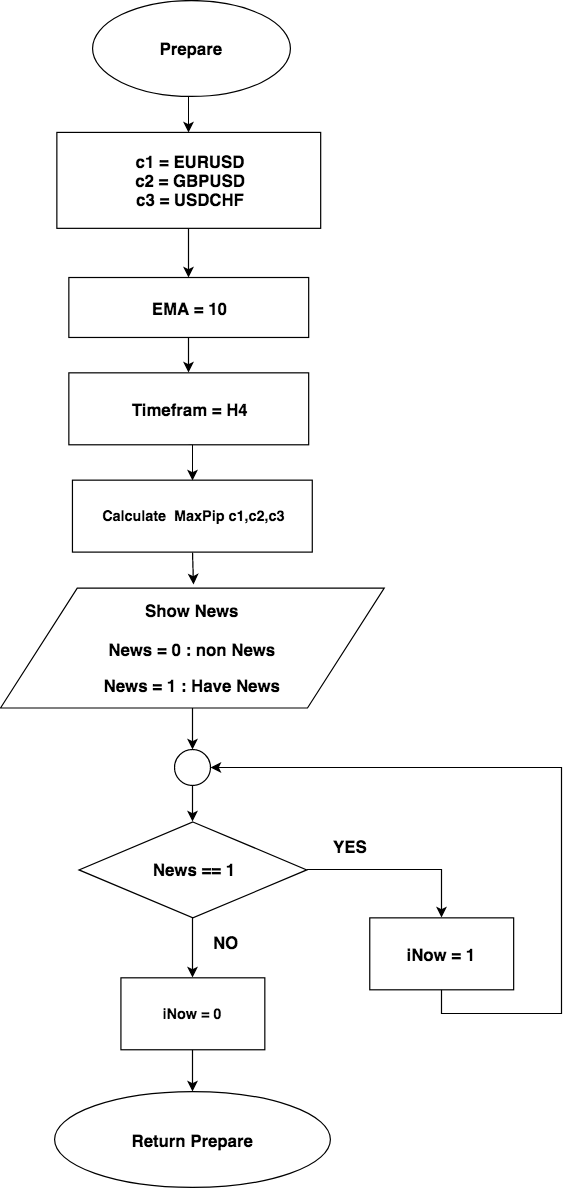
จากรูปที่ 3.5 ผังงานแสดงขั้นตอนแรกของการทำงานของระบบ โดยเริ่มจากฟังก์ชั่น Prepare > Money Management > Open Order > Close order



รูปที่ 3.5 Flowchart การทำงานของระบบ

3.2.3.3 Flowchart การทำงานของฟังก์ชั่น Prepare

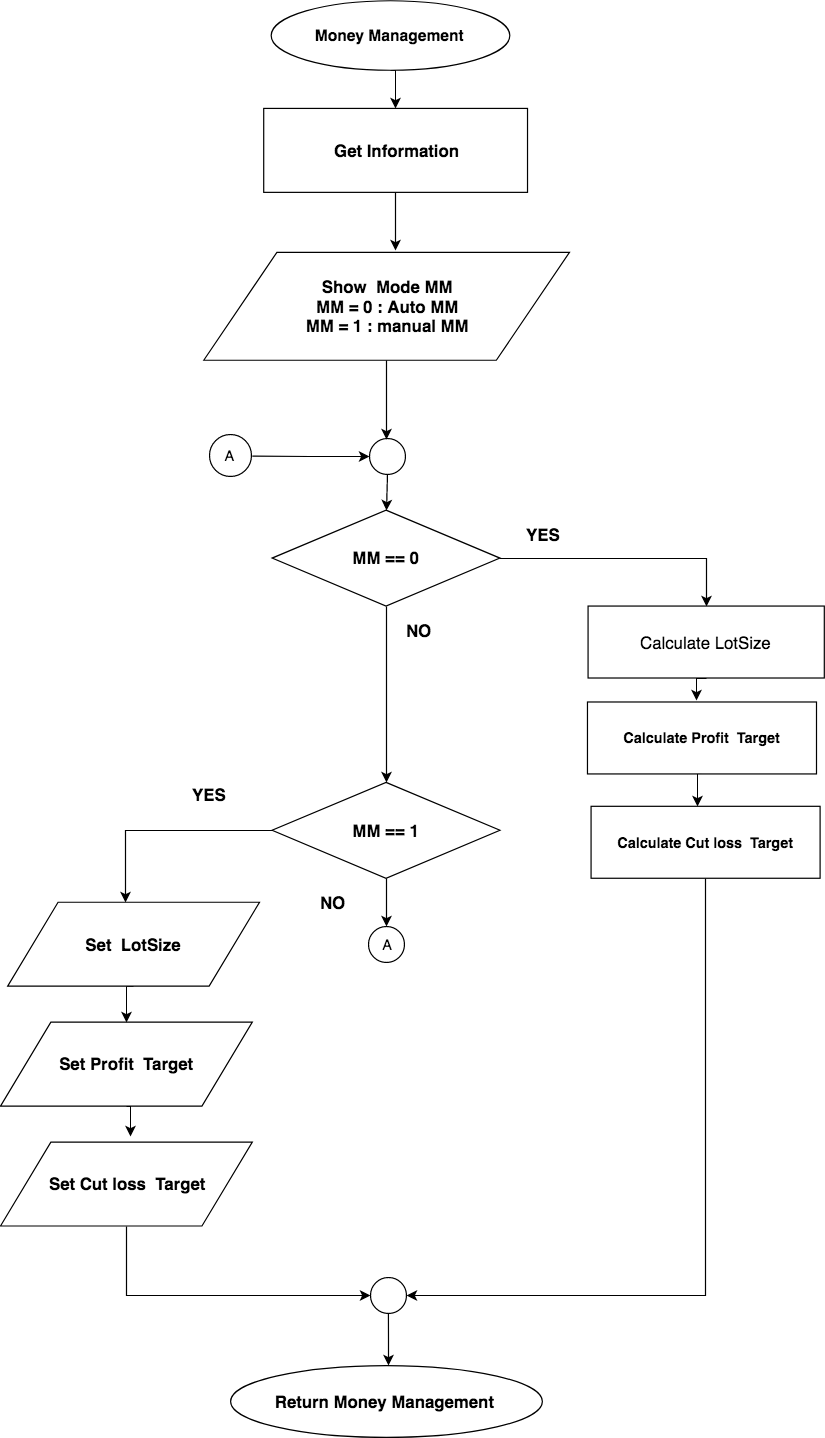
จากรูปที่ 3.6 ผังงานแสดงขั้นตอนการทำงานของฟังก์ชั่น Prepare



รูปที่ 3.6 Flowchart การทำงานของฟังก์ชั่น Prepare

3.2.3.4 Flowchart การทำงานของฟังก์ชั่น Money Management

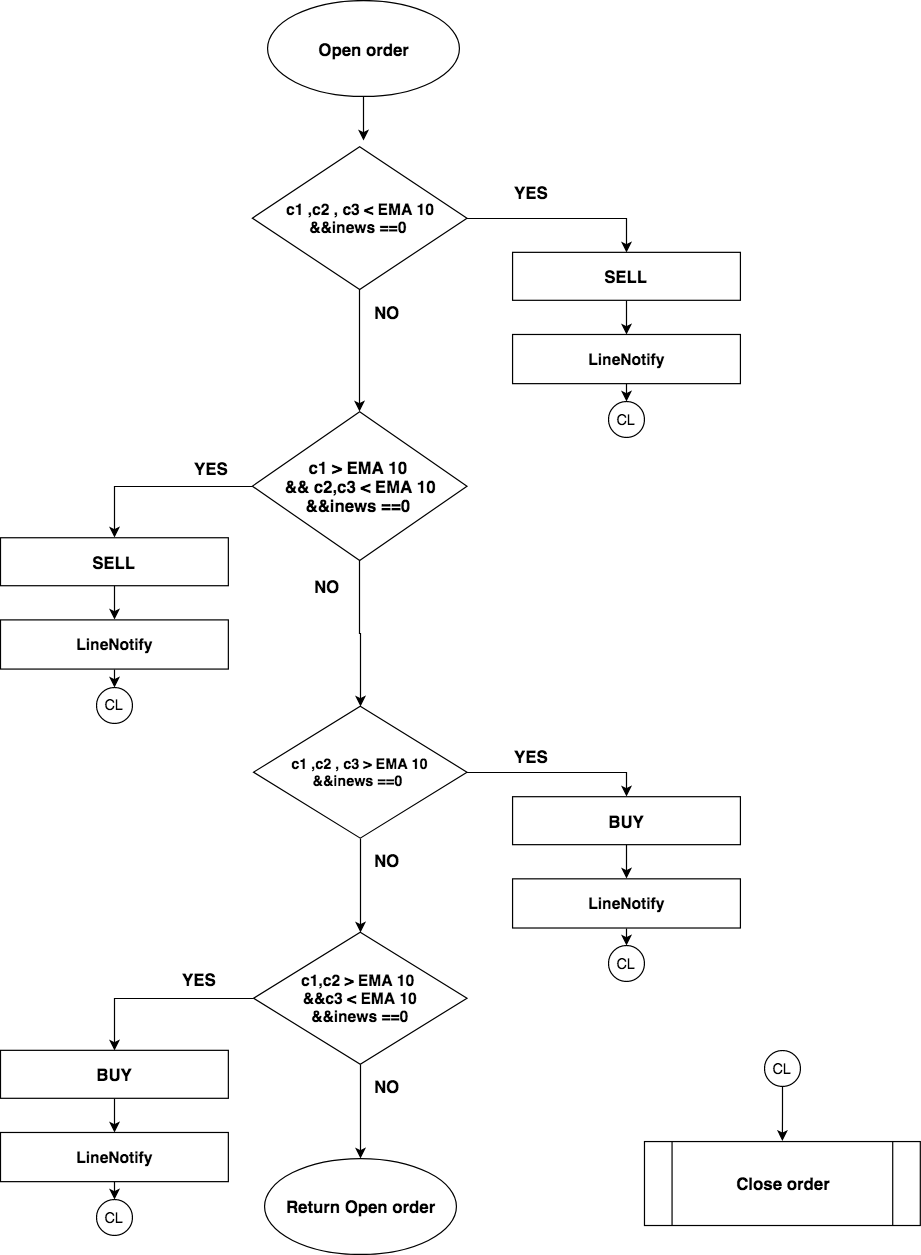
จากรูปที่ 3.7 ผังงานแสดงขั้นตอนการทำงานของฟังก์ชั่น Money Management



รูปที่ 3.7 Flowchart การทำงานของฟังก์ชั่น Money Management

3.2.3.5 Flowchart การทำงานของฟังก์ชั่น Open Order

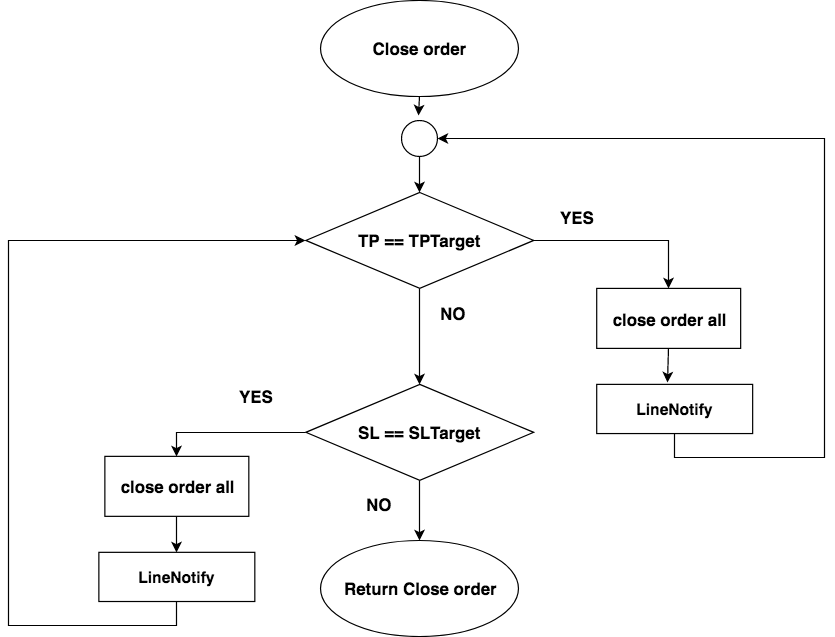
จากรูปที่ 3.8 ผังงานแสดงขั้นตอนการทำงานของฟังก์ชั่น Open Order



รูปที่ 3.8 Flowchart การทำงานของฟังก์ชั่น Open Order

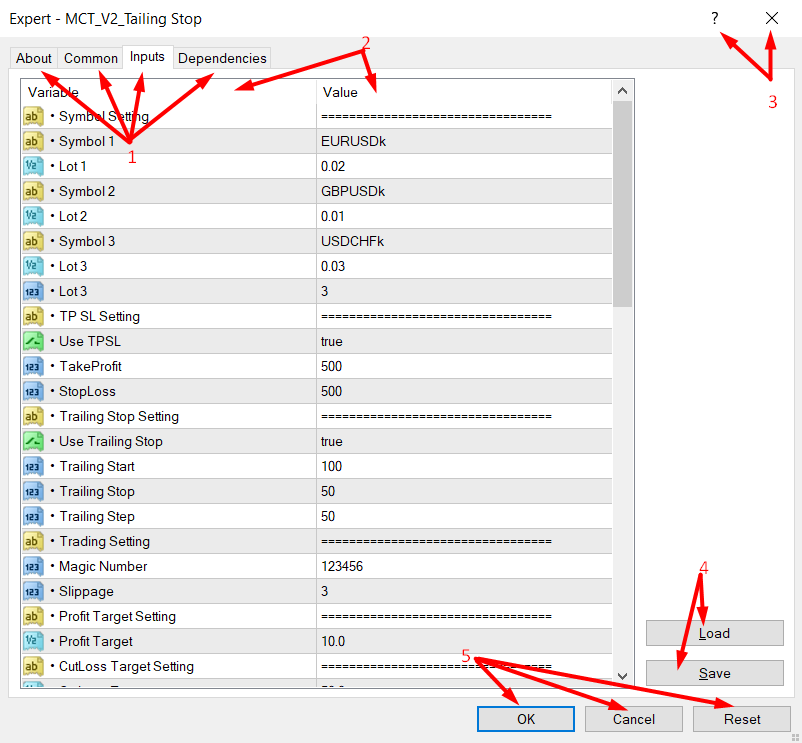
3.2.3.6 Flowchart การทำงานของฟังก์ชั่น Close Order

จากรูปที่ 3.9 ผังงานแสดงขั้นตอนการทำงานของฟังก์ชั่น Close Order



รูปที่ 3.9 Flowchart การทำงานของฟังก์ชั่น Close Order

3.3 ส่วนติดต่อผู้ใช้



รูปที่ 3.10หน้าต่างหลักของโปรแกรม

**3.3.1 คำอธิบายส่วนติดต่อผู้ใช้จากรูป 3.10**

*หมายเลข* 1:

- About: ส่วนของรายละเอียดชื่อหรือลิงค์ที่มา

- Common: การปรับการตั้งค่าร่วมกันกับโปรแกรม MetaTrader 4

- Input: หมวดของการให้ป้อนข้อมูลการตั้งค่าของโปรแกรมเทรด การซื้อขายตามโซน

*หมายเลข* 2:

- Variable: ตัวแปรของโปรแกรมเทรด การซื้อขายตามโซน

- Value: ค่าที่ป้อนเข้าไปในโปรแกรมเทรด การซื้อขายตามโซน

*หมายเลข* 3:

- ? : คือส่วนของการเรียกคู่มือผู้ใช้โปรแกรม MetaTrader 4

- Exit: คือส่วนของการออกจากโปรแกรมเทรด การซื้อขายตามโซน

*หมายเลข* 4:

- Load: คือส่วนของโหลดไฟล์การตั้งค่าโปรแกรมเทรด การซื้อขายตามโซน

- Save: คือส่วนของการบันทึกไฟล์การตั้งค่าโปรแกรมเทรด การซื้อขายตามโซน

*หมายเลข* 5:

- OK: คือส่วนของการตกลงเพื่อติดตั้งโปรแกรมเทรด การซื้อขายตามโซน

- Cancel: คือส่วนของยกเลิกการติดตั้งโปรแกรมเทรด การซื้อขายตามโซน

- Reset: คือส่วนของการคืนค่าการตั้งค่าโปรแกรมเทรด การซื้อขายตามโซน