

รายละเอียดการแข่งขัน

รูปแบบและกติกาการแข่งขัน

1. แข่งขันภายในของแต่ละมหาวิทยาลัยที่เข้าร่วมโครงการ
 2. หลักทรัพย์ที่ใช้ซื้อขาย คือ หุ้นในกลุ่มดัชนี SET50 เท่านั้น [คลิกเพื่อดูรายชื่อหลักทรัพย์](#)
 3. แข่งขันด้วยวิธีการ Back Test โดยทดสอบผ่านระบบจำลองที่ทางบริษัทจัดเตรียมไว้
 4. ผู้เข้าแข่งขันจะต้องนำส่งไฟล์กลยุทธ์(.py) ให้บริษัทเพื่อทดสอบ
 5. ผู้เข้าแข่งขันสามารถปรับกลยุทธ์ได้ทุกวันแต่ต้องนำส่งไฟล์ภายใน 9.00 น. ของทุกวันทำการ หากไม่มีการนำส่งไฟล์ใหม่ บริษัทจะใช้ไฟล์เดิมเพื่อทดสอบกลยุทธ์
 6. การจัดอันดับที่วัดจากผลการ Back Test สะสมที่ดีที่สุด ตลอดระยะเวลาการแข่งขัน ดูรายละเอียดเพิ่มเติมหน้าเว็บไซต์ แข่งขัน เมนู อันดับการแข่งขัน
 7. ผู้เข้าแข่งขันจะต้องจัดทำคลิปวิดีโอผลสรุปหลังจบการแข่งขัน ดูรายละเอียดเพิ่มเติม หน้าเว็บไซต์ เมนู Q&A
 8. ผู้เข้าแข่งขันไม่สามารถทำการ Short Sell ได้
 9. แข่งขันผ่านพอร์ตจำลอง ใช้โปรแกรม Python เท่านั้น ในการสร้าง Algo-Trading เพื่อใช้ในพอร์ตจำลอง
 - 9.1 ผู้เข้าแข่งขันต้องสร้างกลยุทธ์การซื้อขายเริ่มต้นด้วยจำนวนเงิน 10,000,000 บาท
 - 9.2 รายการซื้อ-ขาย ไม่มีการคำนวณค่าธรรมเนียม (Commission) และภาษีจากการซื้อ-ขายหลักทรัพย์
 - 9.3 ผู้เข้าแข่งขันต้องแสดงรายการการซื้อขายหลักทรัพย์
 - 9.4 ในแต่ละรายการซื้อ-ขายหลักทรัพย์ต้องแสดงยอดเงินคงเหลือและจำนวนหุ้นที่อยู่ในพอร์ต
 - 9.5 ผู้เข้าแข่งขันต้องแสดงยอดเงินคงเหลือและรายการหลักทรัพย์คงเหลือของพอร์ต ณ สิ้นวัน
 - 9.6 ในวันที่ +1 ผู้เข้าแข่งขันต้องยกยอดเงินสดและจำนวนหุ้นที่อยู่ในพอร์ตมาเป็นยอดต้นวัน
 10. ผู้เข้าแข่งขันจะต้องแสดงผลลัพธ์ตามรูปแบบที่บริษัทกำหนดดังนี้
 - Print ค่าตามที่บริษัทกำหนด และ export ไฟล์ output.csv_file เป็น 3 files โดยจัดเก็บไฟล์ตามชื่อดังนี้
 - Name_portfolio_dayX_YYYYMMDD
 - Name_Statement_ dayX_YYYYMMDD
 - Name_Summary_dayX_YYYYMMDD
- ***Note: X = trading day
- ***Note: location path สำหรับ export ไฟล์ output.csv_file ที่ desktop เท่านั้น เพื่อความง่ายสำหรับจัดเก็บไฟล์

สร้าง Folder สำหรับจัดเก็บไฟล์ชื่อ competition_api ไว้ที่ desktop

Location path: competition_api/Day1/portfolio/ Name_Portfolio_dayX_YYYYMMDD.csv

Location path: competition_api/Day1/summary/Name_Summary_dayX_YYYYMMDD.csv

Location path: competition_api/Day1/statement/ Name_Statement_ dayX_YYYYMMDD.csv

*** Noted: ทศนิยม 4 ตำแหน่ง

*** Noted: ซื้อ 100หุ้น

ซื้อ-ขาย ต้องเป็นจำนวนเต็ม 100, 200 ตาม board lot

1.Portfolio (Table)

จำนวนหุ้นที่อยู่ในพอร์ต

- Table Name
- File Name
- Stock Name
- Start Vol
- Actual Vol
- Avg Cost
- Market price
- Amount Cost
- Market Value
- Unrealized P/L
- %Unrealized P/L
- Realized P/L

2.Statement (Table)

สรุปรายการการซื้อ-ขายหลักทรัพย์

- Table Name
- File Name
- Stock Name
- Date
- Time
- Side
- Volume
- Price
- Amount cost
- End_line_available

3.Summary (Table)

สรุปค่าสถิติ และ Performance ของ Portfolio

- Table Name
- File Name
- Portfolio value
- End Line available
- Start Line available
- Number of wins
- Number of matched trades
- Number of transactions
- Sum of Unrealized P/L
- Sum of %Unrealized P/L
- Sum of Realized P/L
- Maximum value
- Minimum value
- Win rate
- Calmar Ratio
- Relative Drawdown
- Maximum Drawdown
- %Return

ตัวอย่างการแสดงผล

```
Portfolio_file 1001.py DELTA 0 1000 103.00 102.5 103000.0 102500.0 -500.0 -0.4854 0.0
Portfolio_file 1001.py PTT 0 1000 34.25 34.0 34250.0 34000.0 -250.0 -0.7299 0.0
Portfolio_file 1001.py ADVANC 0 1000 243.00 242.0 243000.0 242000.0 -1000.0 -0.4115 0.0
Portfolio_file 1001.py BDMS 0 1000 27.25 27.0 27250.0 27000.0 -250.0 -0.9174 0.0
Portfolio_file 1001.py MTC 0 1000 41.25 41.0 41250.0 41000.0 -250.0 -0.6061 0.0
Statement_file 1001.py DELTA 24/06/2024 10:48 B 1000 103.00 103000.0
Statement_file 1001.py PTT 24/06/2024 14:38 B 1000 34.25 34250.0
Statement_file 1001.py ADVANC 24/06/2024 11:44 B 1000 243.00 243000.0
Statement_file 1001.py BDMS 24/06/2024 9:59 B 1000 27.25 27250.0
Statement_file 1001.py MTC 24/06/2024 10:06 B 1000 41.25 41250.0
sum_file 1001.py 1 9997750.0 9551250.0 10000000.0 0 0 5 -2250.0 -3.1503 0.0 10000000.0 9997750.0 0.0 100.0 -0.0 -0.000225 -0.0225
```

- Table Name: ชื่อตาราง (Portfolio, Statement, Summary)
- File Name: ชื่อไฟล์ (ชื่อผู้เข้าแข่งขัน)
- Stock name: ชื่อหลักทรัพย์
- Date: วันที่ซื้อ-ขาย หลักทรัพย์ตาม log file
- Time: วันเวลาซื้อ-ขาย หลักทรัพย์ตาม log file
- Side: Buy/ Sell
- Volume: จำนวนหลักทรัพย์ที่ซื้อ-ขายในวัน
- Price: ราคาซื้อ-ขาย หลักทรัพย์
- Amount Cost: จำนวนเงินที่ซื้อ-ขาย หลักทรัพย์
- Net Amount: จำนวนเงินสุทธิที่ซื้อ-ขาย หลักทรัพย์ (sell-buy)
- Start Vol: จำนวนหลักทรัพย์ต้นวัน
- Actual Vol: จำนวนหลักทรัพย์ที่คงเหลืออยู่ในพอร์ต
- Avg Cost: ต้นทุนเฉลี่ย
- Market Price: ราคาตลาด
- Market Value: มูลค่าตลาด
- Unrealized P/L: กำไร/ขาดทุนจากการถือหลักทรัพย์
- %Unrealized P/L: กำไร/ขาดทุนจากการถือหลักทรัพย์ (%)
- Realized P/L: กำไร/ขาดทุนจากการขายหลักทรัพย์
- NAV: มูลค่าพอร์ต ณ ปัจจุบัน:
- Start Line available: จำนวนเงินเริ่มต้นของวันใหม่
- End Line available: จำนวนเงินที่สามารถซื้อหลักทรัพย์ได้
- Number of wins: นับจำนวนครั้งที่เทรดกำไร

- Number of matched trades: นับจำนวนครั้งที่มีการจับคู่ซื้อ-ขาย
- Number of transactions: นับจำนวนครั้งที่มีการซื้อ-ขายหลักทรัพย์
- Sum of Unrealized P/L: ผลรวมกำไร/ขาดทุนจากการถือหลักทรัพย์
- Sum of %Unrealized P/L: ผลรวมกำไร/ขาดทุนจากการถือหลักทรัพย์ (%)
- Sum of Realized P/L: ผลรวมกำไร/ขาดทุนจากการขายหลักทรัพย์
- Maximum value: จุดสูงสุดของมูลค่า (หรือ NAV) ที่เกิดขึ้นในช่วงเวลาที่วิเคราะห์
- Minimum value: จุดต่ำสุดของมูลค่า (หรือ NAV) ที่เกิดขึ้นหลังจากจุดสูงสุดนั้น
- %Win rate: นับจำนวนครั้งที่เทรดกำไรหารด้วยจำนวนการเทรดทั้งหมด *100
- Calmar Ratio: ใช้ในการวัดความเสี่ยงของการลงทุนโดยการเปรียบเทียบผลตอบแทนเฉลี่ยต่อความเสี่ยงที่เกิดจาก Drawdown
- %Relative Drawdown: จุดขาดทุนต่อเนื่องสูงสุด ณ จุดหนึ่งของ balance
- %Maximum Drawdown: จุดขาดทุนต่อเนื่องสูงสุด นับจากผลต่างระหว่างจุดสูงสุดและจุดต่ำสุด
- %Return: อัตราผลตอบแทน

เกณฑ์การตัดสิน

1. พิจารณาจากแนวคิดการลงทุน ให้นำนักพิจารณาภายใต้เกณฑ์ร้อยละ 10

ผู้เข้าแข่งขันจะต้องจัดทำคลิปวิดีโอผลสรุปความยาวไม่เกิน 5 นาที นำส่งบริษัทหลังจบการแข่งขัน โดยมีรายละเอียด ดังนี้

- แนวคิดกลยุทธ์
- ผลลัพธ์และข้อจำกัดที่เกิดขึ้นจริง
- สิ่งที่ได้เรียนรู้และข้อเสนอแนะ จากการร่วมแข่งขันในครั้งนี้

2. พิจารณาจากการจัดอันดับผลตอบแทนและค่าทางสถิติ โดยให้นำนักในการพิจารณาภายใต้เกณฑ์ร้อยละ 90

พิจารณาจากค่าสถิติดังนี้

- %Return
- %Maximum Drawdown
- %Relative Drawdown
- Calmar ratio
- %Win rate

คุณสมบัติทีมที่มีสิทธิ์รับรางวัล

1. ทีมที่มีสิทธิ์รับรางวัลจะต้องอยู่ใน 10 อันดับแรกของ %Return (Top 10 Ranking of %Return.)
2. ทีม 10 อันดับแรก ต้องผ่านเกณฑ์มาตรฐานที่บริษัทกำหนด ดังนี้
 - %Return > 5%
 - %Maximum Drawdown < 30%
 - Trades > 20 trades
 - %Win rate > 20%
 - Programming Errors <= 10 Times
3. ทีมที่มีสิทธิ์รับรางวัลจะต้องมีส่วนร่วมในการแข่งขันตั้งแต่ต้นจนจบระยะเวลาการแข่งขัน