ลดเวลาในการวิเคราะห์



## ระบบทำนายตลาดแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ

Foreign Exchange Market Prediction System
ปัณณวิชญ์ พันธ์วงศ์, อาจารย์ที่ปรึกษา: ศันสนีย์ เอื้อพันธ์วิริยะกุล
ภาควิชาวิศวกรรมคอมพิวเตอร์ คณะวิศวกรรมศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

## FOREX PREDICTION SYSTEM Objectives Introduction

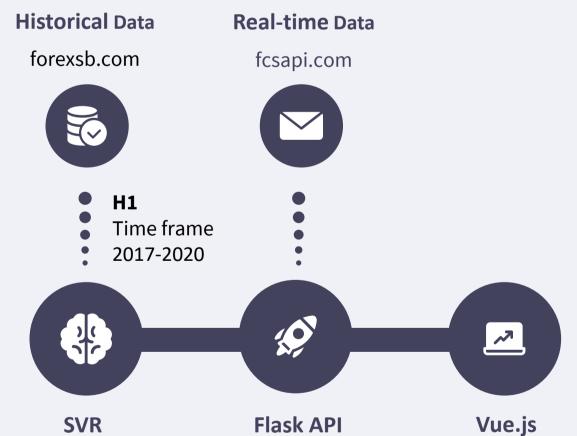
เป็นตัวช่วยในการตัดสินใจ

ตลาดฟอเร็กซ์(Forex Market) คือ ตลาดที่ทำการซื้อขายอัตรา แลกเปลี่ยนเงินตรา ด้วยเหตุผลที่ว่าตลาดฟอเร็กซ์มีความอ่อนไหว หรือผันผวนสูงผู้จัดทำได้สร้างระบบทำนายตลาดโดยใช้ซัพพอร์ต เวกเตอร์รีเกรสชัน(Support Vector Regression) มาประยุกต์ใช้ ทำนายแนวโน้มในอีก 24 ชม.ถัดไป เพื่อเพิ่มโอกาสให้ผู้ลงทุนได้ กำไรและเพิ่มความ มั่นใจในการลงทุนบนตลาดฟอเร็กซ์มากขึ้น

## **Results & Conclusions**

ลดโอกาสผิดพลาด

## **Methods**



Module 1 : Model

ซัพพอร์ตเวกเตอร์รี เกรชชั้นถูกเทรนโดย ใช้ 13 อินดิเคเตอร์ ซึ่งจะทำนายค่าเปิด และค่าปิดในอีก 24 ชม.ข้างหน้า โดยใช้ ข้อมูลในกรอบเวลา 1 ชั่วโมง ปี 2017-2020 ในการเทรน เป็นเอพีไอเชื่อมโยง
ในส่วนของโมเดล
และเว็บไซต์ โดยรับ
ข้อมูลแบบเรียลไทม์
และส่งข้อมูลไปยัง
โมเดลเพื่อทำนาย
และนำผลลัพธ์ที่ได้
ส่งไปยังเว็บไซต์

Module 2: API

เว็บไซต์จะแสดง
ผลลัพธ์ที่รับมาจาก
เอพีไอซึ่งประกอบ
ไปด้วย ค่าความถูก
ต้อง,และผลลัพธ์ใน
อีก 24 ชม. ถัดไป

Module 3: Web

เว็บไซต์จะประกอบไปด้วย 2 หน้าหลัก ได้แก่ หน้าภาพรวม(Overview) ที่แสดงถึง คำแนะนำว่าควรซื้อหรือขายของทุกๆคู่สกุลเงิน และหน้าแสดงรายละเอียดของแต่ละคู่ สกุลเงิน ที่แสดงค่าความถูกต้องของมาตราวัดต่างๆ และแนวโน้มของกราฟแท่งเทียนใน อีก 24 ชม. ถัดไป โดยผู้จัดทำได้ทำนาย 3 คู่สกุลเงินหลัก คือ EUR/USD, GBP/USD และ USD/JPY รวมทั้งหมด 4 หน้าเว็บไซต

ผลลัพธ์ที่ได้พบว่าค่าความถูกต้องของแต่ละมาตราวัดผลนั้นมีค่าที่ไม่สูงมาก เนื่องจาก ปัจจัยที่ส่งผลต่อการเคลื่อนไหวตลาดฟอเร็กซ์นั้นไม่ได้มีเพียงแค่สถิติย้อนหลังของตลาด ฟอเร็กซ์เป็นหลัก แต่ขึ้นเกี่ยวกับปัจจัยทางด้านเศรษฐกิจของโลก รวมถึงข่าวสารต่างๆที่ ส่งผลกระทบต่อการเงิน ดังนั้นเมื่อนำไปใช้จริงแล้วทำให้ไม่สามารถเชื่อถือได้มากนัก แต่ โดยรวมแล้ว คู่สกุลเงิน ....... มีความถูกต้องของแนวโน้มที่สูงที่สุดเมื่อเปรียบเทียบคู่สกุล เงินอื่นๆ \*บอกข้อมูลช่วงเวลาข้อมูลเทส 2021

