

ผลงานนายธีรวัฒน์ ชู

หัวข้อ	วันที่เริ่มต้น	วันที่สิ้นสุด	สถานะ
รายงานสิ่งที่ได้รับมอบหมาย	01 ก.พ. 67	02 ก.พ. 67	เสร็จสิ้น
ขั้นตอนที่ 1: ทำความเข้าใจและศึกษากลยุทธ์ 14 วันที่ 16 ม.ค. 67 (Business understanding)	16 ม.ค. 67	17 ม.ค. 67	เสร็จสิ้น
ขั้นตอนที่ 2: เขียน Flow chart เพื่อวางแผนเขียนโปรแกรม (Planning)	17 ม.ค. 67	01 ก.พ. 67	เสร็จสิ้น
ขั้นตอนที่ 3: เขียนโปรแกรมด้วยภาษาไพทอน (Programming)	17 ม.ค. 67	01 ก.พ. 67	เสร็จสิ้น
ขั้นตอนที่ 4: ผลลัพธ์จากการเขียนโปรแกรม (Results)	31 ม.ค. 67	01 ก.พ. 67	เสร็จสิ้น
ขั้นตอนที่ 5: สรุปผลลัพธ์ Backtesting หรือ การทดสอบย้อนหลัง (Conclusion)	31 ม.ค. 67	01 ก.พ. 67	เสร็จสิ้น
ขั้นตอนที่ 6: การพัฒนาต่อในอนาคต (Improvement)	02 ก.พ. 67	-	กำลังดำเนินการ

รายงานสิ่งที่ได้รับมอบหมาย

ผมนายธีรวัฒน์ ชู เป็น Outsource ทีม AI จากที่ได้ศึกษากลยุทธ์ 14 วันที่ 16 ม.ค. 67 และทำการ Backtesting (ทดสอบย้อนหลัง) ของกราฟราคา TQQQ ตั้งแต่วันที่ 2024-01-02 ถึงวันที่ 2024-01-26 โดยมีลักษณะการ Buy และการ Sell ดังนี้

- ลักษณะการ Buy ประกอบไปด้วย 1 ลักษณะ
 1. ทำการ Buy ที่ตำแหน่ง HL1 (ตามกลยุทธ์ 1.1.4)
- ลักษณะการ Sell ประกอบไปด้วย 4 ลักษณะ
 1. ทำการ Sell ที่ตำแหน่ง LH1 (ตามกลยุทธ์ 1.2.4)
 2. ทำการ Sell ที่ตำแหน่ง EMA 12 ตัด 24 ลง (ตามกลยุทธ์ 1.2.5)
 3. ทำการ Sell ที่ตำแหน่ง LH1 หรือตำแหน่ง EMA 12 ตัด 24 ลง
 4. ทำการ Sell ที่ตำแหน่ง EMA 12 ตัด 24 ลง และ LH1

จากการ Buy หรือ Sell ตามลักษณะที่ได้กล่าวมาข้างต้นพบว่า เมื่อหุ้นเป็นขาขึ้นสามารถทำกำไรได้อย่างสม่ำเสมอ แต่เมื่อหุ้นเป็นขาลงและ/หรือ Sideways จะพบ False signal (สัญญาณผิด) ก่อนข้างบ่อย ส่งผลให้มีโอกาสขาดทุนก่อนข้างสูง เนื่องจาก 2 กรณี

1. ในช่วงต้นที่หุ้นเป็นขาขึ้นสามารถทำกำไรได้ต่อเนื่อง แต่อาจขาดทุนได้เมื่อหุ้นเป็นขาลงและ/หรือ Sideways ในช่วงท้าย
2. ในช่วงต้นที่หุ้นเป็นขาลงและ/หรือ Sideways ทำให้ขาดทุนตั้งแต่แรก ทำให้ในช่วงท้ายที่หุ้นเป็นขาขึ้นไม่สามารถทำกำไรกลับคืนได้

การเพิ่มประสิทธิภาพในการ Buy หรือ Sell ให้แม่นยำกว่าหนึ่งลักษณะการ Buy และสี่ลักษณะการ Sell ดังที่กล่าวข้างต้น คือ อาจเพิ่มเงื่อนไขหรือกรองเทรนใน Time frame 2 นาทีตามที่คุณทองมาวิเคราะห์ หรือใช้ Machine learning (การเรียนรู้ของเครื่อง) หรือ Deep learning (การเรียนรู้เชิงลึก) โดยเพิ่มข้อมูลมากกว่าที่เคยใช้อยู่เดิม เพื่อให้ Machine learning หรือ Deep learning เรียนรู้ เช่น

1. เพิ่มข้อมูลมากกว่า 2 time frames เพื่อให้ Time frame ที่ใหญ่กว่าสามารถระบุได้ว่า ณ ตอนนีหรืออนาคตกำลังเป็น Trend อะไร
2. Indicators ต่างๆ (MACD, RSI, OBV, A/D line, ADX ฯลฯ)
3. แปลงความชันของแต่ละ Indicators เป็นคะแนน

- ตัวอย่าง ความของ EMA มีค่าสูงและเป็นบวก บ่งบอกถึง การมีความเป็นไปได้ที่จะทำให้อราคาสูงขึ้นในอนาคต ในทางกลับกันความของ EMA มีค่าต่ำและเป็นตัว บ่งบอกถึง การมีความเป็นไปได้ที่จะทำให้อราคาสูงขึ้นแต่ไม่มากนัก

4. เมื่อเป็นไปตามเงื่อนไขที่คุณทองมาวิเคราะห์ เพิ่มคะแนนให้กับ Machine learning หรือ Deep learning

- ตัวอย่าง เกิด HL ให้คะแนนในการ Buy +1, เกิด LH ให้คะแนนในการ Sell +1

5. เรียนรู้ทุกเงื่อนไขของคุณทองมา เพื่อให้สามารถระบุได้ว่ามีกลยุทธ์อะไรเหมาะหรือไม่เหมาะกับสภาพตลาดในช่วงต่างๆ สิ่งนี้ทำให้ทางทีม AI สามารถวิเคราะห์ข้อดีข้อเสียของแต่ละกลยุทธ์และนำมาพัฒนาต่อได้

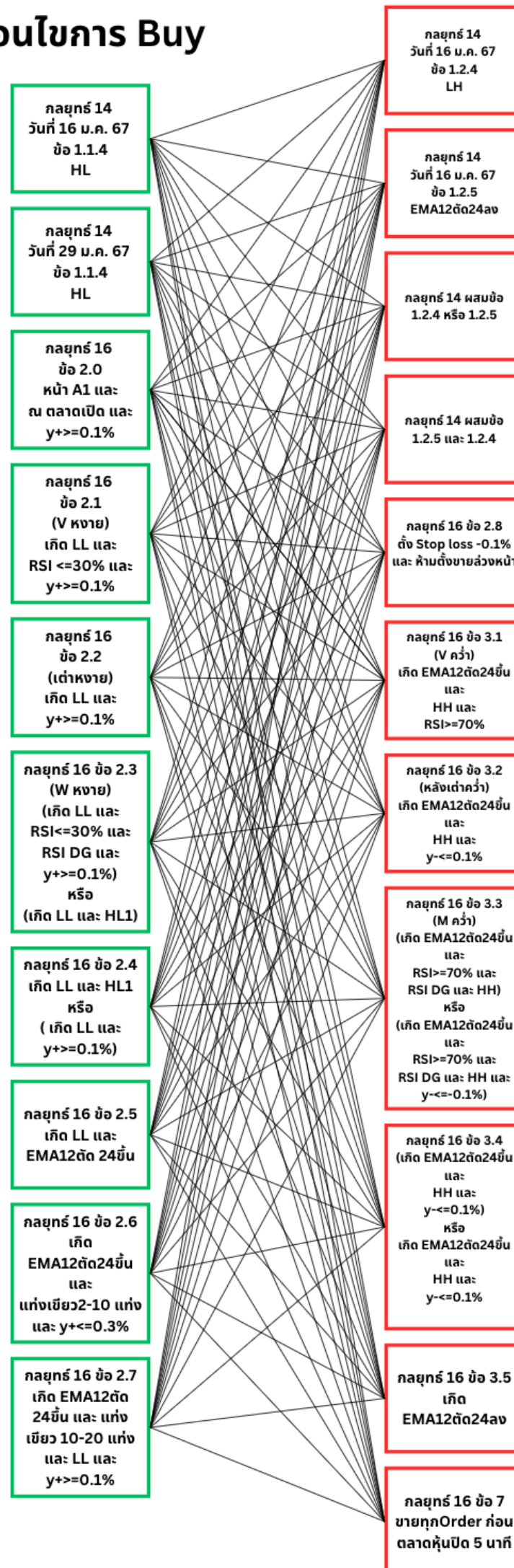
วันที่ 6 ก.พ. 67 คุณทองมาได้เปลี่ยนมาโฟกัสที่กลยุทธ์ 16 ผมจึงเปลี่ยนจากการพัฒนาเงื่อนไขในการ Buy และ Sell ของกลยุทธ์ 14 เป็นกลยุทธ์ 16 แทน โดยมุ่งเน้นการพัฒนาผลลัพธ์ต่างๆ ผ่าน Trading view เพื่อให้คุณทองมาและทีมเทรดเข้าใจตรงกับทีม AI

กรณีที่มี 10 เงื่อนไขการ Buy และ 11 เงื่อนไขการ Sell

- ถ้า Buy หรือ Sell ที่ละ 1 เงื่อนไข ผลลัพธ์ที่ได้จะเท่ากับ 110 ผลลัพธ์
- ถ้ามีการ Buy หรือ Sell หลายเงื่อนไขผสมกัน ผลลัพธ์ที่ได้จะเท่ากับ $1.44850084e14$ ผลลัพธ์

เงื่อนไขการ Buy

เงื่อนไขการ Sell



รูปแสดง ผลลัพธ์ที่ได้ 110 ผลลัพธ์