

ชื่อโครงการ (ภาษาไทย)

ดัชนีแมคดีกับเส้นสัญญาณตัดแปลงและการอนุমানค่าน้ำหนักการซื้อขายด้วยตรรกศาสตร์กลุ่มเครีอ และการประยุกต์ในการวิเคราะห์การซื้อขายหุ้นกลุ่มปั่นผลสูง 30

แหล่งเงิน สำนักงานคณะกรรมการวิจัยแห่งชาติ

ประจำปีงบประมาณ 2559 จำนวนเงินที่ได้รับการสนับสนุน 250,000 บาท

ระยะเวลาทำการวิจัย 1 ปี ตั้งแต่ 1 ตุลาคม 2558 ถึงวันที่ 30 กันยายน 2559

ชื่อ-สกุล หัวหน้าโครงการ

วิชัย วิทยาเกียรติเลิศ ภาควิชาคณิตศาสตร์ คณะวิทยาศาสตร์ สถาบันเทคโนโลยีพระจอมเกล้าเจ้าคุณทหารลาดกระบัง

บทคัดย่อ

งานวิจัยนี้นำเสนอวิธีปรับปรุงดัชนี MACD โดยปรับปรุงเส้นสัญญาณ และให้ชื่อว่า MACDP โดยมีเป้าหมายเพื่อให้ดัชนี MACD สามารถส่งสัญญาณซื้อขายก่อนสัญญาณเดิม โดยการประยุกต์ใช้ระดับความมั่นใจที่นิยมขึ้นในการตีความว่า จุดเวลาหนึ่งๆ เป็นจุดที่ MACD มีค่าต่ำสุดหรือสูงสุดในคาบหนึ่งๆ นอกจากนี้ ได้เสนอแนวทางการซื้อขายด้วยค่าน้ำหนักการซื้อขายที่อนุমানจากโดยใช้ตรรกศาสตร์ฟัซซีซึ่งสามารถปรับปรุงให้วิธีที่ใช้เส้นสัญญาณตัดแปลงมีประสิทธิภาพดีขึ้น

ในงานวิจัยได้ทดสอบประสิทธิภาพของดัชนี MACD ที่พัฒนาขึ้น กับข้อมูลราคาหุ้นในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยในดัชนี กลุ่มปั่นผลสูง 30

คำสำคัญ : MACD ตรรกศาสตร์ฟัซซี ระบบซื้อขาย การวิเคราะห์เชิงเทคนิค