

57920643: สาขาวิชา: เทคโนโลยีสารสนเทศ; วท.ม. (เทคโนโลยีสารสนเทศ)

คำสำคัญ: จุดกลับตัว/ กฎซื้อขายหลักทรัพย์/ ตัวชี้วัดแบบซิกแซก

ยศพล นารี: การออกแบบกฎซื้อขายหลักทรัพย์จากการวิเคราะห์จุดกลับตัวของราคาหุ้น  
อาจารย์ผู้ควบคุมงานนิพนธ์: สุณิสรา ริมเจริญ, Ph.D., 42 หน้า. ปี พ.ศ.2559.

งานวิจัยนี้นำเสนอวิธีการซื้อขายหลักทรัพย์ จากการวิเคราะห์ความสัมพันธ์ของจุดกลับตัว  
ของราคาหุ้น โดยใช้ตัวชี้วัดหลักคือ Zigzag ในการค้นหาความสัมพันธ์ของราคาหุ้น ในตลาด  
หลักทรัพย์ในช่วงปี 2001 ถึง 2012 แล้วนำมาสร้างกฎการซื้อขายที่สามารถทำกำไรได้ เพื่อนำไป  
เป็นแนวทางในการวิเคราะห์การลงทุนให้นักลงทุนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย

จากผลการจำลองการซื้อขายกับข้อมูลในอดีตในปี 2013 ถึง 2015 โดยใช้วิธีการวิเคราะห์  
จุดกลับตัวของราคาหุ้น เทียบกับวิธี MACD และ SMA ตลอดระยะเวลา 3 ปี สรุปได้ว่าการที่  
นำเสนอ สามารถทำกำไรได้สูงกว่าวิธีซื้อขายแบบ MACD(12,26,9) และ SMA(10,30) ที่นักลงทุน  
ส่วนใหญ่นิยมใช้กัน โดยที่วิธีการซื้อขายที่นำเสนอ มีอัตราการเติบโตโดยเฉลี่ยต่อปี 9.15% ส่วน  
วิธีการซื้อขายแบบ MACD (12,26) นั้น มีอัตราการเติบโตโดยเฉลี่ย -50.76% และวิธีการซื้อขาย  
แบบ SMA (10,30) มีอัตราการเติบโตโดยเฉลี่ยต่อปี -23.62%