

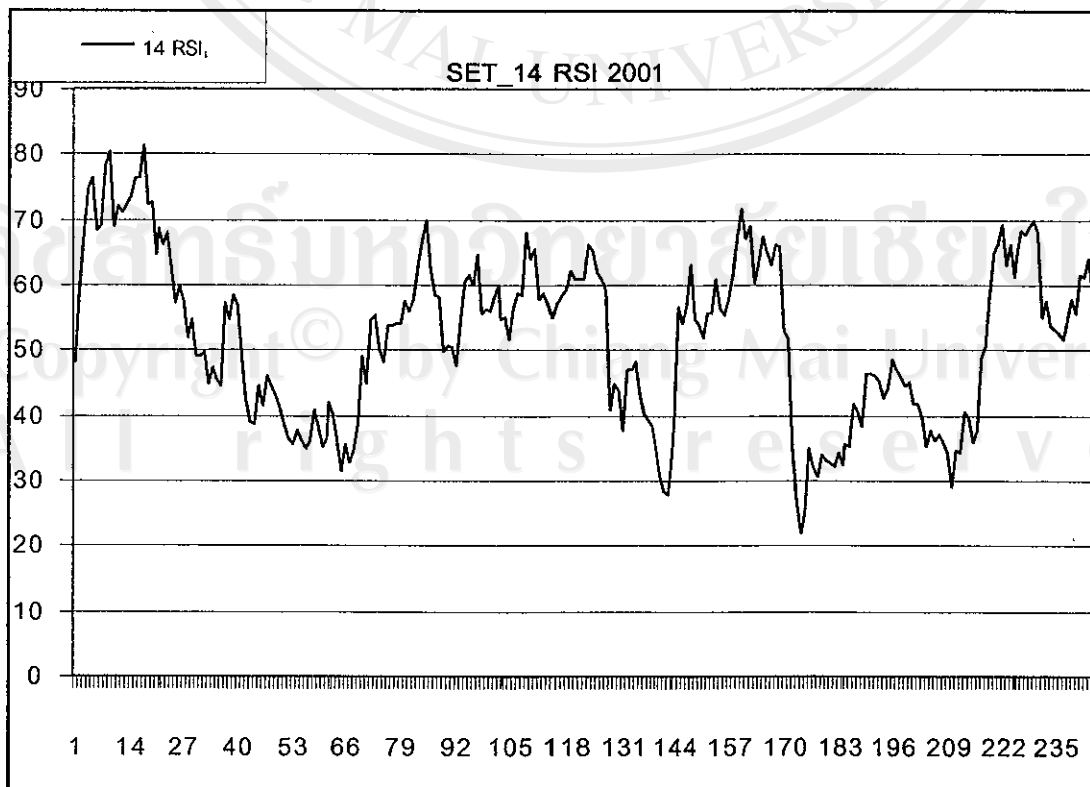
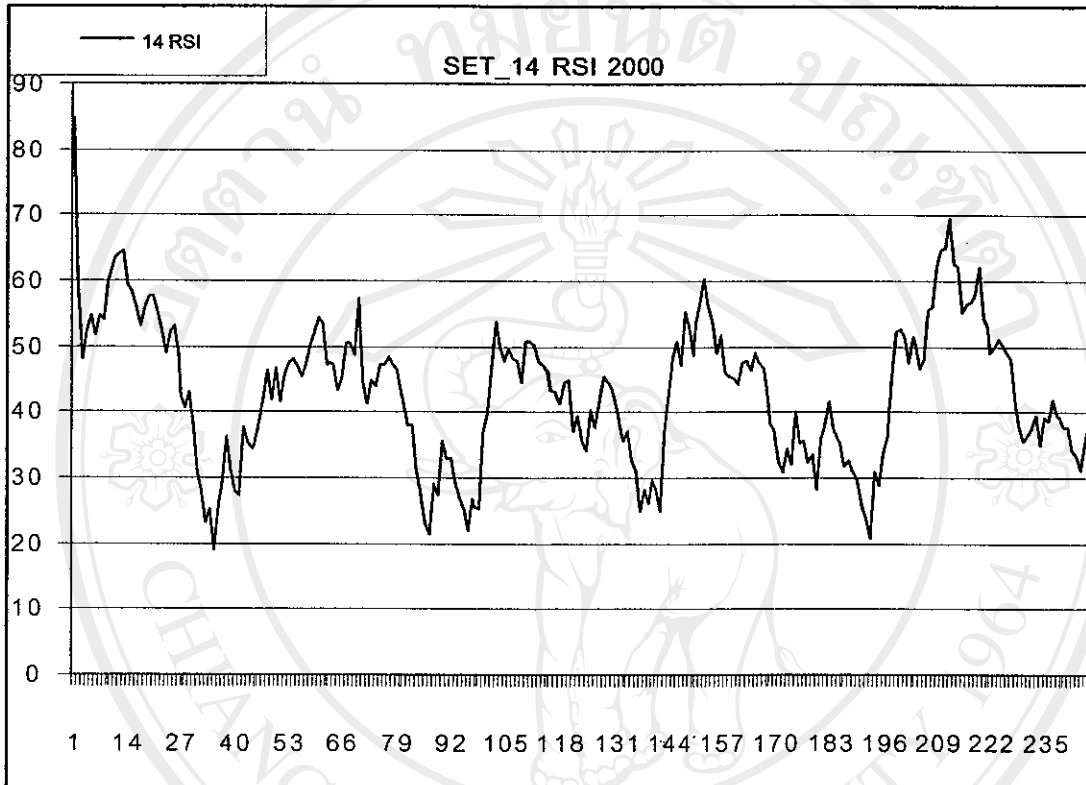


ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved

ตัวอย่างการคำนวณหาประสิทธิภาพจากสัญญาณทางเทคนิค

ในที่นี้จะยกตัวอย่างการคิดคำนวณจากข้อมูลดัชนีตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยโดยใช้เทคนิคเครื่องมือดัชนีกำลังสัมพัทธ์ (Relative Strength Index) ทำการทดสอบประสิทธิภาพ



จากกราฟจะได้สัญญาณซื้อและสัญญาณขายเกิดขึ้นทั้งหมด 7 รอบการซื้อขายดังมีรายละเอียดแสดงในตารางถัดไป

| รอบการ ซื้อขาย(n) | สัญญาณซื้อ | | สัญญาณขาย | | จำนวน วัน | ผลต่าง ดัชนี | อัตราผล ตอบแทน | Prob. |
|----------------------|------------|-----------|-----------|----------|--------------|-----------------|-------------------|--------|
| | วันที่ซื้อ | ดัชนีซื้อ | วันที่ขาย | ดัชนีขาย | | | | |
| 1 | 25/2/00 | 406.66 | 30/3/00 | 399.59 | 25 | -7.07 | -1.74 | 0.1479 |
| 2 | 16/5/00 | 350.22 | 2/6/00 | 339.77 | 25 | -10.45 | -2.98 | 0.1479 |
| 3 | 1/8/00 | 295.49 | 5/9/00 | 308.25 | 25 | 12.76 | 4.32 | 0.1479 |
| 4 | 25/9/00 | 280.25 | 30/10/00 | 270.34 | 25 | -9.91 | -3.54 | 0.1479 |
| 5 | 1/8/00 | 300.53 | 28/8/01 | 335.49 | 19 | 34.96 | 11.63 | 0.1124 |
| 6 | 19/9/01 | 287.13 | 24/10/01 | 284.06 | 25 | -3.07 | -1.07 | 0.1479 |
| 7 | 8/11/01 | 268.34 | 14/12/01 | 294.00 | 25 | 25.66 | 9.56 | 0.1479 |
| ผลรวม | | | | | 169 | | 1.98 | 1.0000 |

หมายเหตุ

1. ผลต่างดัชนี = ดัชนีขาย - ดัชนีซื้อ
2. อัตราผลตอบแทน (R_i) = $(\text{ผลต่างดัชนี}_i / \text{ดัชนีซื้อ}_i) * 100$
3. Prob. (p_i) = $\text{จำนวนวัน}_i / \sum \text{จำนวนวัน}_i$
4. อัตราผลตอบแทนโดยรวม = $\sum (\text{อัตราผลตอบแทน } (R_i) * \text{Prob. } (p_i))$
5. อัตราผลตอบแทนโดยเฉลี่ย = $\text{อัตราผลตอบแทนโดยรวม} / \sum \text{จำนวนวัน}_i$
6. ค่าเบี่ยงเบนมาตรฐาน = $\sqrt{\text{รากที่สองของ } \sum [p_i (R_i - \text{อัตราผลตอบแทนโดยรวม})^2]}$
= 5.60
7. Coefficient of Variation = $\text{ค่าเบี่ยงเบนมาตรฐาน} / \text{อัตราผลตอบแทนโดยรวม}$
8. รอบการซื้อขายที่ 1, 2, 3, 4, 6 และ 7 ไม่ปรากฏสัญญาณขาย ดังนั้นให้พิจารณาดัชนีขายเมื่อครบกำหนด 25 วันตามสมมติฐานในการทดสอบ

จากตารางสามารถสรุปผลได้ดังนี้

1. จำนวนรอบการซื้อขายทั้งหมดเท่ากับ 7 รอบการซื้อขาย
2. อัตราผลตอบแทนโดยรวมคิดเป็น 1.98%
3. อัตราผลตอบแทนโดยเฉลี่ยคิดเป็น 0.0117% ต่อวัน
4. ค่า Coefficient of Variation = 2.83

ประวัติผู้เขียน

| | |
|------------------|--|
| ชื่อ | นายวรพจน์ ตันยลักษณ์ |
| วัน เดือน ปีเกิด | 8 ตุลาคม พ.ศ. 2517 |
| ประวัติการศึกษา | สำเร็จการศึกษาระดับมัธยมศึกษาตอนปลาย จากโรงเรียนมงฟอร์ตวิทยาลัย จังหวัดเชียงใหม่ ปีการศึกษา 2535 สำเร็จการศึกษาปริญญาตรี คณะวิศวกรรมศาสตร์ จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย กรุงเทพมหานคร ปีการศึกษา 2539 |
| ประสบการณ์ | วิศวกรสนาม-วิศวกรเครื่องกล 2540-2543 บริษัทอิตาเลียนไทยคิเวลีโอปเมนท์ จำกัด(มหาชน) กรุงเทพมหานคร วิศวกรควบคุมคุณภาพ 2543-2545 บริษัท ซาฟท์เนออร์ อี เอ็ม ซี จำกัด จังหวัดลำพูน Consultant 2545 Access Capital Company Limited กรุงเทพมหานคร |

ลิขสิทธิ์มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
Copyright© by Chiang Mai University
All rights reserved