



การใช้เทคโนโลยี Machine Learning ของกองทุนรวมภายใต้การจัดการ*ของ บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด

*กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Machine Learning Thai Equity (SCBMLT)
กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Global Machine Learning Equity (SCBGML)
กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Robo Asset Allocation (SCBRAA)

Machine Learning Investment

Factor Investing

- ❖ กำหนดปัจจัยการลงทุนหลากหลาย (Factors) ที่มีผลต่อการสร้างผลตอบแทนที่เหนือกว่าตลาด (Alpha) เพื่อให้ครอบคลุมสภาวะตลาดรูปแบบต่าง ๆ
- ❖ เก็บข้อมูล เหตุการณ์ และรูปแบบการเคลื่อนไหวของตลาดในอดีต จำแนกตามปัจจัยการลงทุน
- ❖ ปรับเปลี่ยนรูปแบบการผสมผสานปัจจัยการลงทุนให้สอดคล้องกับสภาวะตลาดในแต่ละช่วงเวลา

Data Extensive

- ❖ มีศักยภาพในการวิเคราะห์ข้อมูลเหนือกว่าขีดความสามารถของมนุษย์
- ❖ วิเคราะห์ข้อมูลเชิงลึกของหุ้นรายตัวได้อย่างครอบคลุมในทุกมุมมอง (Dimension of input)
- ❖ ผสมผสานปัจจัยต่าง ๆ (Factor-blended) ที่ส่งผลต่อการลงทุนได้หลากหลาย
- ❖ มีระบบการทำงานอย่างเป็นระเบียบ และมีขั้นตอนที่ชัดเจน นำไปสู่กระบวนการสร้างผลตอบแทนที่สม่ำเสมอ

Competency Improvement

- ❖ สามารถเรียนรู้และพัฒนาตัวเองได้อย่างต่อเนื่อง รองรับสถานการณ์รูปแบบต่าง ๆ และสภาพตลาดที่เปลี่ยนแปลงอยู่ตลอดเวลา
- ❖ ลดข้อผิดพลาด และอคติของมนุษย์
- ❖ มีศักยภาพขยายกรอบการลงทุนให้กว้างขึ้นได้ทั่วโลก
- ❖ มีคุณภาพเทียบเท่ามาตรฐานระดับสากล ด้วยเงินลงทุนพัฒนาระบบกว่า 10 ล้านบาท

ขั้นตอนการลงทุน



ขั้นตอนที่ 1 : Factors Investing



ขั้นตอนที่ 2 : Style Rotation by AI



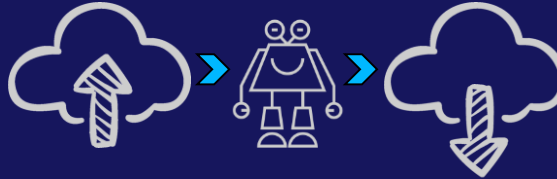
ขั้นตอนที่ 3 : Optimization

6 ปัจจัยพิจารณาการลงทุน



เลือกปัจจัยพิจารณาการลงทุนที่มี Information Coefficient (IC) สูง

IC = ความสามารถในการ
จัดลำดับหุ้นตาม
ผลตอบแทนในอนาคต



Input

Output

ผลการดำเนินงานในอดีต ผลตอบแทนในอนาคต

ปรับเปลี่ยนสไตล์การลงทุนอย่างต่อเนื่องโดยปัญญาประดิษฐ์ เพื่อหาปัจจัยการลงทุนที่ดีที่สุด ที่ส่งผลต่อการสร้างผลตอบแทนในอนาคต”

เพิ่มประสิทธิภาพการตัดสินใจลงทุนให้
มีความสมดุลระหว่างผลตอบแทน
ความเสี่ยง และต้นทุน



ขั้นตอนการลงทุนของกองทุน Machine Learning



ขั้นตอนที่ 1 : Factors Investing



ขั้นตอนที่ 2 : Style Rotation by AI



ขั้นตอนที่ 3 : Optimization

กลยุทธ์การลงทุนที่คัดเลือกหลักทรัพย์ตามความสามารถในการสร้างผลตอบแทนเหนือกว่าตลาด

Sentiment

กลุ่มหุ้นที่นักวิเคราะห์มีความเชื่อมั่นในผลประกอบการของธุรกิจ

Value

กลุ่มหุ้นที่มีราคาถูกกว่ามูลค่าพื้นฐาน

Quality

กลุ่มหุ้นของบริษัทคุณภาพที่สามารถสร้างกำไรและให้ผลตอบแทนอย่างมีเสถียรภาพ

Risk

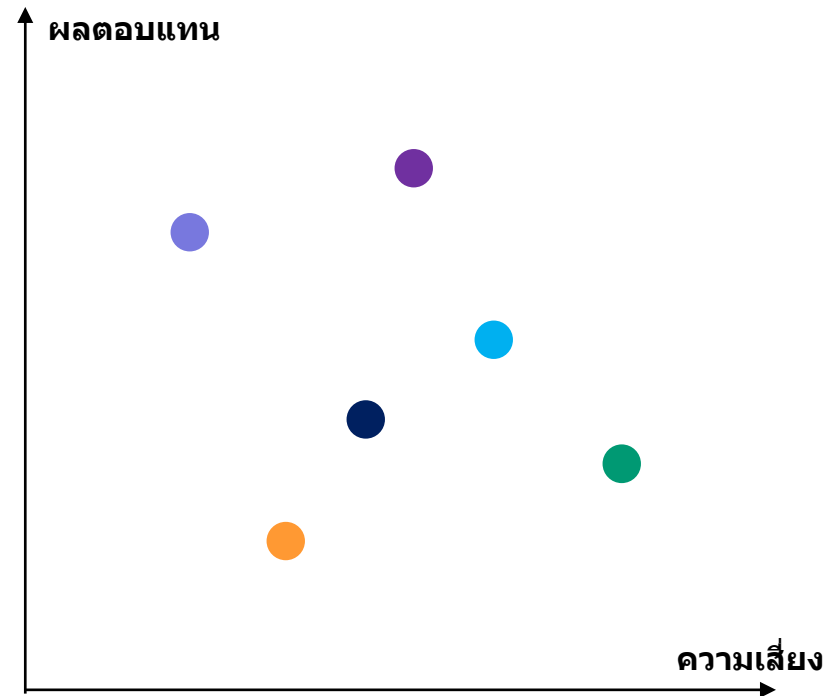
พอร์ตการลงทุนมีความผันผวนต่ำเมื่อเทียบกับตลาดโดยรวม

Momentum

กลุ่มหุ้นที่มีแนวโน้มราคาเชิงบวก

Growth

กลุ่มหุ้นที่มีแนวโน้มมีผลประกอบการและราคาหุ้นเติบโตอย่างก้าวกระโดด



ขั้นตอนการลงทุนของกองทุน Machine Learning



ขั้นตอนที่ 1 : Factors Investing

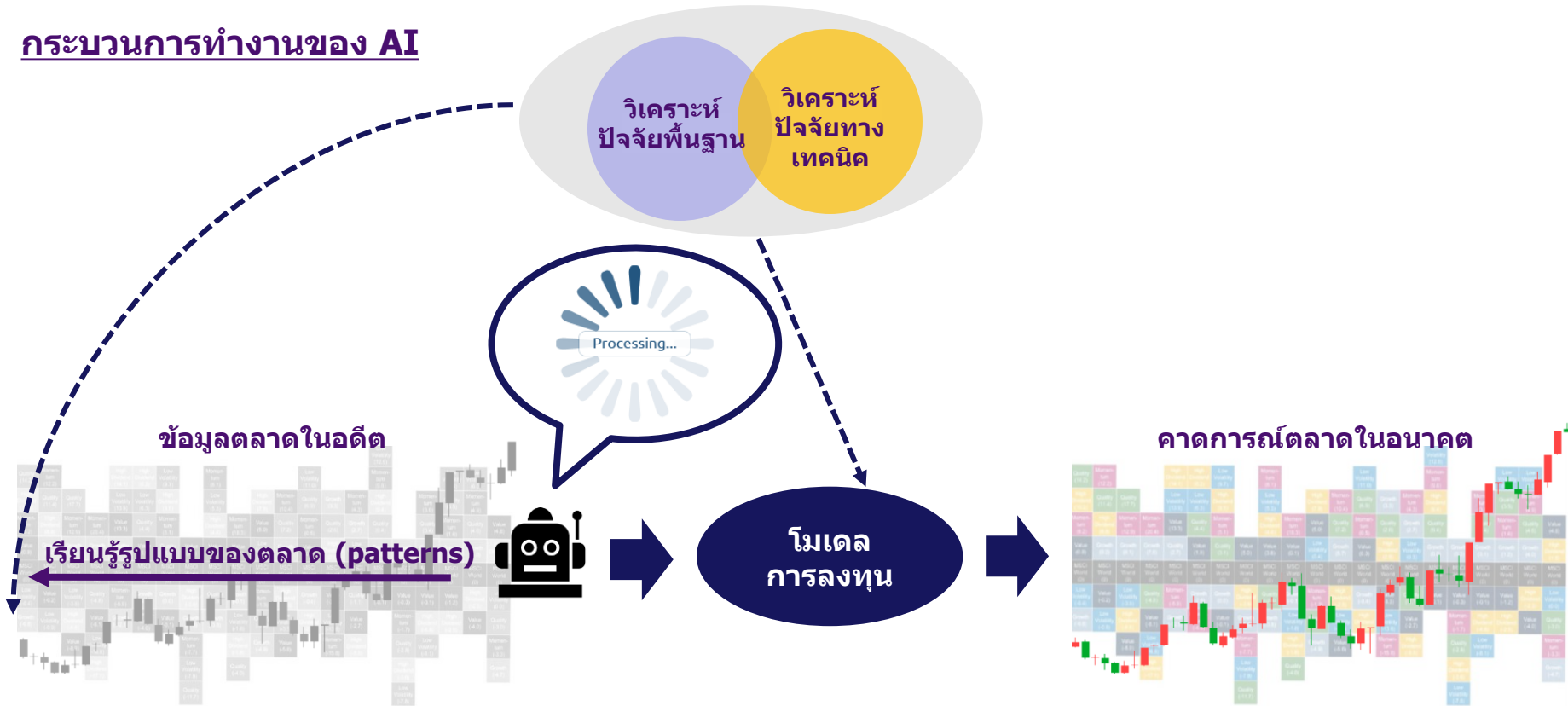


ขั้นตอนที่ 2 : Style Rotation by AI



ขั้นตอนที่ 3 : Optimization

กระบวนการทำงานของ AI



ขั้นตอนการลงทุนของกองทุน Machine Learning



ขั้นตอนที่ 1 : Factors Investing



ขั้นตอนที่ 2 : Style Rotation by AI



ขั้นตอนที่ 3 : Optimization

กลยุทธ์ Optimization เป็นขั้นตอนสำคัญที่จะทำให้พอร์ตการลงทุนสามารถบรรลุเป้าหมายที่ดีที่สุด โดยรักษาสสมดุลระหว่างผลตอบแทน ความเสี่ยง และต้นทุนการลงทุน

