

**การใช้เทคโนโลยี Machine Learning  
ของกองทุนรวมภายใต้การจัดการ\*ของ  
บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด**



# SCB Machine Learning Fund

## Factor Investing

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

## Data Extensive

- ◆ มีศักยภาพในการวิเคราะห์ข้อมูลเหนือกว่าขีดความสามารถของมนุษย์
- ◆ วิเคราะห์ข้อมูลเชิงลึกของหุ้นรายตัวได้อย่างครอบคลุมในทุกมุมมอง (Dimension of input)
- ◆ ผสมผสานปัจจัยต่าง ๆ (Factor-blended) ที่ส่งผลการลงทุนได้หลากหลาย
- ◆ มีระบบการทำงานอย่างเป็นระเบียบ และมีขั้นตอนที่ชัดเจน นำไปสู่กระบวนการสร้างผลตอบแทนที่สม่ำเสมอ

## Competency Improvement

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



## DATA

### Traditional Data

#### Fundamental Data

- Balance Sheet
- Cash Flow Statement

#### Market Data

- Price
- Volume

#### Analytics

- Analyst Recommendations
- Earnings Forecast

### Alternative Data

- ESG
- NVDR
- Broker Score
- News Sentiment
- Email Sentiment
- Derivatives Trading



## FACTORS

VALUE	QUALITY
GROWTH	RISK
SENTIMENT	SIZE
MOMENTUM	ALTERNATIVE



## ML PREDICTION

Dimensionality Reduction

Regression Model

Classification Model

Clustering

Neural Network



## OPTIMIZATION

Costs



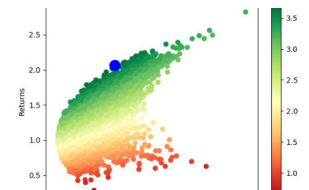
Risks



Return



Performance



# Investment Process

1

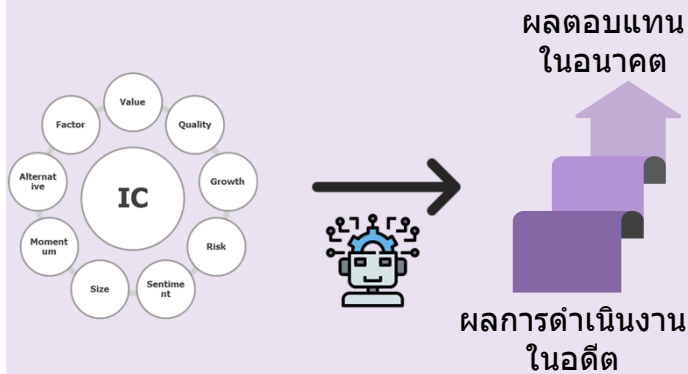
## Factors Investing



เลือกพิจารณาปัจจัยการลงทุนที่มีความสามารถในการจัดลำดับตามผลตอบแทนในอนาคต หรือ Information Coefficient (IC) สูง

2

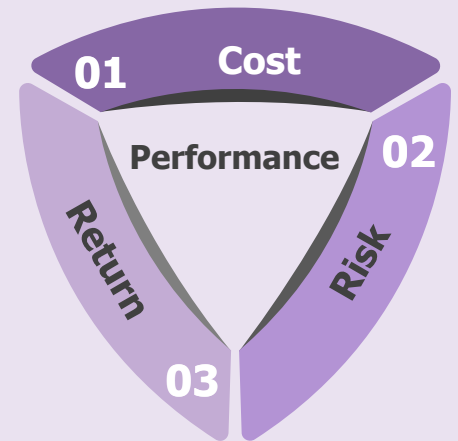
## Style Rotation by AI



ปรับเปลี่ยนสไตล์การลงทุนอย่างต่อเนื่องโดยปัญญาประดิษฐ์เพื่อหาปัจจัยการลงทุนที่ดีที่สุดที่ส่งผลต่อการสร้างผลตอบแทนในอนาคต

3

## Optimization



เพิ่มประสิทธิภาพการตัดสินใจลงทุนให้มีความสมดุลระหว่างผลตอบแทน ความเสี่ยง และต้นทุน

# กองทุน Machine Learning Investment



**SCBMLT**  
กองทุนเปิดไทยพาณิชย์  
Machine Learning Thai Equity



**SCBGML**  
กองทุนเปิดไทยพาณิชย์  
Global Machine Learning  
Equity



**SCBMLCA**  
กองทุนเปิดไทยพาณิชย์  
Machine Learning  
China All Share



**SCBRAA**  
กองทุนเปิดไทยพาณิชย์  
Robo Asset Allocation

ผลการดำเนินงานในอดีต มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต กองทุนไม่ได้ป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยนทั้งจำนวน ผู้ลงทุนอาจขาดทุน หรือได้รับกำไรจากอัตราแลกเปลี่ยน หรือได้รับเงินคืนต่ำกว่าเงินลงทุนเริ่มแรกได้ ผู้ลงทุนควรทำความเข้าใจลักษณะสินค้า เงื่อนไขผลตอบแทน ความเสี่ยง ก่อนตัดสินใจลงทุน สอบถามรายละเอียดเพิ่มเติม และขอรับหนังสือชี้ชวนได้ที่ธนาคารไทยพาณิชย์ หรือ บลจ.ไทยพาณิชย์ โทร. 02-777-7777 [www.scbam.com](http://www.scbam.com)

กองทุนอาจมีความเสี่ยงจากสัญญาซื้อขายล่วงหน้า และอาจลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งตราสารที่มีสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแฝง (Structured Note) รวมถึงอาจทำธุรกรรมให้ยืมหลักทรัพย์ หรือธุรกรรมการซื้อโดยมีสัญญาขายคืน (Reverse Repo) หรือธุรกรรมการขายโดยมีสัญญาซื้อคืน และอาจทำธุรกรรมการยืมหลักทรัพย์ หรือลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเพื่อเก็งกำไร ผู้ลงทุนควรลงทุนควรทำความเข้าใจและควรพิจารณาความเหมาะสม ของการลงทุนโดยคำนึงถึงประสบการณ์การลงทุนวัตถุประสงค์การลงทุนและฐานะการเงินของผู้ลงทุนเอง