

ENMO

กลยุทธ์นี้คือคัดเลือกเฉพาะหุ้นที่ได้รับการประเมินมูลค่า และมีการคาดการณ์การเติบโตของกำไรบริษัทในอนาคตจากนักวิเคราะห์ในหลากหลายสถาบัน โดยจะเน้นลงทุนในหุ้นที่มีการเติบโตของกำไรในอดีตและอนาคตที่สูงติดอันดับต้น ๆ เพื่อคาดหวังผลตอบแทนของราคาที่จะเติบโตมากขึ้นในอนาคต โดยจะมีการคัดกรองแนวโน้มราคาของหุ้นที่อยู่ในแนวโน้มขาขึ้นระยะยาว



จุดเด่นของกลยุทธ์

- เน้นวิเคราะห์หุ้นของนักวิเคราะห์ที่ช่วยในการคัดเลือกหุ้น
- เน้นถือลงทุนในหุ้นที่มีศักยภาพที่เติบโตสูง
- ประเมินสภาพภาพการเติบโตทั้งในอดีตและอนาคต

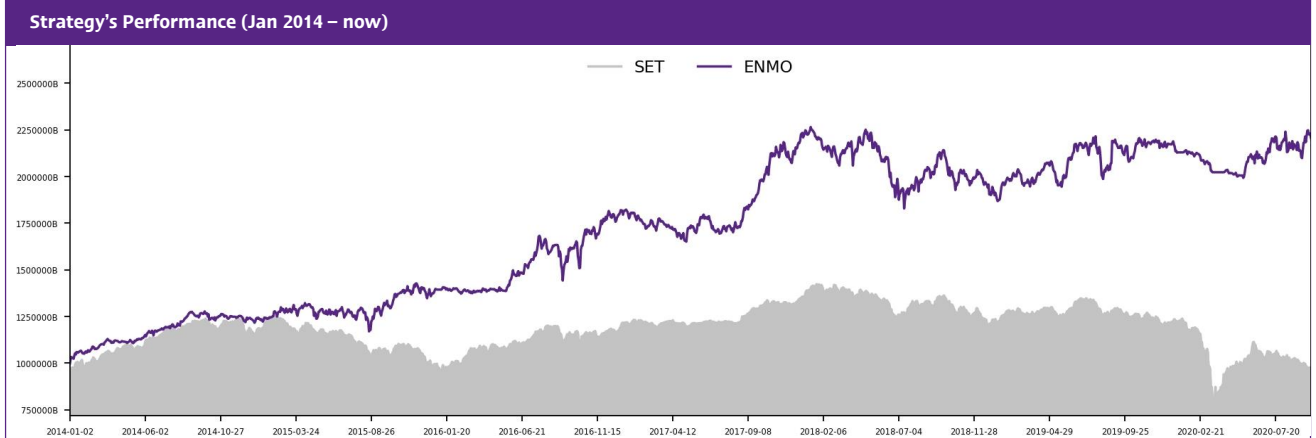


เหมาะกับนักลงทุน

- เน้นถือหุ้นที่มีการเติบโตในระยะยาว
- ชอบลงทุนในหุ้นที่มีอัตราการเติบโตที่โดดเด่น
- ชอบติดตามบทวิเคราะห์ของนักวิเคราะห์

Model Concept		Model Statistics		Since Inception	SET	Outperform Market Trend (full ★★★)	
Theme	Earning Growth	CAGR	12.44%	-0.64%	Uptrend	★★	
Universe	SET: Large and liquid stocks	Standard Deviation	14.27%	15.04%	Sideway	★	
Concept	Invest in high earnings growth	Maximum Drawdown	-19.26%	-44.29%	Downtrend	-	
Buy Signal	Analysts' consensus increase in EPS growth projection to be in the top 15 th ranked and stock price is on an uptrend	CAGR/MaxDD	-0.6457	0.0144	 Screener Tools		
Sell Signal	Stock price is on a downtrend or downward revision from analysts' consensus	Sharpe Ratio	0.7664	-0.1423	Fundamental	★	
		%Win (Trade)	50.64%	-	Momentum	★	
		Average Gain (Trade)	9.52%	-	Valuation	★★★	
		Average Loss (Trade)	-5.60%	-	Liquidity	★★	
Screener	Sufficient trading value and mid to large market capitalization	Average Holding Period	-	-	Low Volatility	-	
					Low Beta	-	
Risk Management	Maximum 10% per stock				 Investment Preference		
					Portfolio Volatility	Medium	
					Average Position	7 Stocks	

Monthly Performance		Jan	Feb	Mar	Apr	May	Jun	Jul	Aug	Sep	Oct	Nov	Dec	Ytd
2015	ENMO	1.2%	3.2%	1.1%	-0.4%	-2.0%	1.3%	0.3%	-3.5%	4.5%	7.4%	1.2%	-0.9%	13.8%
	SET	5.6%	0.4%	-5.1%	1.4%	-2.0%	0.6%	-4.3%	-4.0%	-2.4%	3.4%	-2.5%	-5.3%	-14.0%
2016	ENMO	-0.2%	-0.3%	0.3%	-0.5%	4.5%	5.4%	7.9%	-0.7%	-1.1%	6.0%	4.2%	2.0%	30.5%
	SET	1.0%	2.4%	5.7%	-0.2%	1.4%	1.5%	5.5%	1.6%	-4.2%	0.8%	1.0%	2.2%	19.8%
2017	ENMO	-2.4%	-1.8%	-0.6%	-2.9%	0.8%	2.2%	-0.3%	4.8%	8.3%	7.8%	-1.1%	6.7%	22.6%
	SET	2.2%	-1.1%	1.0%	-0.6%	-0.3%	0.8%	0.1%	2.5%	3.5%	2.9%	-1.4%	3.3%	13.7%
2018	ENMO	-1.3%	-3.8%	3.3%	2.4%	-6.1%	-7.2%	0.1%	4.7%	4.7%	-5.8%	-1.1%	-4.6%	-14.7%
	SET	4.2%	0.2%	-2.9%	0.2%	-3.0%	-7.6%	6.7%	1.2%	2.0%	-5.0%	-1.6%	-4.7%	-10.8%
2019	ENMO	3.7%	2.1%	-1.5%	4.3%	-3.8%	9.3%	1.7%	-6.5%	4.3%	0.8%	0.6%	-0.2%	14.9%
	SET	5.0%	0.7%	-0.9%	2.1%	-3.2%	6.8%	-1.1%	-3.3%	-1.1%	-2.2%	-0.7%	-0.7%	1.0%
2020	ENMO	-2.6%	-2.5%	-2.6%	-0.7%	4.8%	-0.5%	3.0%	-0.1%	2.2%				0.8%
	SET	-4.2%	-11.5%	-16.0%	15.6%	3.2%	-0.3%	-0.8%	-1.3%	-5.6%				-21.7%



หมายเหตุ 1: ผลการทดสอบรวมค่าคอมมิชชั่น 0.25% และค่าธรรมเนียมการซื้อขาย 20% และไม่รวมค่าธรรมเนียมอื่นๆ และภาษีมูลค่าเพิ่ม
 หมายเหตุ 2: ค่าสถิติของกลยุทธ์และดัชนีชี้วัดไม่รวมผลตอบแทนจากเงินปันผล
 หมายเหตุ 3: ผลการทดสอบ out-of-sample ตั้งแต่เดือนกรกฎาคม ปี 2018
 หมายเหตุ 4: ค่าผลตอบแทนในตาราง Monthly Performance ไม่รวมค่าธรรมเนียมการซื้อขาย 20%

หมายเหตุ 5: บริษัท Algo Invest มีความเสี่ยงทางด้านกลยุทธ์การลงทุนและโอกาสที่อาจสูญเสียเงินต้นจากการลงทุนได้ ทั้งนี้ ผู้ลงทุนสามารถพิจารณาจากค่าทางสถิติผลตอบแทนสูงสุด (Maximum Drawdown) ของโมเดลการลงทุนนี้ที่เกิดขึ้นในรอบระยะเวลาที่กำหนดในอดีตได้ ใน Factsheet

Disclaimer : The information contained in the reports within this document is intended for informational purposes only. While the information and statistics within this document are believed to be complete and accurate, we cannot guarantee their completeness or accuracy. As past performance does not guarantee future results, these results may have no bearing on, and may not be indicative of, any individual returns realized through participation in this or any other investment.

Statistics	Definition
CAGR	ผลตอบแทนเฉลี่ยต่อปีแบบทบต้น
Standard Deviation	ความผันผวนของผลตอบแทน (คำนวณจากผลตอบแทนรายวัน)
Maximum Drawdown	เปอร์เซ็นต์มูลค่าพอร์ตที่ลดลงมากที่สุดโดยเทียบกับมูลค่าพอร์ตสูงสุดก่อนหน้านี้
CAGR/MaxDD	อัตราส่วนความสามารถในการสร้างผลตอบแทนเฉลี่ยต่อปีต่อความเสี่ยงสูงสุดที่เคยเกิดขึ้น
Sharpe Ratio	อัตราส่วนของผลตอบแทนส่วนเกินจากการลงทุนในสินทรัพย์ที่ปราศจากความเสี่ยงต่อความผันผวน (ใช้ค่าผลตอบแทนจากสินทรัพย์ที่ปราศจากความเสี่ยงเป็น 1.5%)
%Win (Trade)	โอกาสที่จะทำกำไรต่อการเทรด 1 ครั้งโดยวัดจากราคาเฉลี่ยซื้อและราคาเฉลี่ยขาย
Average Gain (Trade)	ค่าเฉลี่ยผลกำไรต่อการเทรด 1 ครั้งโดยวัดจากราคาเฉลี่ยซื้อและราคาเฉลี่ยขาย
Average Loss (Trade)	ค่าเฉลี่ยผลขาดทุนต่อการเทรด 1 ครั้งโดยวัดจากราคาเฉลี่ยซื้อและราคาเฉลี่ยขาย
Average Holding Period	จำนวนวันเฉลี่ยในการถือหุ้นแต่ละตัว (วันทำการ)

Disclaimer : The information contained in the reports within this document is intended for informational purposes only. While the information and statistics within this document are believed to be complete and accurate, we cannot guarantee their completeness or accuracy. As past performance does not guarantee future results, these results may have no bearing on, and may not be indicative of, any individual returns realized through participation in this or any other investment.