

BUALUANG iProgramTrade

Adaptive Strategy Model (ADS 001)

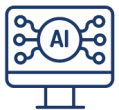
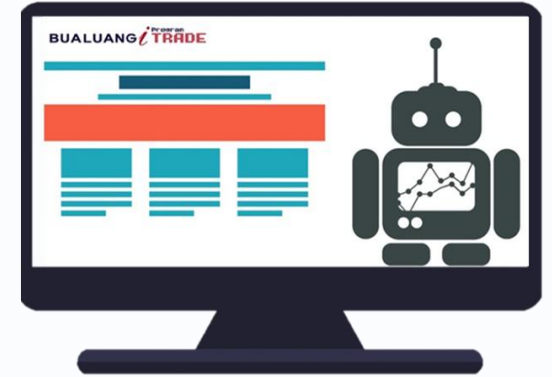




การบริหารพอร์ตอัตโนมัติ Bualuang iProgramTrade

Thailand's First Automated Trading Service

ระบบบริหารพอร์ตด้วยคอมพิวเตอร์ที่จะเข้ามาช่วยเพิ่มขีดความสามารถการส่งคำสั่งซื้อขายหุ้นแบบ Full Automatic ตามรูปแบบกลยุทธ์การลงทุนที่เหมาะสมกับนักลงทุนแต่ละราย ภายใต้การดูแลจากทีมที่ปรึกษาการลงทุนและวิศวกรทางการเงินผู้เชี่ยวชาญ



ซื้อขายเป็นระบบ

กำหนดสัญญาณซื้อขายไว้ล่วงหน้าตามกลยุทธ์ ปราศจากอารมณ์ของผู้ลงทุน



ส่งคำสั่งอัตโนมัติ

ใช้ระบบคอมพิวเตอร์ในการคำนวณและส่งคำสั่งโดยอัตโนมัติ (Full Automatic)



ประหยัดเวลา

ใช้ระบบคอมพิวเตอร์วิเคราะห์และซื้อขายหลักทรัพย์พร้อมกันได้หลายตัว ไม่ต้องเสียเวลาเฝ้าหน้าจอ



บริหารความเสี่ยง

มีการคำนวณสัดส่วนการลงทุนและกระจายหุ้นอย่างเหมาะสมตามกลยุทธ์ ทำให้พอร์ตผันผวนน้อยกว่าตลาด



กลยุทธ์หลากหลาย

สามารถเลือกกลยุทธ์การลงทุนที่เหมาะสมกับนักลงทุนแต่ละราย ไม่ว่าจะเป็นการใช้การวิเคราะห์ทางเทคนิค พื้นฐาน หรือผสมผสาน



ติดตามได้ง่าย

สามารถติดตามผลการลงทุนได้ง่ายๆ ผ่าน Bualuang iTracker และ Streaming



แนวคิดการลงทุน ADS 001

นักลงทุนหุ้นส่วนใหญ่มีสไตล์ที่ตัวเองถนัด บางคนชอบเล่นตามแนวโน้มราคา บางคนเน้นหุ้นเติบโต บางคนเน้นหุ้นคุณค่าที่ราคา
ยังถูก แต่สิ่งนี้นักลงทุนหลายคนเจอคือ **ไม่มีสไตล์ไหนที่ได้ผลดีในทุกสถานะตลาด**

ในช่วงที่ตลาดมีแนวโน้มชัดเจน หุ้นที่มีแรงส่งของราคา (Momentum) มักวิ่งนำตลาด แต่เมื่อตลาดกลับตัว หุ้นกลุ่มเดียวกันก็
อาจปรับลงแรงที่สุด บางช่วงตลาดให้รางวัลกับหุ้นที่กำไรเติบโตสูง ขณะที่บางช่วงเงินลงทุนไหลเข้าหุ้นขนาดใหญ่หรือหุ้นปันผลที่
มั่นคงกว่า

ADS 001 (Adaptive Strategy Model) จึงถูกออกแบบมาเพื่อแก้ปัญหานี้ แทนที่จะเดิมพันกับสไตล์เดียว ADS 001 รวมกล
ยุทธ์ย่อย **หลายสไตล์การลงทุนไว้ในพอร์ตเดียว** แล้วให้ระบบประเมินทุกเดือนว่ากลยุทธ์ไหนกำลังทำงานได้ดีเมื่อเทียบกับความ
เสี่ยง จากนั้นปรับน้ำหนักการลงทุนให้อัตโนมัติ พร้อมถือเงินสดเพิ่มขึ้นได้เมื่อไม่มีโอกาสลงทุนที่คุ้มค่าพอ



จุดเด่นของกลยุทธ์การลงทุน Adaptive Strategy Model

ผสมรูปแบบการลงทุนทั้ง
Technical + Fundamental
มีหลากหลายกลยุทธ์การลงทุน



ปรับเปลี่ยนกลยุทธ์ให้เหมาะสม
ในแต่ละช่วงเวลา
เลือกกลยุทธ์การลงทุนใหม่ทุกเดือน
โดยพิจารณาจากผลตอบแทนและ
ความเสี่ยงในช่วงที่ผ่านมา

ADS 001

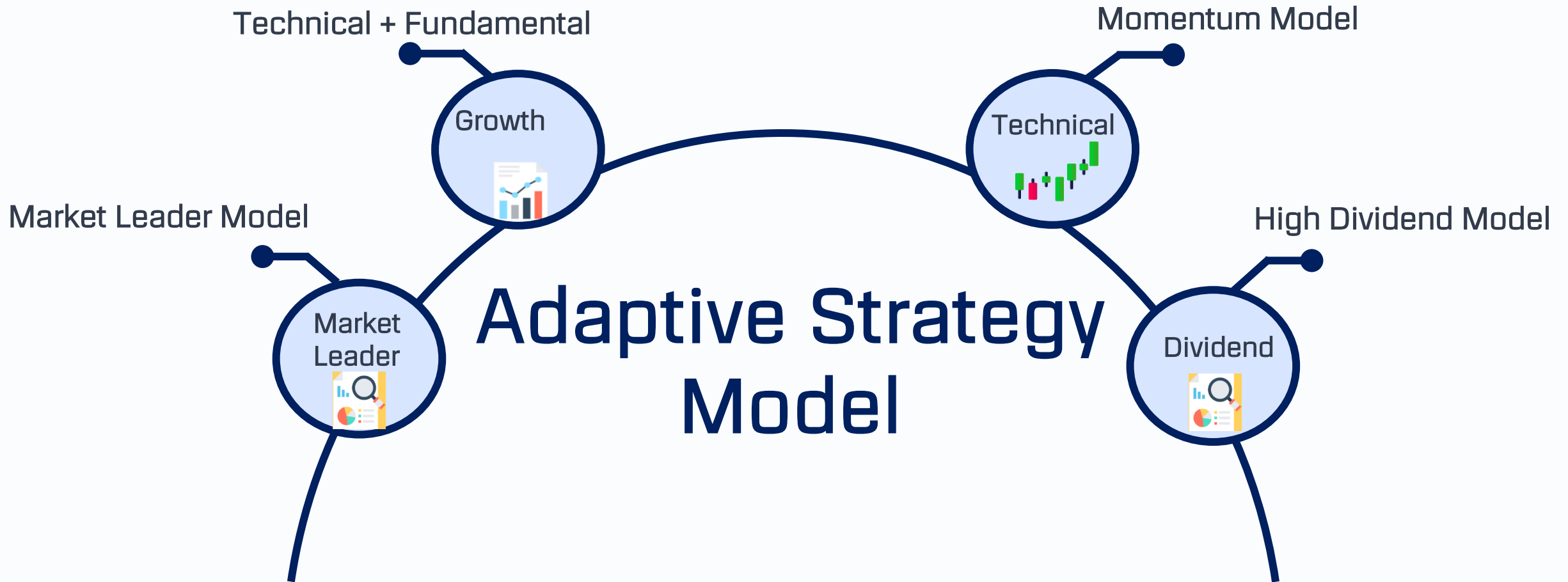
จัดสรรเงินลงทุนตาม
แต่ละกลยุทธ์
ซื้อหุ้นแต่ละครั้งตามสัดส่วนที่
เหมาะสม



Stock Universe
SET100



เลือกโมเดลลงทุนตามสถานการณ์





เลือกโมเดลลงทุนตามสถานการณ์

Technical



หุ้นที่ราคามีแรงส่งขาขึ้น จับหุ้นที่ตลาดกำลังให้ความสนใจและมีแนวโน้มราคาชัดเจน

โดยวิธีการคัดเลือกหุ้น คือ ใช้ Golden Cross Momentum ยืนยันว่าแนวโน้มขาขึ้นเกิดขึ้นจริงในเชิงโครงสร้างของราคา และใช้ Price Momentum ย้อนหลัง วัดความแข็งแกร่งของราคา หุ้นที่ได้คะแนนสูงสุดจะถูกคัดเลือกเข้าพอร์ต

Market Leader



หุ้นขนาดใหญ่ สร้างแกนที่มั่นคงด้วยบริษัทขนาดใหญ่ที่มีรายได้สูงและสภาพคล่องดี

กลยุทธ์นี้เลือกบริษัทขนาดใหญ่ ซึ่งมักมีธุรกิจที่มั่นคงและสภาพคล่องสูง ระบบจัดอันดับจาก มูลค่าหลักทรัพย์ตามราคาตลาด (Market Capitalization) และรายได้ย้อนหลัง การดูรายได้ควบคู่กับมูลค่าตลาด

Dividend



หุ้นปันผลสูงที่แข็งแกร่งกว่ากลุ่ม ลงทุนในหุ้นปันผลสูงในจังหวะที่แนวโน้มราคาระยะยาวแข็งแกร่ง

กลยุทธ์นี้เลือกหุ้นจากหุ้นปันผลสูงที่มีสภาพคล่อง และต้องมีการจ่ายปันผลสม่ำเสมอ โดยระบบจะคัดเลือกเฉพาะหุ้นที่แนวโน้มราคาระยะยาวแข็งแกร่งกว่าดัชนีตลาด เพื่อป้องกันการเลือกหุ้นปันผลดีแต่ราคาปรับตัวลงต่อเนื่อง

Growth

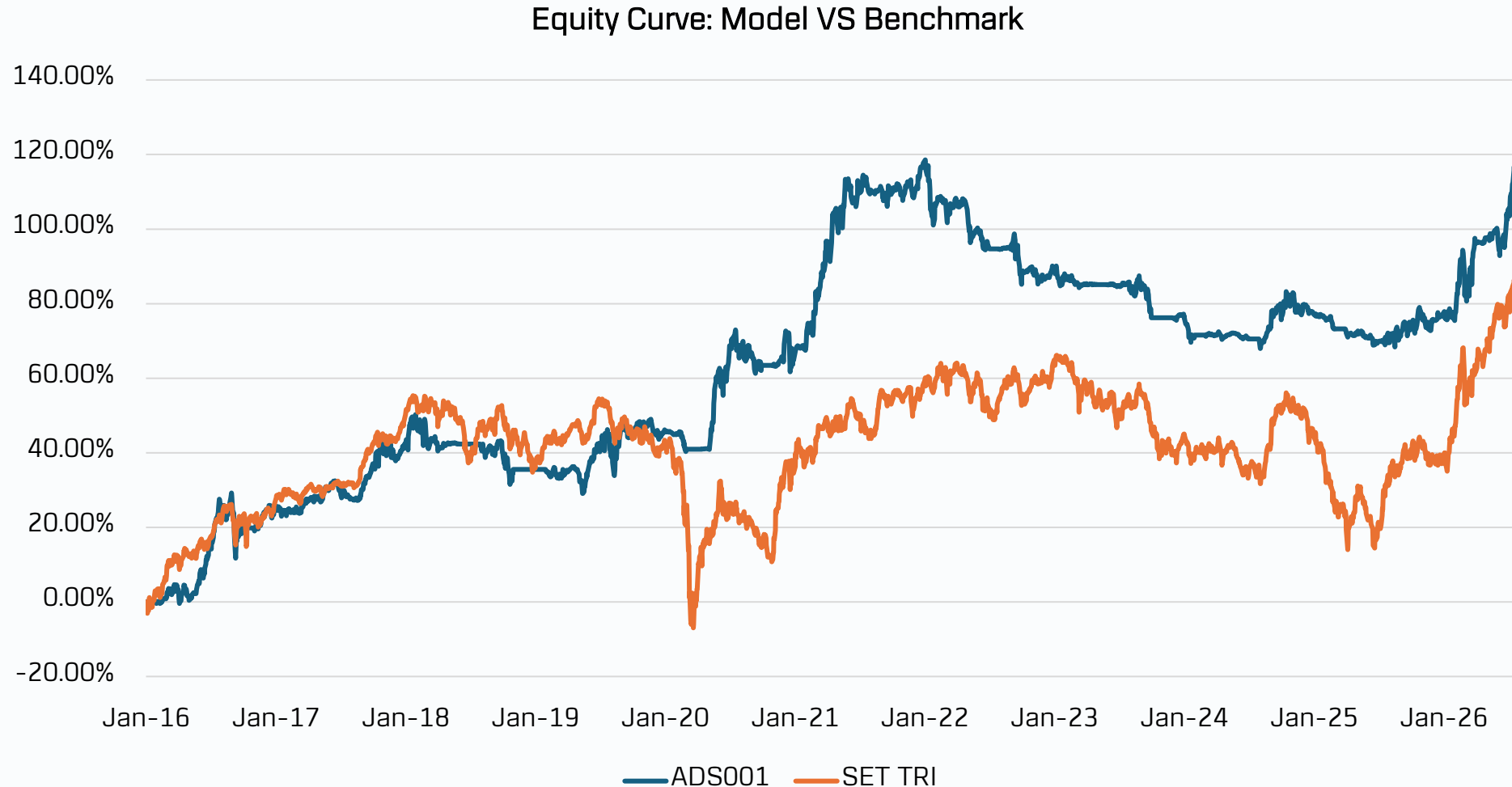


หุ้นเติบโตราคาสมเหตุสมผล จับหุ้นที่กำลังโตในจังหวะที่ราคาเริ่มเร่งตัว

คัดกรองพื้นฐาน: เลือกหุ้นในกลุ่ม SET100 ที่กำไรเพิ่มขึ้น และเปรียบเทียบค่า P/E กับตลาด จากนั้นจัดอันดับตามความผันผวนของราคาและค่า P/E เพื่อคัดเลือกหุ้นกลุ่มเป้าหมาย



ผลการทดสอบย้อนหลังของกลยุทธ์ ADS 001

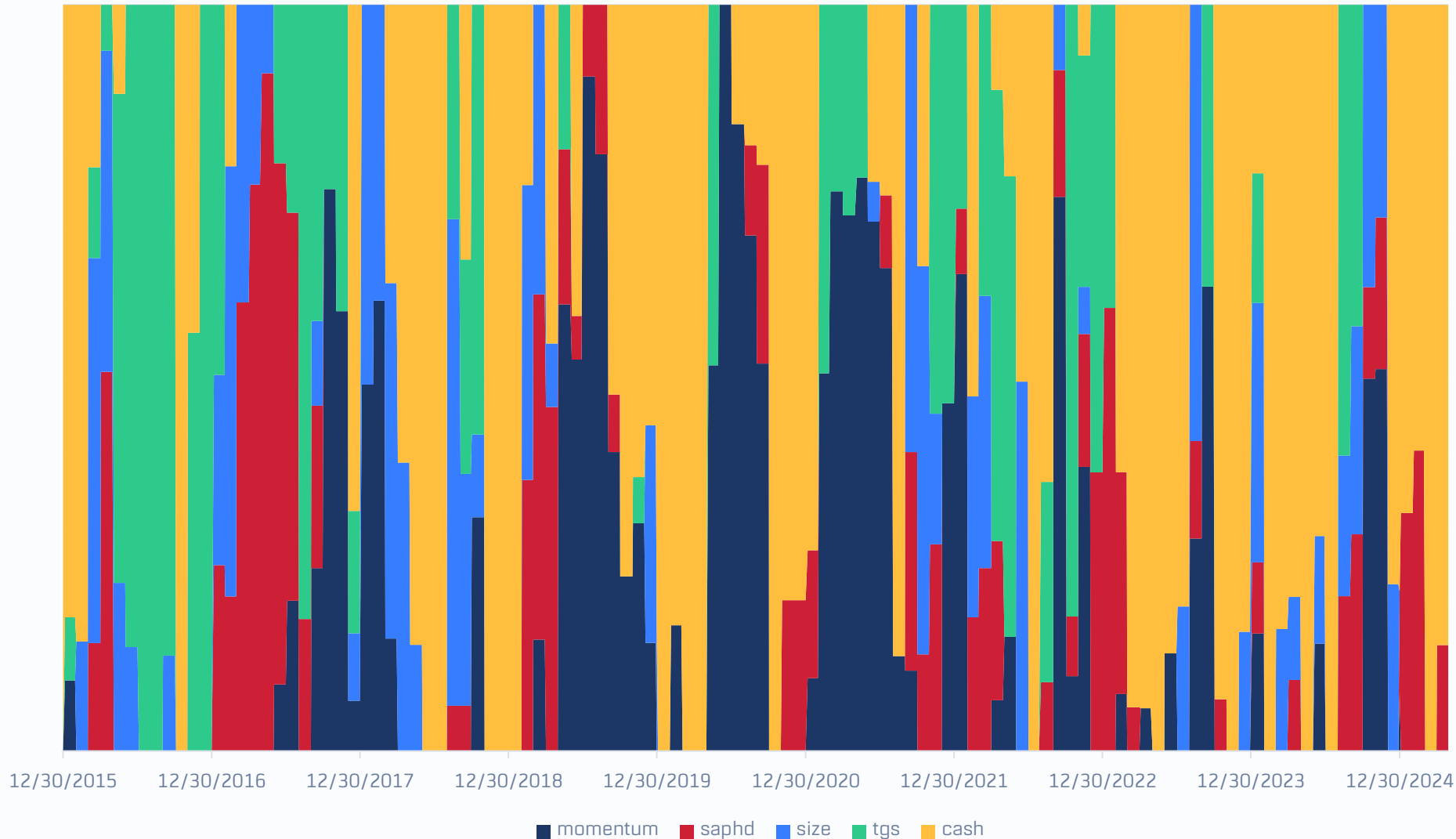


หมายเหตุ

- ข้อมูลผลการทดสอบย้อนหลังของกลยุทธ์ที่ปรับปรุงล่าสุดเมื่อวันที่ 01/07/2025 ซึ่งอยู่ในช่วงเวลา 01/04/2016 – 11/09/2026 (โดยรวมเงินปันผลและได้มีการนำมาลงทุนต่อเนื่อง)
- จำนวนเงินลงทุนที่ต่างกันอาจส่งผลให้ผลตอบแทนจากการลงทุนมีความแตกต่างจากผลการทดสอบย้อนหลังหรือผลการดำเนินงานในอดีต ทั้งนี้ ผลการทดสอบย้อนหลังหรือผลการดำเนินงาน ในอดีต มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลตอบแทนจากการลงทุนในอนาคต



การเปลี่ยนแปลงกลยุทธ์ในแต่ละช่วง

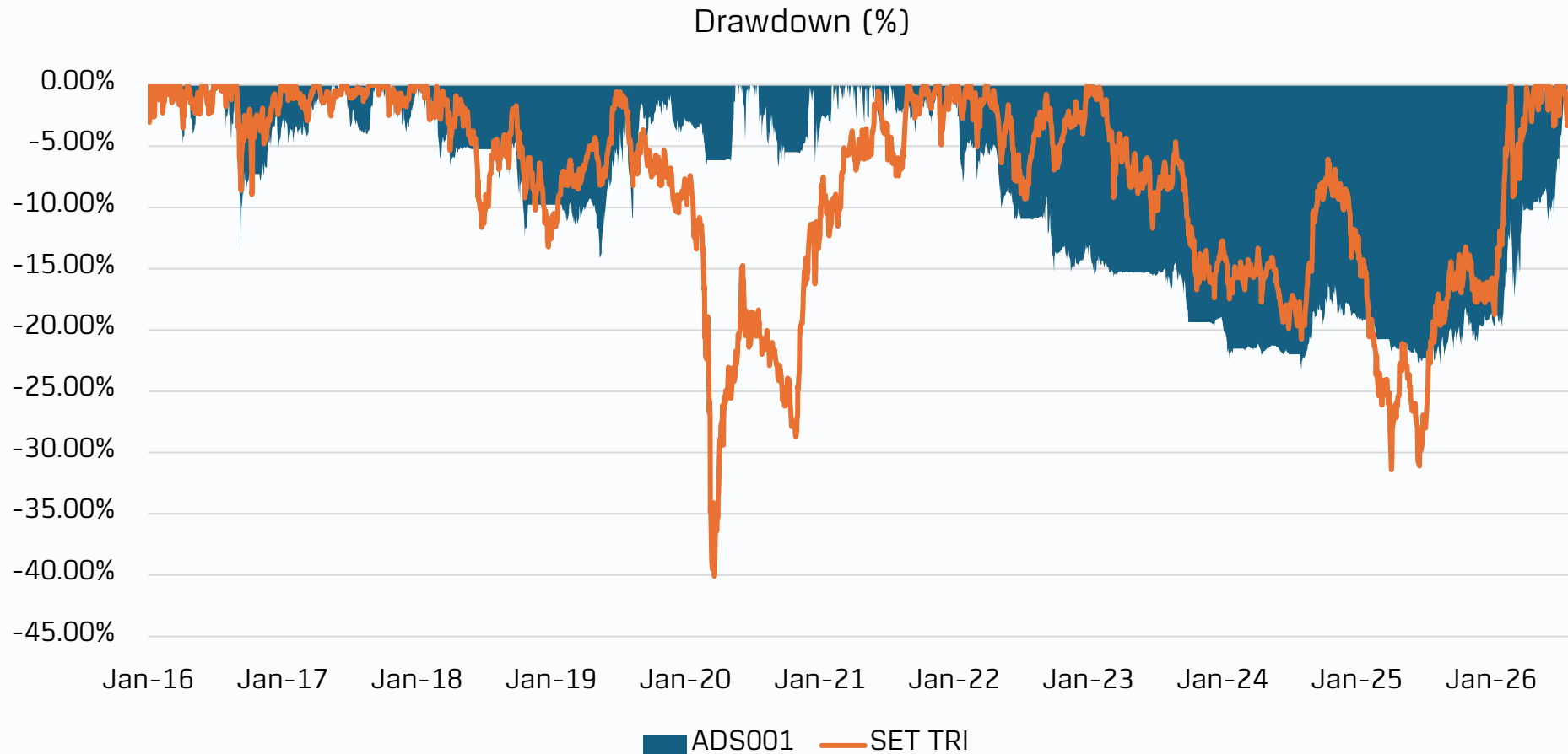


หมายเหตุ

- ข้อมูลผลการทดสอบย้อนหลังของกลยุทธ์ที่ปรับปรุงล่าสุดเมื่อวันที่ 01/07/2025 ซึ่งอยู่ในช่วงเวลา 01/04/2016 – 24/10/2025 (โดยรวมเงินปันผลและได้มีการนำมาลงทุนต่อเนื่อง)
- จำนวนเงินลงทุนที่ต่างกันอาจส่งผลให้ผลตอบแทนจากการลงทุนมีความแตกต่างจากผลการทดสอบย้อนหลัง หรือผลการดำเนินงานในอดีต ทั้งนี้ ผลการทดสอบย้อนหลัง หรือผลการดำเนินงานในอดีต มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลตอบแทนจากการลงทุนในอนาคต



ผลการทดสอบย้อนหลังของกลยุทธ์ ADS 001

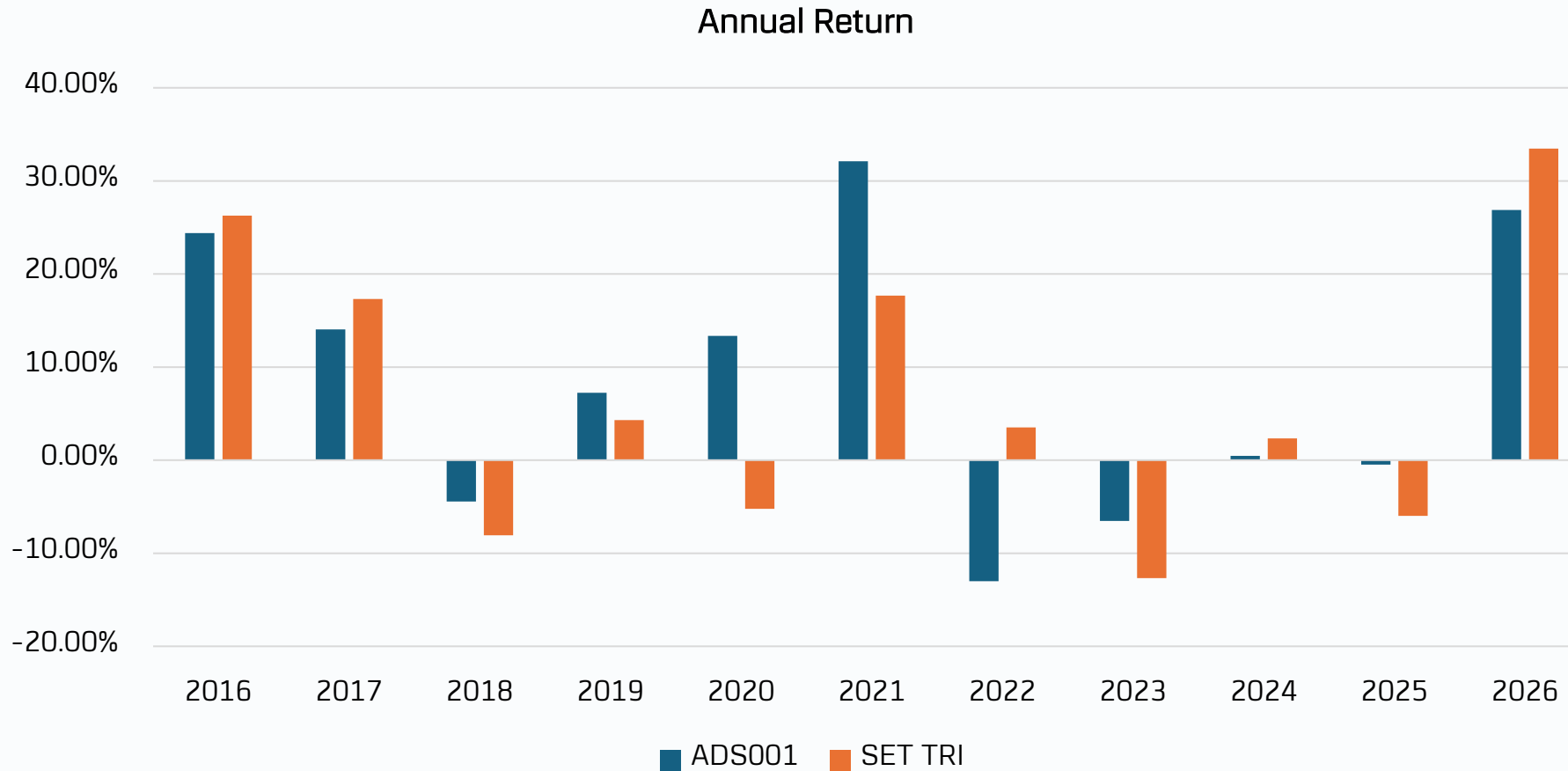


หมายเหตุ

- ข้อมูลผลการทดสอบย้อนหลังของกลยุทธ์ที่ปรับปรุงล่าสุดเมื่อวันที่ 01/07/2025 ซึ่งอยู่ในช่วงเวลา 01/04/2016 - 11/09/2026 (โดยรวมเงินปันผลและได้มีการนำมาลงทุนต่อเนื่อง)
- จำนวนเงินลงทุนที่ต่างกันอาจส่งผลให้ผลตอบแทนจากการลงทุนมีความแตกต่างจากผลการทดสอบย้อนหลัง หรือผลการดำเนินงานในอดีต ทั้งนี้ ผลการทดสอบย้อนหลัง หรือผลการดำเนินงาน ในอดีต มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลตอบแทนจากการลงทุนในอนาคต



ผลการทดสอบย้อนหลังของกลยุทธ์ ADS 001



หมายเหตุ

- ข้อมูลผลการทดสอบย้อนหลังของกลยุทธ์ที่ปรับปรุงล่าสุดเมื่อวันที่ 01/07/2025 ซึ่งอยู่ในช่วงเวลา 01/04/2016 – 11/09/2026 (โดยรวมเงินปันผลและได้มีการนำมาลงทุนต่อเนื่อง)
- จำนวนเงินลงทุนที่ต่างกันอาจส่งผลให้ผลตอบแทนจากการลงทุนมีความแตกต่างจากผลการทดสอบย้อนหลัง หรือผลการดำเนินงานในอดีต ทั้งนี้ ผลการทดสอบย้อนหลัง หรือผลการดำเนินงาน ในอดีต มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลตอบแทนจากการลงทุนในอนาคต



ผลการทดสอบย้อนหลัง ADS 001

	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี*	3 ปี*	5 ปี*
กลยุทธ์	26.88%	15.19%	22.83%	29.25%	6.78%	1.48%
ดัชนีชี้วัด	33.47%	3.65%	17.67%	31.72%	5.91%	3.43%
ความผันผวนของกลยุทธ์	14.07%	11.09%	13.04%	12.67%	8.84%	8.24%
ความผันผวนของดัชนีชี้วัด	18.12%	12.81%	15.01%	16.86%	15.39%	13.76%
Sharpe Ratio กลยุทธ์				2.23	0.58	0.01
Sharpe Ratio ของดัชนี				1.82	0.27	0.15

*หมายเหตุ: ตัวเลขเป็นผลตอบแทนต่อปี



กลยุทธ์นี้เหมาะกับนักลงทุนแบบใด



ยอมรับความเสี่ยงระดับสูงจากการลงทุนในหุ้นได้



ต้องการพอร์ตที่ผันผวนน้อยกว่าตลาดและเข้าใจว่าในบางช่วงผลตอบแทนอาจต่ำกว่าดัชนี



ต้องการลงทุนระยะกลางถึงระยะยาวและคาดหวังผลตอบแทนที่มากกว่าตลาดในระยะยาว



นักลงทุนที่ต้องการระบบที่ช่วยหาโอกาสในการลงทุนอย่างสม่ำเสมอ



นักลงทุนที่ไม่มีเวลาวิเคราะห์การลงทุน



แนวทางบริหารจัดการกรณีพิเศษ

1. กรณีประชุมผู้ถือหุ้น (XM)

บริษัทไม่ได้รับมอบหมายให้เข้าร่วมประชุมและใช้สิทธิออกเสียง (Proxy Voting) แทนท่าน

2. กรณีเพิ่มทุน (XR)

ระบบจะตัดหลักทรัพย์ดังกล่าวออกจากรายชื่อที่ซื้อขายเป็นการชั่วคราว จนกว่าจะพ้นระยะเวลาการรับสิทธิ และจะไม่ใช้สิทธิจองซื้อหุ้นเพิ่มทุน

3. กรณีปันผลเป็นเงินสด (XD)

ระบบยังคงซื้อขายหลักทรัพย์ดังกล่าวได้ตามปกติ และเงินปันผลที่ได้รับจะเข้าสู่บัญชีธนาคารที่ท่านผูกไว้กับบัญชีซื้อขายหลักทรัพย์

4. กรณีปันผลเป็นหุ้น (XD(ST))

ระบบจะถือหุ้นต่อไปจนกว่าจะมีการปรับพอร์ตการลงทุน แต่อาจพิจารณาเป็นกรณี

5. กรณีออกใบแสดงสิทธิซื้อหุ้นสามัญ (Warrant) (XW)

ระบบจะขาย warrant โดยไม่รอใช้สิทธิแปลงสภาพ

6. กรณีหุ้นไม่สามารถซื้อขายได้ เช่น ขึ้นเครื่องหมาย SP หรือ NP

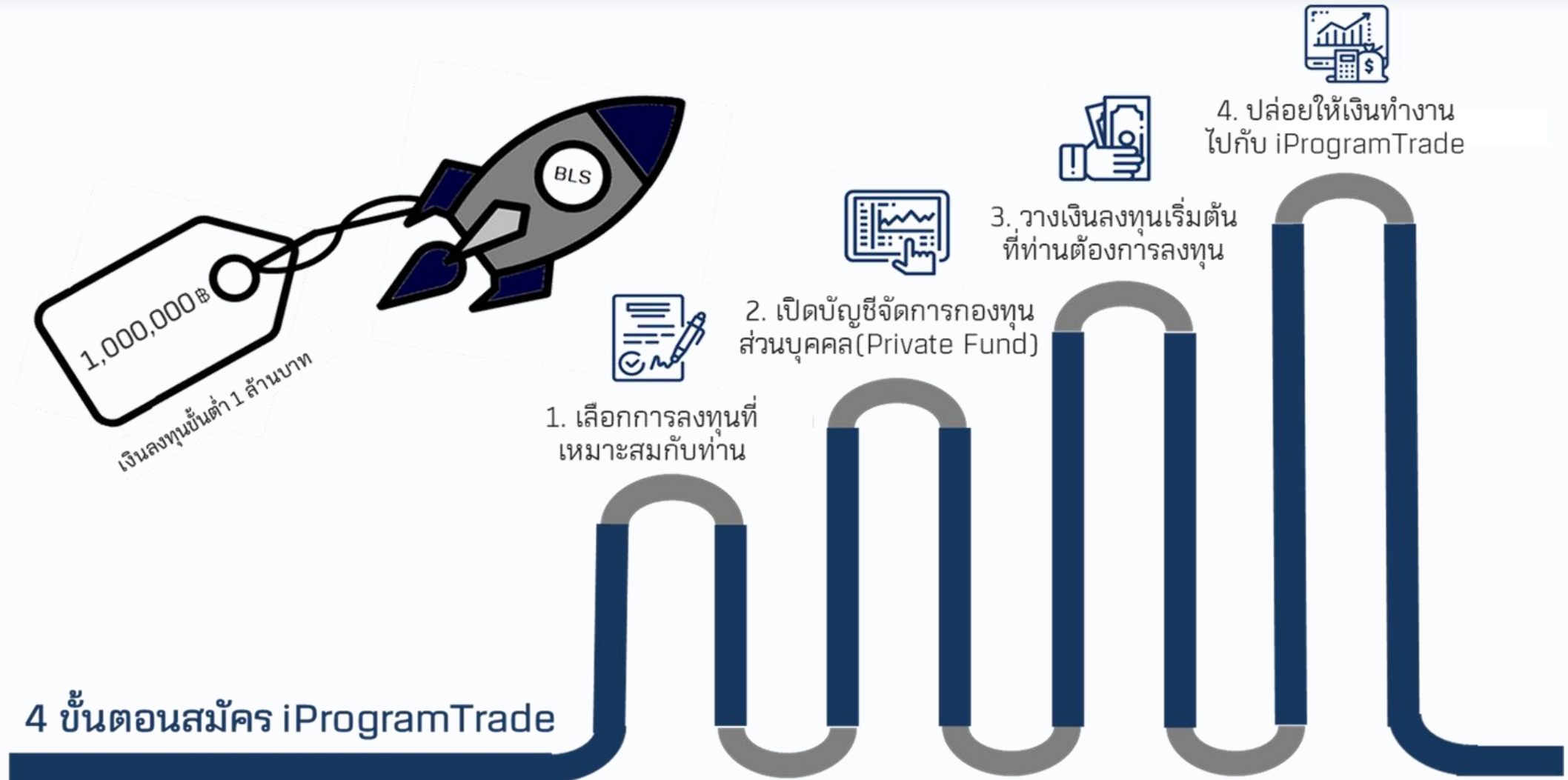
ระบบจะถือหุ้นต่อไปจนกว่าหลักทรัพย์จะกลับมาซื้อขายได้

7. กรณีหุ้นถูกบริษัทขอซื้อคืนทั้งหมด (Tender Offer)

หากราคาที่เสนอซื้อสูงกว่าราคาตลาด บริษัทจะใช้สิทธิขายหุ้นทั้งหมด แต่หากราคาที่เสนอซื้อต่ำกว่าราคาตลาดจะพิจารณาเป็นกรณี



เริ่มต้นลงทุนกับบริการ...Bualuang iProgramTrade



ค่าธรรมเนียมสำหรับกลยุทธ์ ADS 001 :

1. ค่าธรรมเนียมนายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ ในอัตราร้อยละ 0.30 ของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์



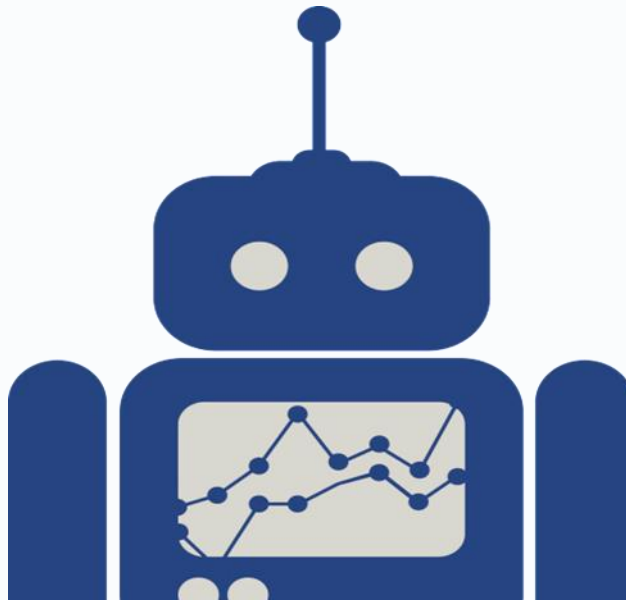
CONTACT US

ฝ่ายที่ปรึกษาการลงทุน

กิจการค้าหลักทรัพย์

TEL: 02-618-1111

EMAIL: blsprivatefundautoinvesting@bualuang.co.th





Bualuang Securities Disclaimer

เอกสารฉบับนี้จัดทำขึ้นเพื่อใช้นำเสนอเฉพาะลูกค้าของบริษัทหลักทรัพย์ บัวหลวง จำกัด (มหาชน) (“บริษัท”) เท่านั้น ไม่สามารถนำไปใช้กับบุคคลอื่น หรือเผยแพร่สู่สาธารณะ รวมทั้งไม่สามารถทำซ้ำ ดัดแปลง คัดลอก นำไปใช้ หรือแจกจ่าย หากยังมิได้รับอนุญาตเป็นลายลักษณ์อักษรจากบริษัท ข้อมูลที่ปรากฏในเอกสารฉบับนี้จัดทำขึ้นบนพื้นฐานที่บริษัทมีความเห็นว่ามัน่าเชื่อถือและได้ผ่านการพิจารณาอย่างรอบคอบในขณะที่จัดทำ แต่ทั้งนี้ อาจมีการแก้ไข ปรับปรุง หรือเปลี่ยนแปลงได้โดยไม่ต้องแจ้งให้ทราบล่วงหน้า ทั้งนี้ บริษัทมิได้รับประกันถึงความถูกต้องหรือความครบถ้วนสมบูรณ์ของข้อมูล และมิได้รับประกันราคาหรือผลตอบแทนจากการลงทุนใดๆ ทั้งสิ้น ข้อมูลตัวเลขที่นำเสนอในเอกสารฉบับนี้อาจมีการคาดการณ์จากข้อมูลในปัจจุบัน และแนวโน้มของอดีต ซึ่งการคาดการณ์ใดๆ อาจมีความเสี่ยงและความไม่แน่นอน บริษัทไม่รับผิดชอบต่อผลที่เกิดขึ้นทั้งในปัจจุบัน หรืออนาคต บริษัทได้จัดทำเอกสารฉบับนี้เพื่อประโยชน์ในการใช้เป็นข้อมูลประกอบการตัดสินใจในการลงทุนของผู้ลงทุนเท่านั้น มิได้มีวัตถุประสงค์เพื่อที่จะชักชวนหรือชี้นำการซื้อขายหลักทรัพย์ใดโดยเฉพาะหรือเป็นการทั่วไปแต่อย่างใด ผู้ลงทุนพึงใช้ข้อมูลในเอกสารฉบับนี้ประกอบข้อมูลและความเห็นอื่นๆ รวมถึงใช้วิจารณญาณของผู้ลงทุนเองในการตัดสินใจลงทุนในแต่ละกรณี ทั้งนี้ บริษัทไม่ต้องรับผิดชอบต่อความเสียหายใดๆ ที่เกิดขึ้นโดยตรงหรือโดยอ้อม อันเป็นผลจากการใช้เนื้อหาในเอกสารฉบับนี้ การนำไปใช้ซึ่งข้อมูลการวิเคราะห์ และการคาดหมายทั้งหลายที่ปรากฏ ถือเป็นการยอมรับความเสี่ยงของผู้ใช้ข้อมูลแต่เพียงผู้เดียว

การลงทุนในหลักทรัพย์มิใช่การฝากเงินและความเสี่ยง ผู้ลงทุนอาจได้รับกำไร หรืออาจมีผลขาดทุนเกิดขึ้นได้ นอกจากนี้ ผลการดำเนินงานในอดีต/ผลการเปรียบเทียบผลการดำเนินงานที่เกี่ยวข้องกับผลิตภัณฑ์ในตลาดทุน มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

ผู้ลงทุนโปรดทำความเข้าใจลักษณะสินค้า เงื่อนไขผลตอบแทนและความเสี่ยงก่อนการตัดสินใจลงทุน