

# Strategy

## Absolute 4D

FINTECH (THAILAND) COMPANY LIMITED  
เลขที่ 1-7 อาคารซิลลิคเฮ้าส์ ชั้น 6 ถนนสีลม แขวงสีลม  
เขตบางรัก กรุงเทพฯ 10500  
6th Floor, Zuellig House Building, 1-7 Silom Road,  
Silom, Bangrak, Bangkok 10500, Thailand  
Tel. +662 107 1664  
email: admin@fintech.co.th

[www.fintech.co.th](http://www.fintech.co.th)

Mar 11, 2018



## Absolute 4D

กลยุทธ์ที่เติบโตไปพร้อมกับตลาด เน้นการถือหุ้น (Buy-and-Hold) โดยการคัดเลือกหุ้นที่มีศักยภาพในด้านต่างๆ ทั้ง 4 ด้าน ได้แก่ Fundamental, Valuation, Momentum และ Risk เพื่อเพิ่มหาหุ้นที่มีความแข็งแกร่งสูงสุดทั้ง 4 ด้าน โดยที่โมเดลนี้จะเลือกลงทุนหุ้นที่มีคะแนนโดยรวมสูงสุด 10 อันดับแรก และจะขายหุ้นเพื่อไปลงทุนหุ้นตัวที่มีศักยภาพที่ดีกว่าเมื่ออันดับมีการเปลี่ยนแปลง

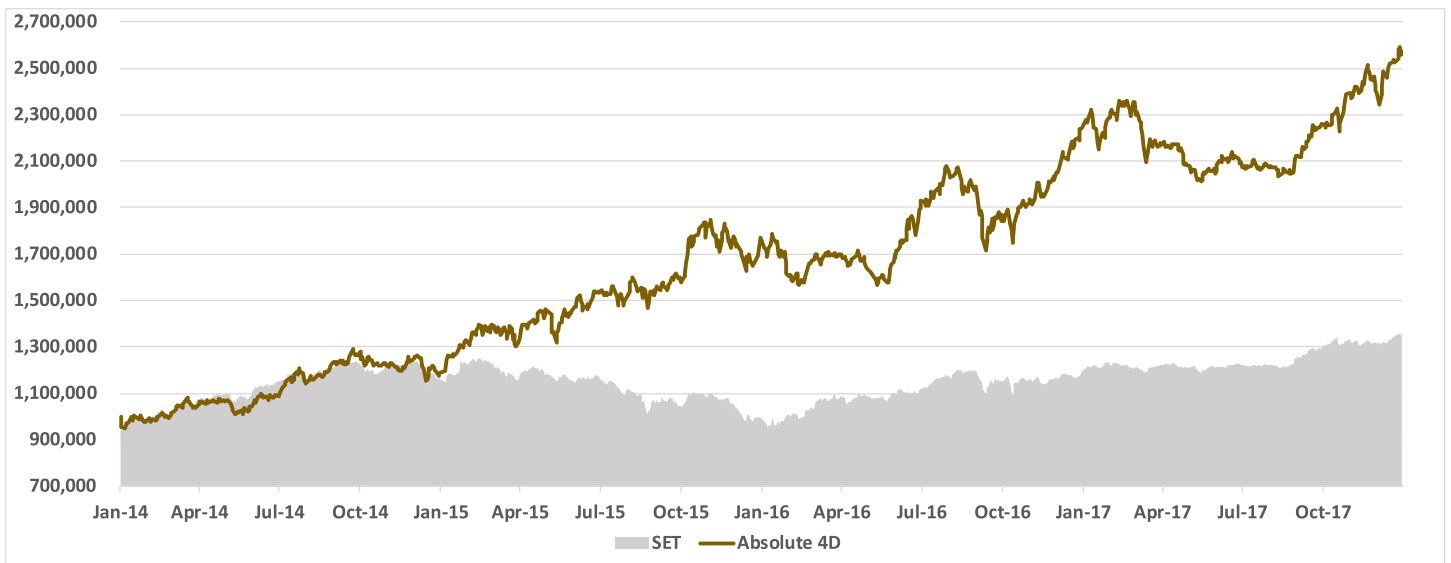
<b>Universe</b>	SET, mai
<b>Concept</b>	Focus on good momentum, strong fundamental, under value and low risk
<b>Buy Signal</b>	In top 10 rank
<b>Sell Signal</b>	Rank dropped
<b>Liquidity Screener</b>	Sufficient trading value
<b>Risk Management</b>	Diversification
<b>Protection</b>	None

	Since Inception	SET
<b>CAGR</b>	26.68%	7.94%
<b>Standard Deviation</b>	19.18%	12.03%
<b>MaxDD</b>	17.65%	24.20%
<b>CAGR/MaxDD</b>	1.5114	0.3282
<b>Sharpe Ratio</b>	1.3123	0.5357
<b>%Win</b>	42.73%	-
<b>Average Gain</b>	16.37%	-
<b>Average Loss</b>	5.10%	-
<b>Average Holding Period</b>	35 Days	-

Absolute 4D Performance (Jan 2014 - Dec 2017)

	Jan	Feb	Mar	Apr	May	Jun	Jul	Aug	Sep	Oct	Nov	Dec	YTD
<b>2014</b>													
Absolute 4D	-1.74%	3.07%	3.82%	1.50%	-2.23%	4.03%	5.17%	7.05%	4.29%	-3.96%	1.23%	-4.16%	18.75%
SET	-1.35%	4.01%	3.84%	2.81%	0.06%	4.95%	1.12%	3.94%	1.54%	-0.10%	0.62%	-6.04%	15.94%
<b>2015</b>													
Absolute 4D	11.31%	5.45%	-4.43%	9.57%	-0.60%	5.55%	-1.14%	1.87%	3.61%	13.42%	-2.17%	-0.29%	48.87%
SET	5.58%	0.36%	-5.11%	1.38%	-2.01%	0.57%	-4.28%	-4.01%	-2.42%	3.41%	-2.53%	-5.27%	-14.00%
<b>2016</b>													
Absolute 4D	-8.59%	3.76%	1.39%	-3.72%	3.70%	13.84%	7.62%	-4.78%	-6.96%	4.20%	5.92%	10.34%	26.91%
SET	1.01%	2.41%	5.65%	-0.22%	1.40%	1.45%	5.47%	1.60%	-4.21%	0.84%	0.97%	2.17%	19.79%
<b>2017</b>													
Absolute 4D	1.98%	2.91%	-7.84%	-3.84%	-1.90%	1.24%	0.13%	2.38%	6.35%	5.96%	0.45%	7.06%	14.77%
SET	2.23%	-1.13%	1.00%	-0.56%	-0.30%	0.84%	0.09%	2.54%	3.53%	2.88%	-1.39%	3.32%	13.66%

Absolute 4D Performance (Jan 2014 - Dec 2017)



\* รวมค่าคอมมิชชั่น 0.25% แต่ไม่รวมค่าธรรมเนียมอื่นๆ และภาษีมูลค่าเพิ่ม

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.



## ค่าสถิติต่างๆ

<b>CAGR (Compound Annual Growth Rate)</b>	ผลตอบแทนเฉลี่ยต่อปีแบบทบต้น (ยิ่งมากยิ่งดี)
<b>Standard Deviation</b>	ความผันผวนของผลตอบแทน
<b>MaxDD (Maximum Drawdown)</b>	%มูลค่าพอร์ตที่ลดลงมากที่สุดโดยเทียบจากมูลค่าพอร์ตสูงสุดก่อนหน้า (ยิ่งน้อยยิ่งดี)
<b>CAGR/MaxDD</b>	อัตราส่วนความสามารถในการสร้างผลตอบแทนเฉลี่ยต่อปีต่อความเสี่ยงสูงสุดที่อาจเกิดขึ้น (ยิ่งมากยิ่งดี)
<b>Sharpe Ratio</b>	อัตราส่วนของผลตอบแทนส่วนเกินจากการลงทุนในสินทรัพย์ที่ปราศจากความเสี่ยงต่อความผันผวน (ยิ่งมากยิ่งดี)
<b>%Win</b>	โอกาสที่จะกำไรต่อการเทรด 1 ครั้ง
<b>%Loss</b>	โอกาสที่จะขาดทุนต่อการเทรด 1 ครั้ง
<b>Average Gain</b>	ค่าเฉลี่ยของผลกำไรต่อการเทรด 1 ครั้ง
<b>Average Loss</b>	ค่าเฉลี่ยของผลขาดทุนต่อการเทรด 1 ครั้ง
<b>Average Holding Period</b>	จำนวนวันเฉลี่ยในการถือหุ้นแต่ละตัว
<b>NAV (Net Asset Value)</b>	มูลค่าพอร์ต ณ เวลาใดเวลาหนึ่ง
<b>Equity Curve</b>	กราฟแสดงมูลค่าพอร์ตการลงทุนตามช่วงเวลา

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.