

Strategy

Stock on Fire

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

Mar 11, 2018



Stock on Fire

กลยุทธ์การลงทุนประเภท Trend Following สายบู๊ จับจังหวะเข้าซื้อหุ้นที่อยู่ในแนวโน้มขาขึ้นที่แข็งแกร่งในหลายรูปแบบได้อย่างฉับไว และจะขายทำกำไรหุ้นที่เริ่มเปลี่ยนแนวโน้มอย่างมีนัยสำคัญ ผสานด้วยเทคนิค Scaling In/Scaling Out เพื่อให้สามารถทำการซื้อขายได้ในระดับราคาที่เหมาะสม เหมาะสำหรับผู้ที่ต้องการผลตอบแทนที่สูงและสามารถรับความเสี่ยงได้

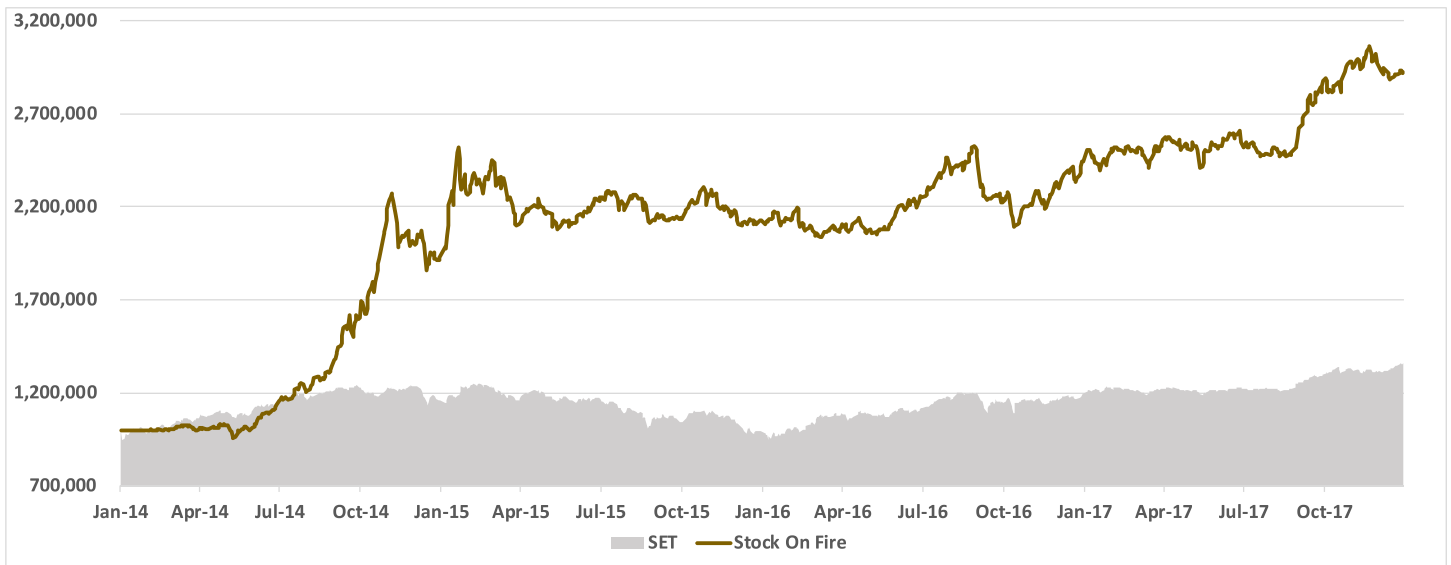
Universe	SET, mai
Concept	Trend following
Buy Signal	Uptrend stocks
Sell Signal	Downtrend stocks
Liquidity Screener	Sufficient trading value
Risk Management	5% port for each signal
Protection	Stop loss

	Since Inception	SET
CAGR	30.78%	7.94%
Standard Deviation	17.83%	12.03%
MaxDD	19.22%	24.20%
CAGR/MaxDD	1.6018	0.3282
Sharpe Ratio	1.6426	0.5357
%Win	42.42%	-
Average Gain	24.36%	-
Average Loss	8.33%	-
Average Holding Period	28 Days	-

Stock on Fire Performance (Jan 2014 - Dec 2017)

	Jan	Feb	Mar	Apr	May	Jun	Jul	Aug	Sep	Oct	Nov	Dec	YTD
2014													
Stock on Fire	-0.21%	0.70%	-0.21%	1.88%	-1.30%	14.65%	3.91%	11.63%	19.37%	36.87%	-7.82%	-4.41%	93.04%
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%
2015													
Stock on Fire	17.21%	8.27%	-13.80%	2.95%	-2.95%	6.55%	-1.08%	-4.10%	0.31%	4.77%	-2.59%	-2.44%	10.35%
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%
2016													
Stock on Fire	0.19%	-3.62%	2.34%	-1.61%	5.01%	3.63%	9.43%	1.62%	-11.16%	-0.47%	5.45%	4.65%	14.80%
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%
2017													
Stock on Fire	1.88%	0.03%	2.66%	-1.65%	0.31%	-0.11%	-1.61%	3.50%	12.16%	3.49%	-0.29%	-1.55%	19.63%
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%

Stock on Fire 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

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