

คู่มือการใช้งาน Smart Portfolio

Smart Portfolio เป็นบริการแนะนำพอร์ตการลงทุนสำเร็จรูปที่โปร่งใส เนื่องจากการเปิดเผยรายละเอียดเกี่ยวกับต้นทุนและวันที่ซื้อ รวมถึงข้อมูลผลตอบแทนที่เกิดขึ้นจริงจากการลงทุนอย่างต่อเนื่อง โดยผู้ลงทุนสามารถเลือกพอร์ตที่เหมาะสมกับสไตล์การลงทุนของตัวเองได้ ปัจจุบัน Smart Portfolio ประกอบด้วย 4 พอร์ต ได้แก่ Dividend, Growth, Quant และ Trading

ลักษณะเด่นของพอร์ต



Dividend Portfolio
Be sure, be dividend

Dividend Portfolio

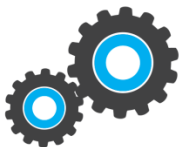
เหมาะกับการลงทุนระยะยาวเพื่อสร้างผลตอบแทนอย่างสม่ำเสมอ เน้นลงทุนในหุ้นที่มีปัจจัยพื้นฐานดีและมีความสามารถในการจ่ายเงินปันผลได้อย่างต่อเนื่อง โดยหุ้นดังกล่าวต้องมีความผันผวนของราคาที่ไม่สูงจนเกินไป



Growth Portfolio
Create opportunity through growth

Growth Portfolio

เหมาะกับการลงทุนระยะยาวเพื่อให้มูลค่าการลงทุนเติบโตขึ้นอย่างต่อเนื่อง เน้นลงทุนในหุ้นที่มีปัจจัยพื้นฐานดีและมีแนวโน้มของการเจริญเติบโตที่แข็งแกร่ง โดยผู้ลงทุนต้องมีความสามารถในการรับความเสี่ยงได้ในระดับสูง



Quant Portfolio
Let quant guides wealth

Quant Portfolio

เหมาะกับผู้ลงทุนที่มีความรู้และประสบการณ์ในการลงทุนมากพอสมควร เน้นลงทุนในหุ้นที่มีโอกาสปรับตัวขึ้นสูงและมีพื้นฐานดีเมื่อวิเคราะห์ตามหลักสถิติประกอบการวิเคราะห์ทางเทคนิค โดยที่พอร์ตจะปรับความเสี่ยงให้เข้ากับสภาวะตลาดในแต่ละช่วง



Trading Portfolio
Play with market trend

Trading Portfolio

เหมาะกับการลงทุนระยะสั้น เน้นลงทุนในหุ้นที่มีปัจจัยพื้นฐานและปัจจัยเทคนิคที่ดี โดยผู้ลงทุนควรมีเวลาติดตามหุ้นในพอร์ตเป็น "ประจำ" สามารถยอมรับความเสี่ยงได้ในระดับสูง และที่สำคัญคือต้องมีวินัยการลงทุน

แนวทางการคัดเลือกหุ้น



Dividend Portfolio
Be sure, be dividend

Dividend Portfolio

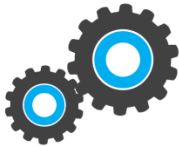
หุ้นที่มี Forward Yield สูงกว่า 4.50% และมี EPS Growth อยู่ในเกณฑ์ดี ประกอบกับระดับราคาปัจจุบันไม่สูงเกินไปเมื่อวัดจาก Forward P/B Ratio โดยจะคัดเลือกเฉพาะหุ้นที่จัดทำทวิเคราะห์ปัจจัยพื้นฐานเท่านั้น และมีการปรับพอร์ตทุกเดือนในช่วงกลางเดือน



Growth Portfolio
Create opportunity through growth

Growth Portfolio

หุ้นที่มีราคาไม่สูงเมื่อเปรียบเทียบกับการเจริญเติบโตในอนาคต โดยวัดจาก PEG Ratio และมีราคาเป้าหมายที่สูงเมื่อเทียบกับราคาปัจจุบัน รวมทั้งมีความเสี่ยงในตลาดของไม่สูงมากนัก โดยจะคัดเลือกเฉพาะหุ้นที่จัดทำทวิเคราะห์ปัจจัยพื้นฐานเท่านั้น และมีการปรับพอร์ตทุกเดือนในช่วงกลางเดือน



Quant Portfolio
Let quant guides wealth

Quant Portfolio

หุ้นที่มีราคาถูกเมื่อวิเคราะห์จากอัตราส่วน EV to EBITDA และ Price to Revenue รวมทั้งมีความน่าจะเป็นสูงในการปรับตัวขึ้นเมื่อวิเคราะห์ด้วยวิธีทางสถิติ โดยจะคัดเลือกเฉพาะหุ้นที่อยู่ใน SET 100 หรือหุ้นที่จัดทำทวิเคราะห์ปัจจัยพื้นฐานเท่านั้น โดยจะมีการปรับพอร์ตทุกเดือนในช่วงปลายเดือน



Trading Portfolio
Play with market trend

Trading Portfolio

หุ้นที่มีปัจจัยบวกสนับสนุนในระยะ 1 เดือน มีปัจจัยพื้นฐานดีและมีสัญญาณซื้อทางเทคนิค โดยหุ้นที่ถูกคัดเลือกเข้าพอร์ตต้องมีค่า Treynor Index สูงเมื่อเทียบกับ SET Index โดยจะคัดเลือกหุ้นทั้งในตลาดหลักทรัพย์ (SET) และตลาดหลักทรัพย์ใหม่ (MAI) และมีการปรับพอร์ตตามจุดทำกำไรหรือจุดตัดขาดทุนตามที่ระบุไว้ หรือมีการปรับพอร์ตเมื่อปัจจัยพื้นฐานหรือแนวโน้มทางเทคนิคเปลี่ยนแปลงอย่างรวดเร็ว

คำอธิบายสำหรับการใช้งานพอร์ต Dividend, Growth และ Quant

Dividend Portfolio		Last Rebalance 15-Mar-13 09:00 Price Update 21-Mar-13 15:44							
Stock	Market Price	Cost Price	Unrealized Profit	Initial Buy Date	Target Price	Upside	Forward Yield	Weight	
▲ BCP	34.00	36.93	-7.93%	15-Mar-13	38.00	11.76%	3.92%	13.10%	
▲ MSC	5.40	5.73	-5.72%	15-Feb-13	7.45	37.96%	6.44%	14.23%	
● PTT	335.00	318.29	5.25%	16-Oct-12	394.00	17.61%	3.92%	15.54%	
● PTTEP	146.50	152.25	-3.78%	15-Mar-13	170.00	16.04%	4.36%	13.60%	
● TOG	3.74	3.63	3.14%	16-Jan-13	4.20	12.30%	6.19%	14.53%	
● TOP	66.50	68.81	-3.36%	15-Mar-13	82.00	23.31%	4.86%	13.65%	
● VNT	18.60	19.02	-2.23%	16-Jan-13	20.50	10.22%	5.34%	15.34%	
Total			-1.89%			18.40%	5.01%	100.00%	

Historical Returns

Portfolio	1 Month	3 Month	6 Month	12 Month	Since Inception	Inception Date
Dividend Portfolio	-3.45%	17.53%	39.42%		75.52%	
SET Total Return	1.37%	13.50%	21.85%	33.00%	35.49%	16-May-12

Stock:

รายชื่อหุ้นที่แนะนำ โดยที่

- หมายถึงคำแนะนำซื้อ เนื่องจาก Upside สูงกว่า 5.00% ขึ้นไป หลังบวกด้วยเงินปันผลคาดหวังในอนาคต
- ▲ หมายถึงคำแนะนำระมัดระวังการซื้อขาย เนื่องจากขาดทุนมากกว่า 5.00% หรือ Upside ต่ำกว่า 5.00% หลังบวกด้วยเงินปันผลคาดหวังในอนาคต
- ◆ หมายถึงคำแนะนำรอขายออกจากพอร์ต เนื่องจากไม่มี Upside เหลืออยู่เลย แม้จะบวกด้วยเงินปันผลคาดหวังในอนาคตไปแล้วก็ตาม

Market Price:

ราคาตลาดล่าสุด Update ทุก 15 นาที

Cost Price:

ราคาต้นทุน ซึ่งอ้างอิงจากราคาซื้อขายเฉลี่ยของวันที่ปรับพอร์ตการลงทุน

Unrealized Profit:

กำไรที่คำนวณจากเปอร์เซ็นต์ส่วนต่างระหว่าง Market Price กับ Cost Price

Initial Buy Date:

วันแรกของการแนะนำซื้อหุ้นตัวนั้นๆ เข้าพอร์ต

Target Price:

มูลค่าเหมาะสมทางด้านปัจจัยพื้นฐานที่ Yuanta ประเมิน*

Upside:

เปอร์เซ็นต์ส่วนต่างระหว่าง Target Price และ Market Price

Forward Yield:

เงินปันผลคาดหวัง ประเมินโดยนักวิเคราะห์ปัจจัยพื้นฐานของ Yuanta

Weight:

น้ำหนักการลงทุนตามมูลค่าปัจจุบันของหุ้นแต่ละตัวในพอร์ตลงทุน

* สำหรับหุ้นในพอร์ต Quant ที่ Yuanta ไม่มีการจัดทำบทวิเคราะห์ปัจจัยพื้นฐาน จะใช้ราคาจาก Consensus หรือราคา เป้าหมายทางเทคนิคแทน

คำอธิบายสำหรับการใช้งานพอร์ต Trading



Trading Portfolio
Play with market trend

Last Rebalance 11-Mar-13 09:00

Price Update 21-Mar-13 15:44

Stock	Market Price	Cost Price	Unrealized Profit	Initial Buy Date	Stop Loss	Relative Level	Take Profit	Weight (%)
BKI	385.00	371.60	3.61%	11-Feb-13	340.10		429.60	25.57%
MINT	23.70	23.77	-0.28%	11-Feb-13	21.95		27.72	16.47%
JAS	6.50	6.20	4.84%	11-Feb-13	5.85		7.44	7.90%
SC	30.00	32.44	-7.52%	11-Feb-13	29.93		37.80	11.96%
AMATA	25.50	26.51	-3.80%	4-Mar-13	24.70		32.00	6.02%
SPCG	29.00	33.75	-14.07%	11-Mar-13	31.50		40.00	10.05%
TTCL	38.50	37.50	2.67%	11-Feb-13	35.86		45.30	22.03%
Total			-0.70%					100.00%

Historical Returns

Portfolio	1 Month	3 Month	6 Month	12 Month	Since Inception	Inception Date
Trading Portfolio	0.10%	20.13%	31.01%	51.82%	290.90%	
SET Index	0.26%	11.84%	19.41%	27.19%	103.93%	29-Apr-10

Stock:

รายชื่อหุ้นที่แนะนำ โดยที่

- หมายถึงคำแนะนำซื้อ เนื่องจากจุด Take Profit อยู่สูงกว่า Market Price 5.00% ขึ้นไป
- ▲ หมายถึงคำแนะนำระมัดระวังการซื้อขาย เนื่องจากจุด Take Profit อยู่สูงกว่า Market Price ไม่ถึง 5.00%
- ◆ หมายถึงคำแนะนำขายออกจากพอร์ต เนื่องจาก Market Price อยู่สูงกว่าจุด Take Profit หรืออยู่ต่ำกว่าจุด Stop Loss

Market Price:

ราคาตลาดล่าสุด Update ทุก 15 นาที

Cost Price:

ราคาต้นทุน ซึ่งอ้างอิงจากราคาเปิดของวันที่ปรับพอร์ตการลงทุน

Unrealized Profit:

กำไรที่คำนวณจากเปอร์เซ็นต์ส่วนต่างระหว่าง Market Price กับ Cost Price

Initial Buy Date:

วันแรกของการแนะนำซื้อหุ้นตัวนั้นๆ เข้าพอร์ต

Stop Loss:

ราคาที่ใช้เป็นจุดตัดขาดทุน

Take Profit:

ราคาที่ใช้เป็นจุดทำกำไร

Relative Level:

ระดับราคาล่าสุดเปรียบเทียบกับจุด Stop Loss และ Take Profit ตัวอย่างเช่น

35.86 38.00 Relative Level สัมผัสจุดทำกำไร ดังนั้นแนะนำขายทำกำไร

29.93 37.80 Relative Level สัมผัสจุดตัดขาดทุน ดังนั้นแนะนำตัดขาดทุน

Weight:

น้ำหนักการลงทุนตามมูลค่าปัจจุบันของหุ้นแต่ละตัวในพอร์ตลงทุน