

สร้างพอร์ตให้กำไรด้วย เครื่องมือช่วยเทรด TFEX

โดย

- เดชธนา ฟางสะอาด ผู้ช่วยกรรมการผู้จัดการ บริษัทหลักทรัพย์ พาย จำกัด (มหาชน)
- จิระเดช คุณากาญจน์ ประธานเจ้าหน้าที่บริหาร บริษัท ท้อปเทรดเดอร์ จำกัด

TFEX Station – Special Workshop เสริมพอร์ตลงทุน เพิ่มโอกาสกำไรด้วย TFEX

วันเสาร์ที่ 29 มิถุนายน 2567

pi

การกระจายความเสี่ยง

การกระจายความเสี่ยงเป็นกลยุทธ์การบริหารความเสี่ยง
ที่สร้างจาก*การผสมผสานการลงทุนที่หลากหลาย*
โดยประกอบด้วยสินทรัพย์ประเภทต่าง ๆ และ/หรือ
กลยุทธ์การลงทุนที่แตกต่างกัน
เพื่อพยายามทำให้ได้*ผลตอบแทนที่ดี บนความเสี่ยงที่*
ลดลงเหมาะสม



pi

ข้อดี/ประโยชน์

ของการกระจายความเสี่ยง



- ลดความเสี่ยงของพอร์ตการลงทุน
- ป้องกันความเสี่ยงจากความผันผวนของตลาด
- ให้ผลตอบแทนที่ดีในระยะยาว

pi

ข้อจำกัด/ควรระวัง ของการกระจายความเสี่ยง

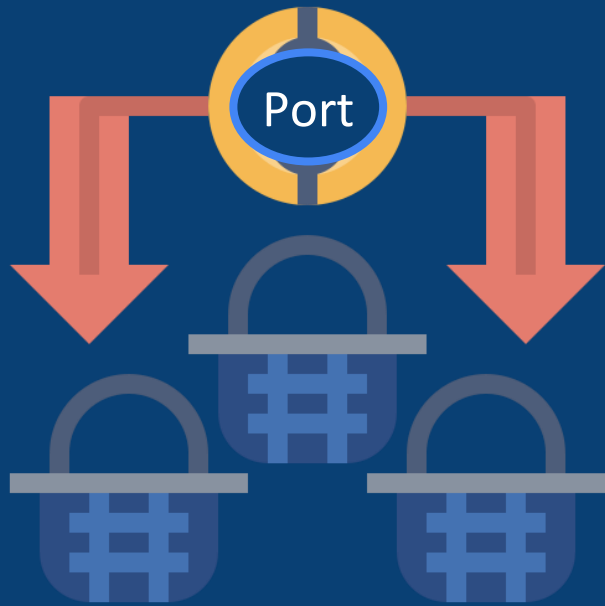


- กำไร/ผลตอบแทนบางช่วงเวลาอาจจะลดลงได้ เมื่อเทียบกับการไม่กระจายความเสี่ยง
- อาจใช้ระยะเวลาในการบริหารจัดการกว่าที่จะเห็นผล
- อาจมีค่าใช้จ่าย ค่าธรรมเนียม ในการดำเนินการมากกว่าปกติ
- อาจจะยาก และซับซ้อนสำหรับนักลงทุนมือใหม่

pi

คำแนะนำ

การกระจายความเสี่ยง



- อย่าวางไข่ทั้งหมดไว้ในตระกร้าใบเดียว
หาสินทรัพย์ให้หลากหลาย สินทรัพย์ที่ไม่มีวันเป็นศูนย์
มีความยั่งยืน
- กลยุทธ์ REBALANCING ผสมกับเทคนิคการลงทุน
ต่าง ๆ จะช่วยให้มีประสิทธิภาพมากขึ้น
แบ่งสินทรัพย์ จัดสัดส่วนให้เหมาะสม



ตัวอย่างการคำนวณน้ำหนักพอร์ตแต่ละสินค้าในพอร์ตที่กระจายการลงทุน

Algo Trading | New Order | ↑↓ 00 📈 🔍 📊 🔗 📌 🔍 📏 ⚙️ | M1 M5 M15 M30 H1 H4 D1 W1 MN 🔍 📶

Time Start

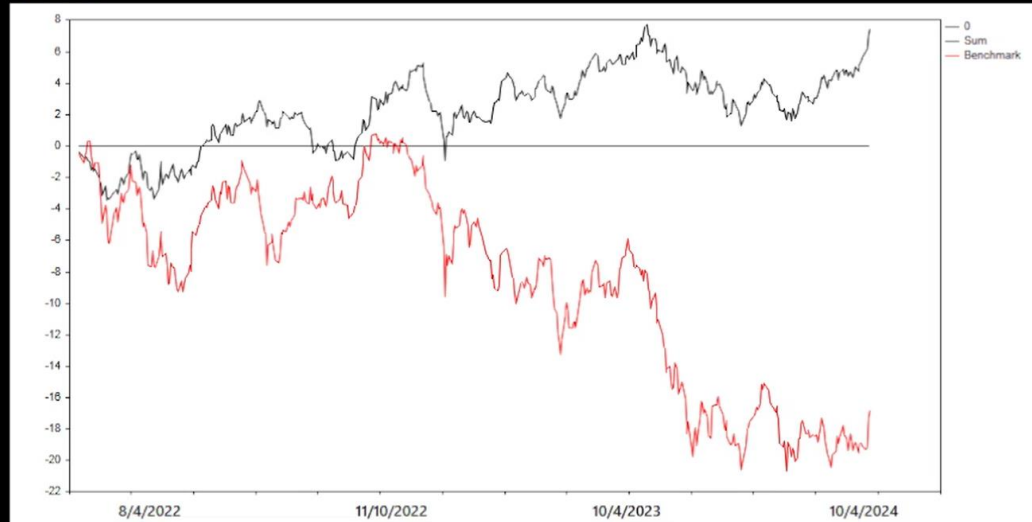
Time Stop

-

Equity Chart ⌵

Risk Parity ⌵

Growth (%)



Symbol Lis

Favorite 1 ⌵ : Add Symbol Reset Symbol

Symbol	Last	Return (Y)	Risk (Y)	Select	Custom	My Port	Risk Parity	
GOF_CON	2359.5	16.01 %	12.33 %	0.00	0.00	0.00	21.13	Delete
USDF_CON	36.42	3.54 %	8.79 %	0.00	0.00	0.00	28.50	Delete
AOT	66.75	1.74 %	16.49 %	0.00	0.00	0.00	10.13	Delete
ADVANC	202.00	-3.91 %	16.62 %	0.00	0.00	0.00	10.78	Delete
BBL	145.50	3.68 %	17.08 %	0.00	0.00	0.00	11.12	Delete
CPALL	57.00	-6.24 %	20.44 %	0.00	0.00	0.00	8.64	Delete
PTT	34.75	-1.90 %	18.12 %	0.00	0.00	0.00	9.80	Delete
<input checked="" type="checkbox"/>								Delete
<input checked="" type="checkbox"/>								Delete
<input checked="" type="checkbox"/>								Delete
				0.00	0.00	0.00	100.10	

	Select	Custom	My Port	Risk Parity	Benchmark
Daily Port Return	0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.02 %	-0.03 %
Daily Port Risk	0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.41 %	0.70 %
Annual Port Return	0.00 %	0.00 %	0.00 %	3.84 %	-8.70 %
Annual Port Risk	0.00 %	0.00 %	0.00 %	6.56 %	11.18 %
Annual Port Sharpe R	0.00	0.00	0.00	0.58	-0.78

0.00 **0.00** **0.00** **100.10**
Reset

pi

THANK YOU