

InnovestX CANSLIM

โอกาสสร้างผลตอบแทนชนะตลาดหุ้นไทยอย่างยั่งยืน



InnovestX CANSLIM Strategy

- กลยุทธ์ลงทุนหุ้นไทยรายเดือน คัดหุ้น 5 บริษัทที่มีแนวโน้มเติบโต โดยได้แรงบันดาลใจมาจากแนวคิด CANSLIM
- InnovestX ได้พัฒนาต่อยอด ผสมผสานเทคนิคการลงทุนเชิงปริมาณ (Quantitative Investment) และ การลงทุนเชิงปัจจัย (Factor Investing) เพื่อสร้างระบบการลงทุนที่แข็งแกร่ง โดยมีเป้าหมายสร้างผลตอบแทนชนะตลาดได้อย่างยั่งยืน



What is CANSLIM?

วิธีการคัดเลือกหุ้นโดย William J. O'Neil

- นักลงทุนชาวอเมริกันผู้เชื่อว่าการวิเคราะห์ข้อมูลคือ กุญแจสำคัญสู่ความสำเร็จในการลงทุน
- จากการศึกษาและวิจัย พบว่า หุ้นที่ให้ผลตอบแทนโดดเด่นมักมีปัจจัยร่วมบางอย่าง
- O'Neil ได้นำปัจจัยเหล่านั้นมาทำเป็นระบบในการคัดเลือกหุ้นที่มีแนวโน้มจะให้ผลตอบแทนสูง ประกอบด้วย 7 ประการ ตามตัวอักษร "CANSLIM"

"CANSLIM is a bullish formula for determining which stocks are likely to grow."

William J. O'Neil



ปัจจัยการคัดเลือกหุ้น 7 ประการ ของ CANSLIM

C – Current Quarterly Earnings

เลือกหุ้นจากบริษัทที่มีกำไรในไตรมาสปัจจุบันเพิ่มขึ้นเมื่อเทียบกับปีก่อนหน้า

A – Annual Earnings Growth

เลือกหุ้นจากบริษัทที่มีกำไรประจำปีเพิ่มขึ้นอย่างมีเสถียรภาพ

N – New Products, Management, Positive Events

หุ้นที่ดีมักมีเรื่องราวใหม่ๆ เช่น สินค้าใหม่ ผู้บริหาร

S – Supply and Demand

มองหาหุ้นที่มีปริมาณการซื้อขายสูงเมื่อเทียบกับจำนวนหุ้นที่มีในตลาด (free float)

L – Leader or Laggard

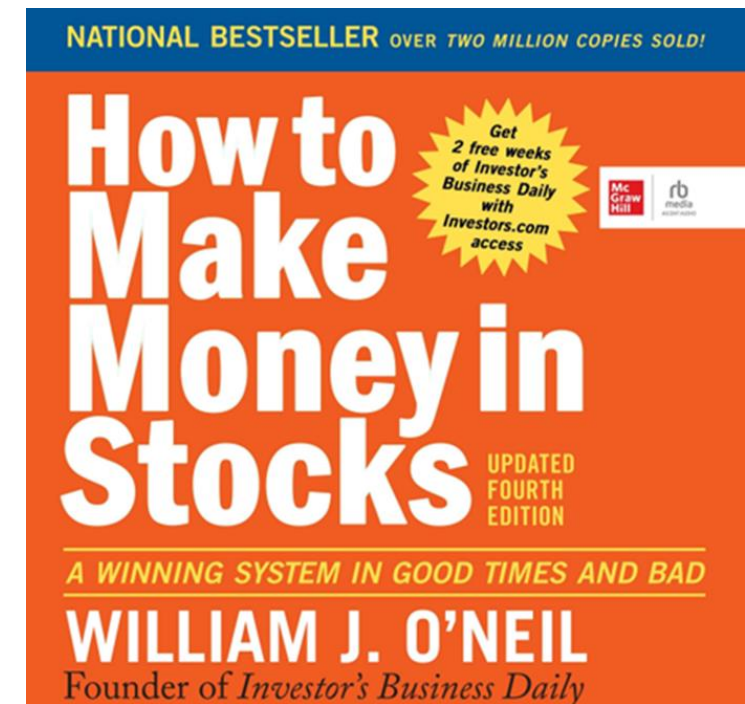
มองหาหุ้นที่เป็นผู้นำอุตสาหกรรมหรือตลาด

I – Institutional Sponsorship

การเลือกหุ้นจากบริษัทที่มีนักลงทุนสถาบันถือครอง

M – Market Direction

ภาวะตลาดโดยรวมควรเป็นขาขึ้น เพื่อช่วยส่งแรงผลักดันให้ราคาหุ้นสูงขึ้นตาม



CANSLIM ของ InnovestX

เราได้นำหลักการ CANSLIM มาพัฒนาและประยุกต์ให้ทันสมัยเหมาะสมกับการลงทุนในปัจจุบัน โดยการผสานศาสตร์และศิลป์ของ **การลงทุนเชิงปริมาณ (Quantitative Investment)** และ **การลงทุนแบบปัจจัย (Factor Investing)** เพื่อสร้างระบบการลงทุนที่แข็งแกร่ง สามารถสร้างผลตอบแทนเหนือตลาดได้ ในแบบฉบับของ InnovestX โดยเฉพาะ

CANSLIM

- C – Current Quarterly Earnings
- A – Annual Earnings Growth
- N – New Products, Management
- S – Supply and Demand
- L – Leader or Laggard
- I – Institutional Sponsorship
- M – Market Direction



InnovestX

พัฒนากลยุทธ์ โดยประยุกต์หลักการ CANSLIM ร่วมกับปัจจัยการลงทุน 3 ประเภท

1. Momentum
2. Growth
3. Liquidity



InnovestX CANSLIM



กลยุทธ์นี้เหมาะกับใคร?

- มองหาพอร์ตการลงทุนที่เน้นหุ้นมีแนวโน้มเติบโตแข็งแกร่ง
- ไม่มีเวลาเฝ้าตลาดทำการบ้านด้วยตนเอง โดยปรับพอร์ตเพียงเดือนละครั้ง
- คาดหวังผลตอบแทนชนะตลาดในระยะยาว (อย่างน้อย 1 ปี)
- สามารถรับความเสี่ยงซึ่งเกิดจากความผันผวนของราคาในระยะสั้นได้

วิธีการลงทุน

- ทุกวันทำการแรกของเดือน ติดตามรายชื่อหุ้น 5 บริษัท ผ่านพีเจอาร์ Wealth Idea ในกล่อง CANSLIM
- กระจายเงินลงทุนในหุ้น 5 บริษัท ด้วยสัดส่วนที่เท่ากัน (Equal-weight)
- ถือหุ้นครบ 1 เดือน จนถึงวันทำการแรกของเดือนถัดไป
 - เปรียบเทียบรายชื่อหุ้นชุดใหม่กับรายชื่อหุ้นชุดเดิม
 - หากมีหุ้นเดิมอยู่ในรายชื่อชุดใหม่ ให้ถือหุ้นนั้นต่อ
 - หากมีหุ้นเดิมที่ถูกถอดออกจากรายชื่อชุดใหม่ ให้ขายแล้วนำไปลงทุนในหุ้นตัวใหม่
- ทั้งนี้ ลูกค้ายาจพิจารณา Rebalance Portfolio เป็นครั้งคราว เพื่อให้หุ้นแต่ละบริษัทมีสัดส่วนกลับมาใกล้เคียงกัน

รายชื่อหุ้น InnovestX CANSLIM ประจำเดือน สิงหาคม 2024

NSL FOODS

The Happy Taste Creator

บริษัท เอ็นเอสแอล ฟู้ดส์ จำกัด (มหาชน)

Quote: **NSL**

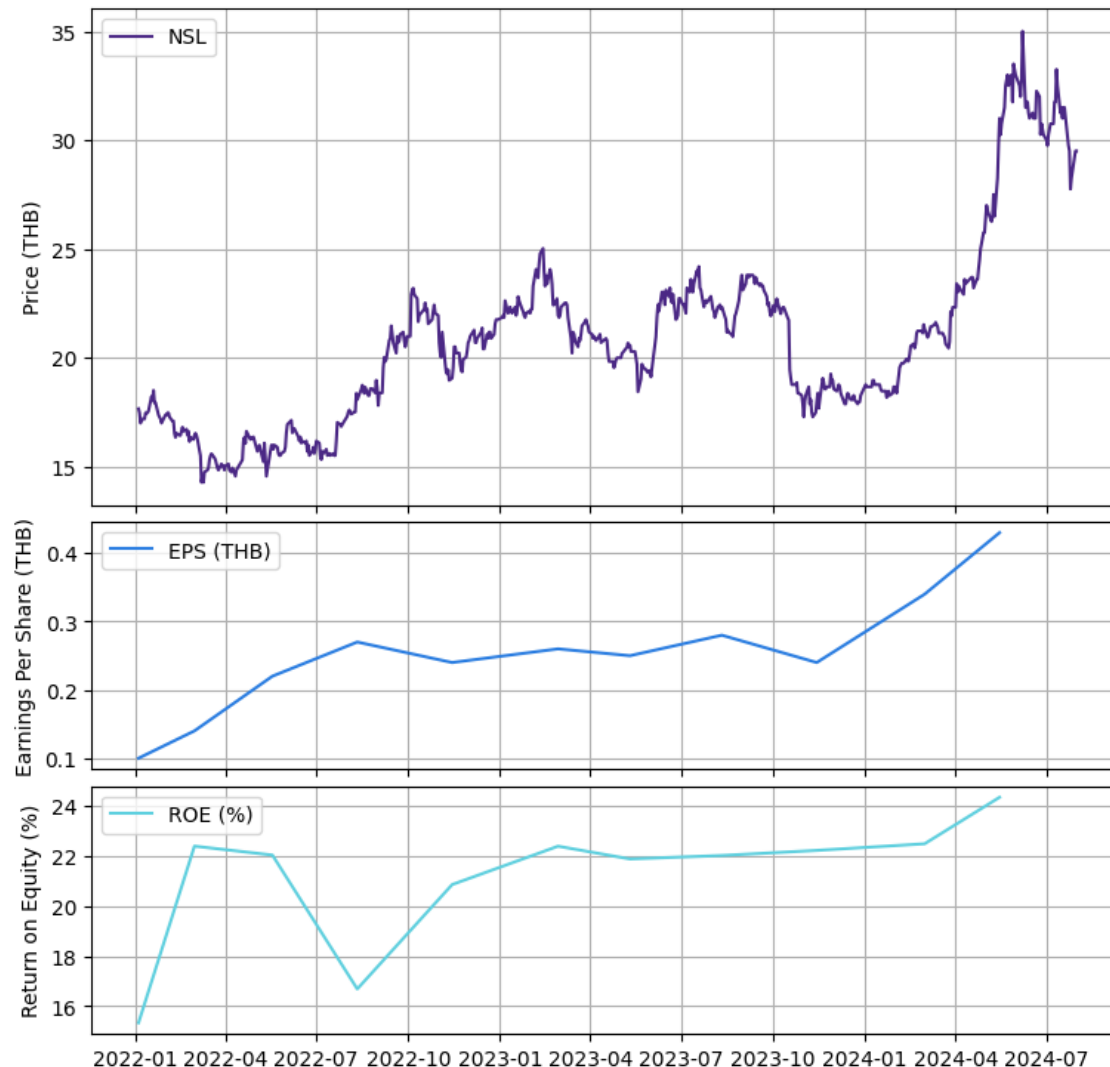
ผลิตและจำหน่ายสินค้าเบเกอรี่ อาหารรองท้อง และขนมขบเคี้ยว
รวมทั้งนำเข้าและจำหน่ายเนื้อสัตว์และผักแช่แข็ง

ข้อมูลสำคัญ

Market-cap: 8,850 ล้านบาท **EPS:** 1.29 บาท

P/E: 22.94 **ROE:** 24.35%

P/BV: 5.25 **Net Profit Margin:** 9.41%



รายชื่อหุ้น InnovestX CANSLIM ประจำเดือน สิงหาคม 2024



บริษัท ดับบลิวเอชเอ ยูทิลิตี้ส์ แอนด์ พาวเวอร์ จำกัด (มหาชน)

Quote: **WHAUP**

ประกอบธุรกิจหลักใน (1) ธุรกิจสาธารณูปโภค โดยจำหน่ายน้ำดิบ ผลิตและจำหน่ายน้ำ เพื่ออุตสาหกรรม และบริหารจัดการน้ำเสีย (2) ธุรกิจพลังงาน โดยลงทุนในธุรกิจ ผลิตและจำหน่ายไฟฟ้าทั้งในประเทศและต่างประเทศ

ข้อมูลสำคัญ

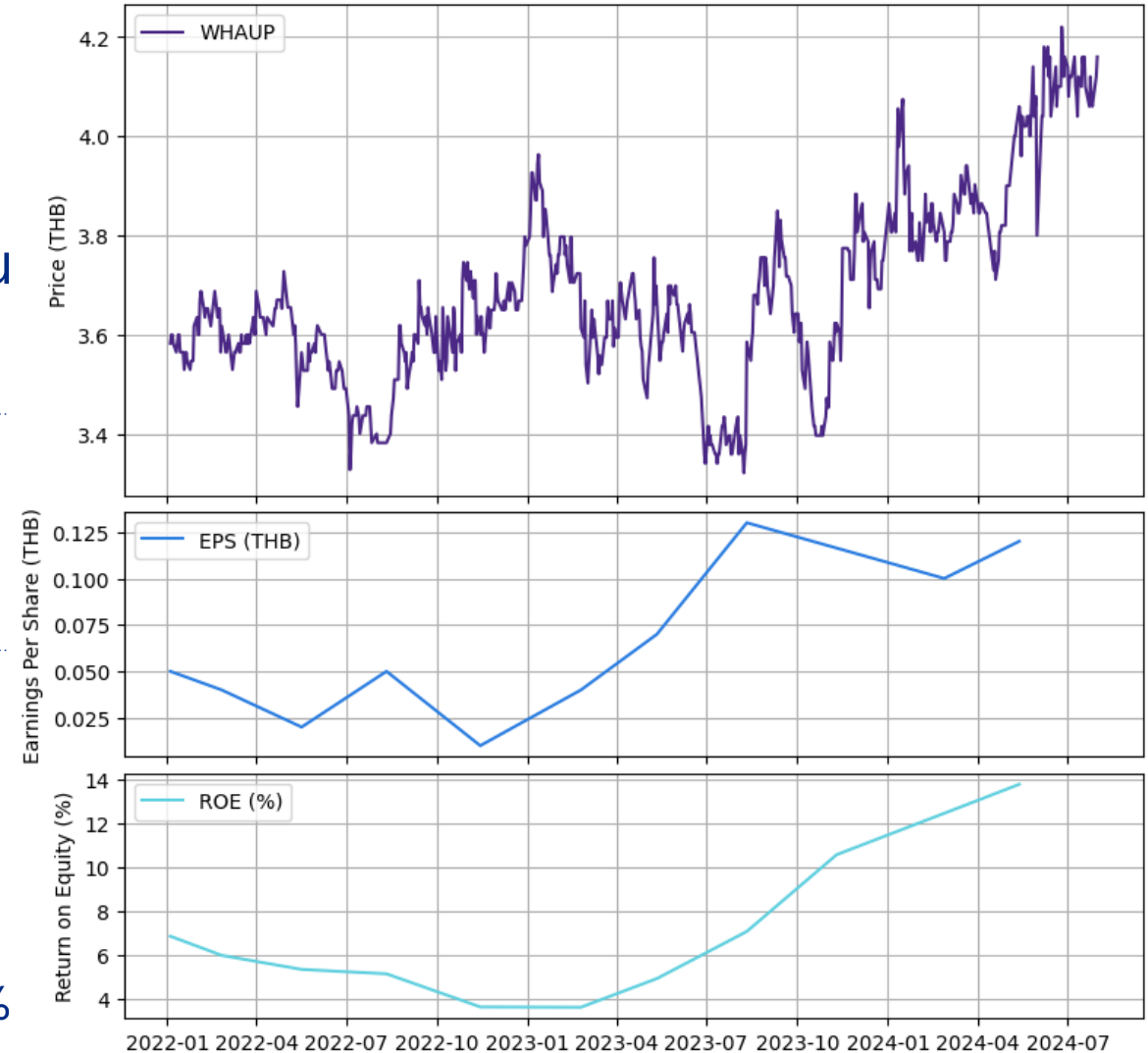
Market-cap: 15,912 ล้านบาท **EPS:** 0.48 บาท

P/E: 8.63

ROE: 13.78%

P/BV: 1.14

Net Profit Margin: 49.34%



รายชื่อหุ้น InnovestX CANSLIM ประจำเดือน สิงหาคม 2024



บริษัท การบินกรุงเทพ จำกัด (มหาชน)

Quote: **BA**

บริษัทประกอบธุรกิจสายการบิน ธุรกิจสนามบิน และธุรกิจที่
เกี่ยวข้องกับธุรกิจสนามบิน

ข้อมูลสำคัญ

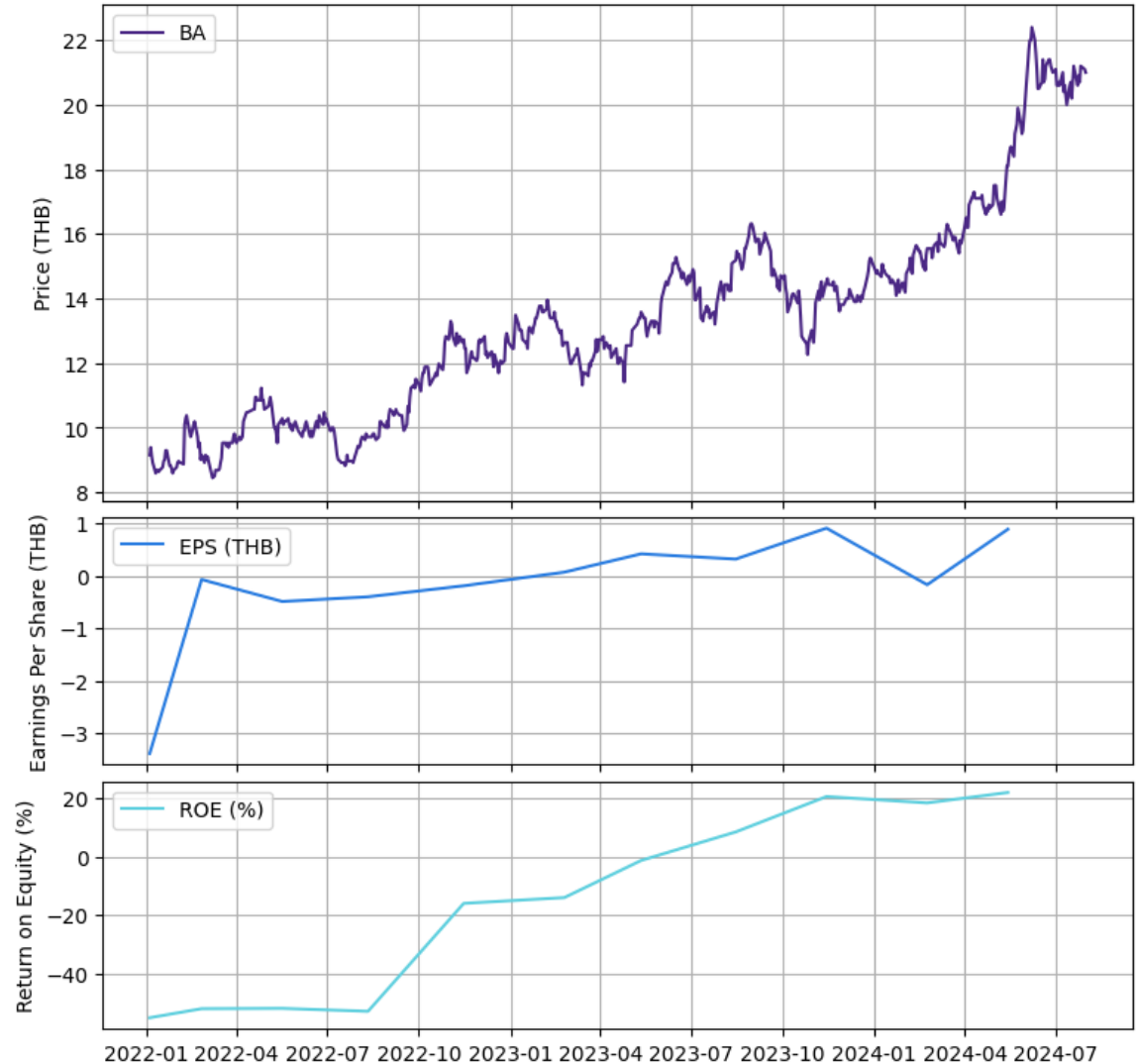
Market-cap: 44,100 ล้านบาท **EPS:** 1.95 บาท

P/E: 10.73

ROE: 21.97%

P/BV: 2.29

Net Profit Margin: 24.09%



รายชื่อหุ้น InnovestX CANSLIM ประจำเดือน สิงหาคม 2024



บริษัท แอดวานซ์ อินโฟร์ เซอร์วิส จำกัด (มหาชน)

Quote: **ADVANC**

ให้บริการสื่อสารโทรคมนาคม โดยรวมถึงธุรกิจให้บริการโทรศัพท์เคลื่อนที่
ธุรกิจอินเทอร์เน็ตความเร็วสูง และธุรกิจดิจิทัล เซอร์วิส

ข้อมูลสำคัญ

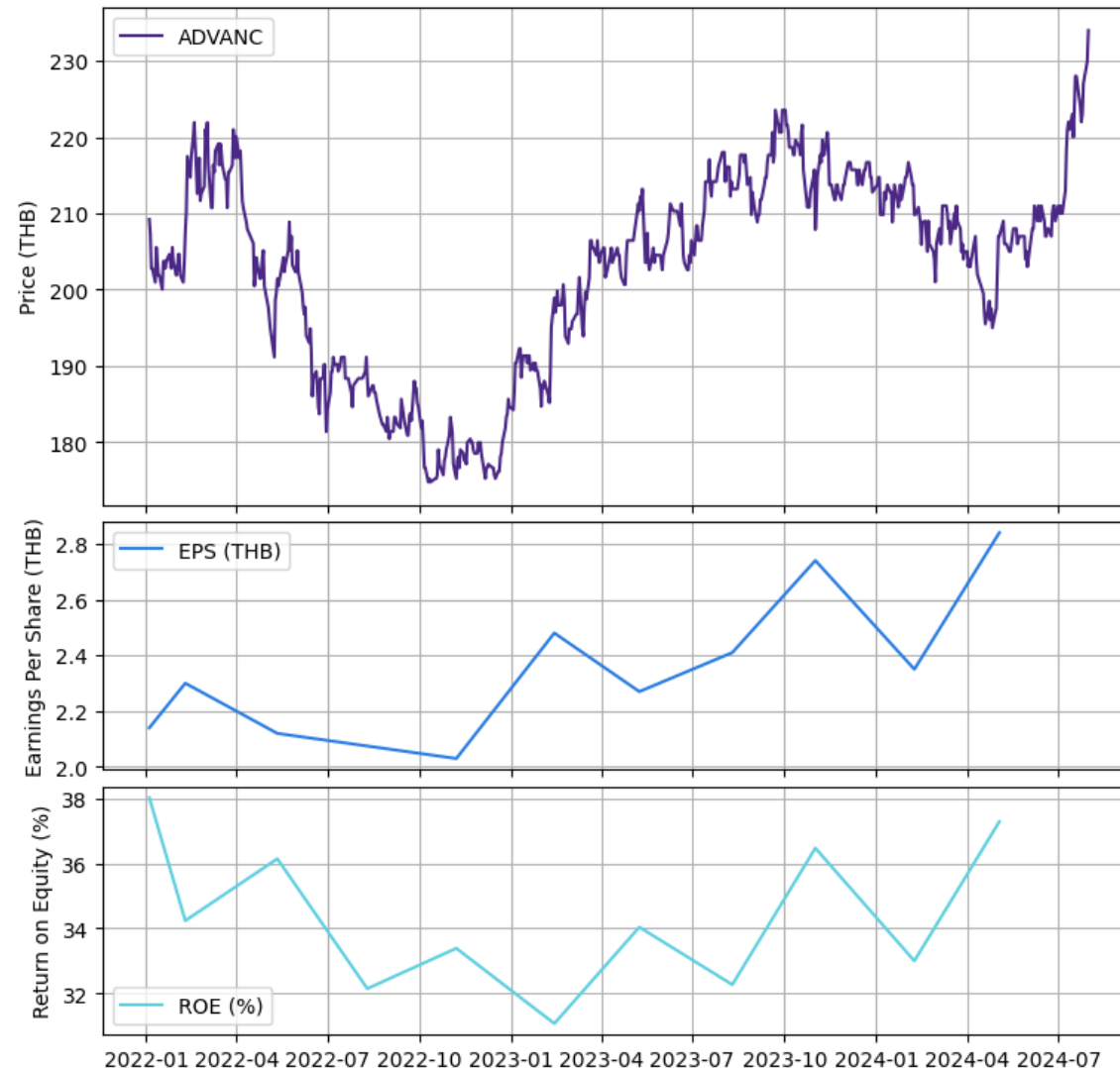
Market-cap: 695,965 ล้านบาท **EPS:** 10.34 บาท

P/E: 22.61

ROE: 37.28%

P/BV: 8.16

Net Profit Margin: 15.81%



รายชื่อหุ้น InnovestX CANSLIM ประจำเดือน สิงหาคม 2024



บริษัท เอเชียัน อะไลอันซ์ อินเตอร์เนชั่นแนล จำกัด (มหาชน)

Quote: **AAI**

ธุรกิจรับจ้างผลิตและจำหน่ายอาหารสัตว์เลี้ยง (Pet food) อาหารพร้อมทานบรรจุภาชนะปิดผนึก (Human food) และผลิตภัณฑ์ผลพลอยได้จากการแปรรูปปลาทูน่า

ข้อมูลสำคัญ

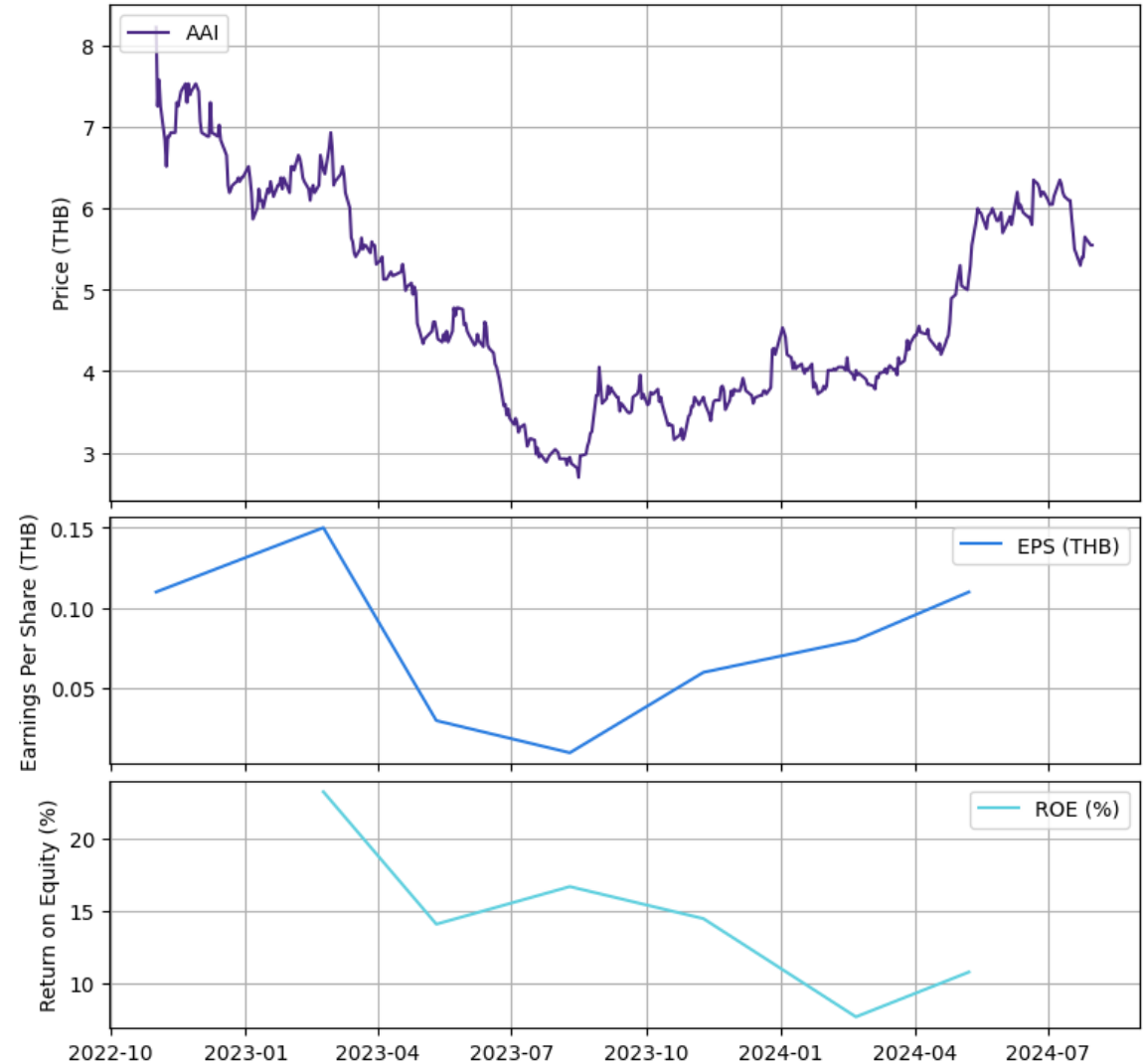
Market-cap: 11,793 ล้านบาท **EPS:** 0.26 บาท

P/E: 21.34

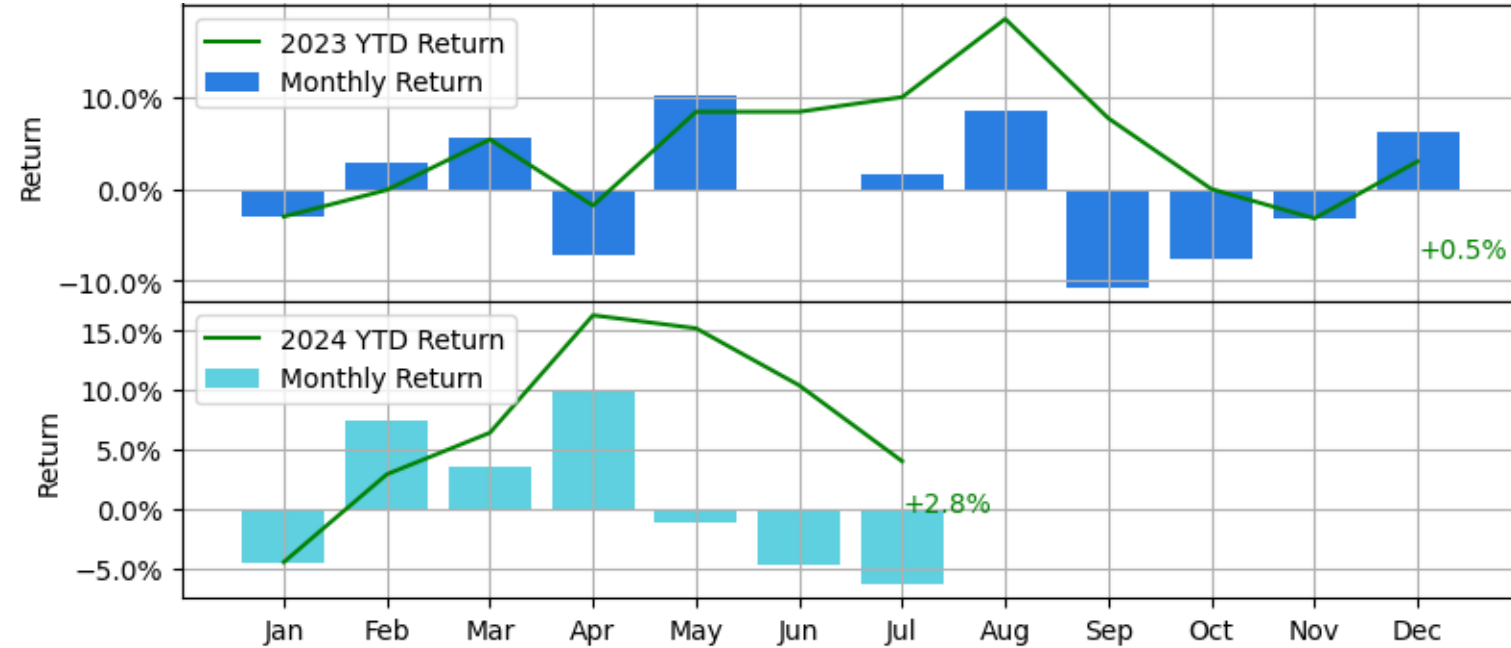
ROE: 10.80%

P/BV: 2.30

Net Profit Margin: 15.97%



ผลดำเนินการย้อนหลัง ตั้งแต่ปี 2023



	InnovestX CANSLIM	SET Total Return Index (SETTRI)
YTD	2.8%	-4.6%
3M	-11.9%	-3.0%
6M	7.6%	-1.0%
1Y	-5.6%	-12.3%
Inception	3.4%	-16.7%