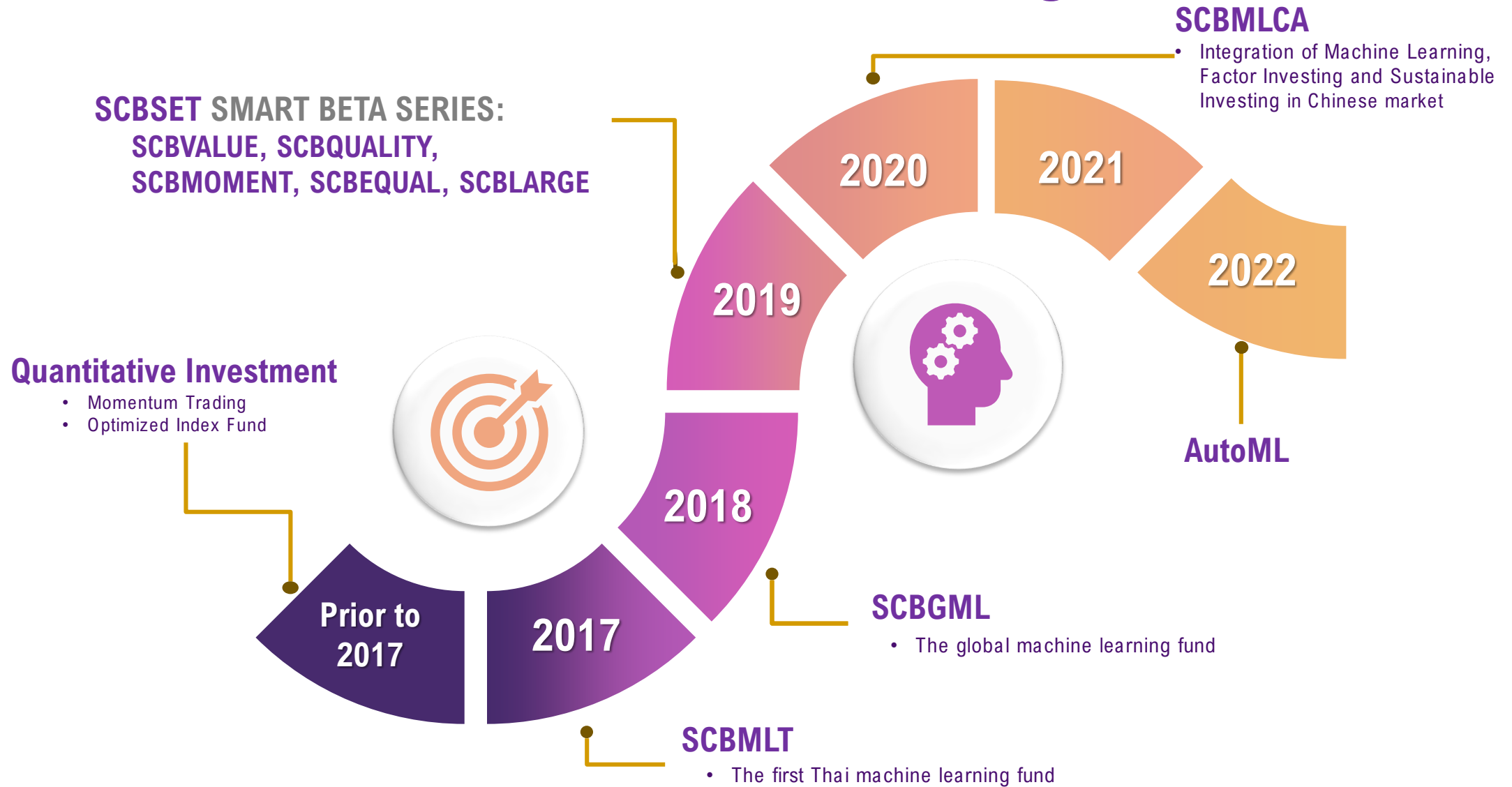


“Machine Learning in Investment Management”

SCBAM Machine Learning Fund

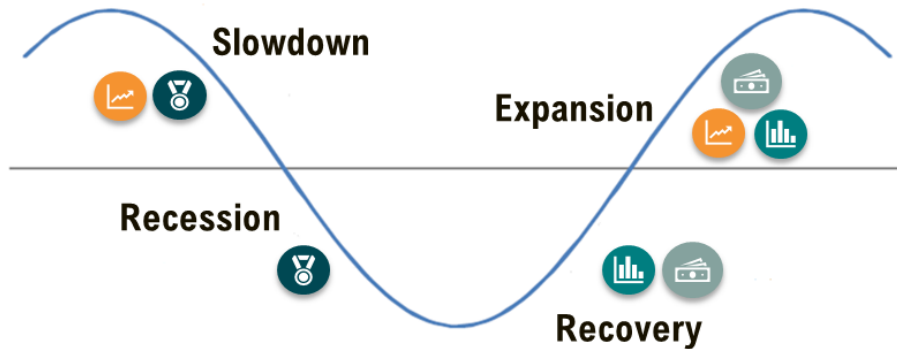


Factors Rotation

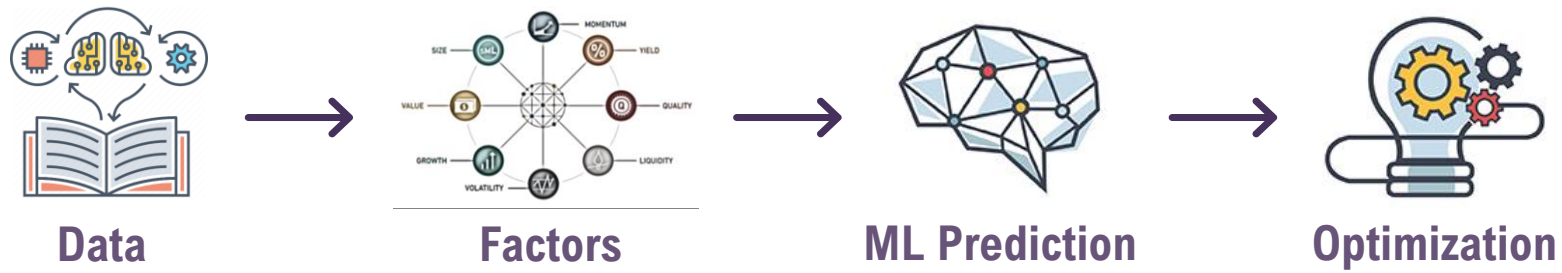
Periodic Return Performance : MSCI WORLD Factor Indices

2000-01-31 to 2021-06-30

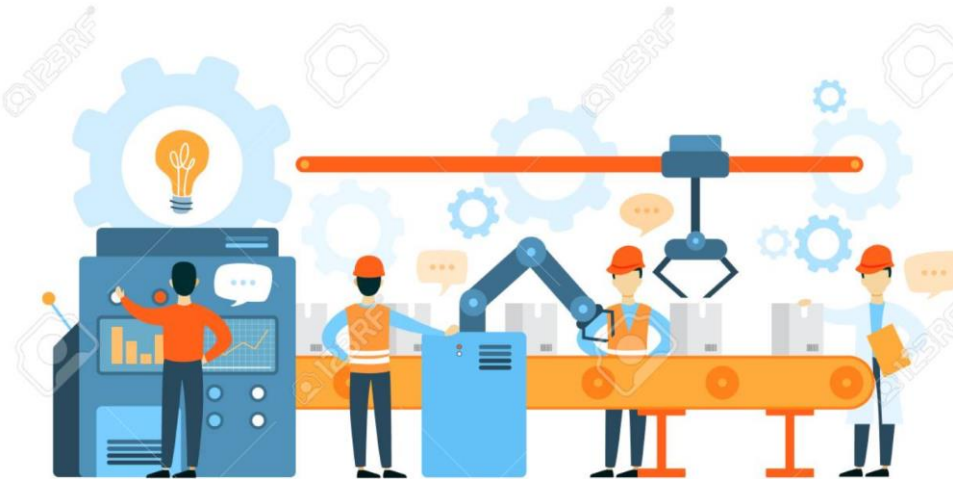
	2000	2001	2002	2003	2004	2005	2006	2007	2008	2009	2010	2011	2012	2013	2014	2015	2016	2017	2018	2019	2020	2021
Best	YIELD 0.93%	YIELD -8.58%	MIN.VOL -10.14%	SIZE 49.71%	SIZE 23.61%	MTUM 27.81%	YIELD 27.92%	MTUM 19.43%	MIN.VOL -29.68%	SIZE 41.35%	SIZE 17.7%	MIN.VOL 7.29%	GROWTH 16.12%	MTUM 29.66%	MIN.VOL 11.37%	MIN.VOL 5.16%	VALUE 12.33%	MTUM 32.09%	MIN.VOL -2.03%	QUALITY 36.08%	GROWTH 33.83%	VALUE 14.72%
	MIN.VOL 0.74%	MIN.VOL -10.53%	YIELD -10.42%	VALUE 38.13%	MTUM 20.86%	SIZE 14.7%	VALUE 25.08%	QUALITY 16.22%	QUALITY -33.84%	GROWTH 33.27%	MTUM 16.11%	MTUM 4.21%	SIZE 16.07%	QUALITY 27.06%	QUALITY 8.45%	MTUM 4.06%	YIELD 9.29%	GROWTH 28.01%	MTUM -2.76%	GROWTH 33.68%	MTUM 28.26%	QUALITY 13.9%
	VALUE 0.1%	SIZE -11.88%	SIZE -13.91%	WORLD 33.11%	MIN.VOL 20.01%	VALUE 9.55%	SIZE 21.61%	GROWTH 14.76%	MTUM -40.2%	QUALITY 32.56%	GROWTH 14.5%	YIELD 3.89%	WORLD 15.83%	GROWTH 26.73%	MTUM 6.55%	QUALITY 3.71%	SIZE 8.84%	QUALITY 25.96%	QUALITY -5.5%	MTUM 27.68%	QUALITY 22.2%	WORLD 13.05%
	SIZE -0.12%	QUALITY -12.4%	MTUM -14.8%	YIELD 29.49%	YIELD 19.13%	WORLD 9.49%	MIN.VOL 20.49%	WORLD 9.04%	VALUE -40.39%	YIELD 32.47%	MIN.VOL 12.03%	QUALITY 3.84%	VALUE 15.51%	WORLD 26.68%	GROWTH 6.14%	GROWTH 3.11%	WORLD 7.51%	SIZE 23.34%	GROWTH -6.74%	WORLD 27.67%	WORLD 15.9%	SIZE 12.1%
	QUALITY -10.43%	VALUE -14.93%	QUALITY -16.83%	GROWTH 28.08%	VALUE 18.51%	GROWTH 9.41%	WORLD 20.07%	YIELD 6.53%	WORLD -40.71%	WORLD 29.99%	WORLD 11.76%	GROWTH -5.49%	MTUM 14.08%	VALUE 26.62%	WORLD 4.94%	WORLD -0.87%	MIN.VOL 7.47%	WORLD 22.4%	YIELD -7.56%	SIZE 23.86%	SIZE 9.6%	GROWTH 11.14%
	WORLD -13.18%	WORLD -16.82%	WORLD -19.89%	MTUM 25.41%	WORLD 14.72%	MIN.VOL 7.7%	MTUM 18.74%	SIZE 5.99%	GROWTH -41.13%	VALUE 26.68%	QUALITY 10.7%	WORLD -5.54%	QUALITY 13.05%	SIZE 25.95%	VALUE 3.69%	SIZE -1.51%	QUALITY 4.55%	YIELD 18.14%	WORLD -8.71%	MIN.VOL 23.17%	MIN.VOL 2.61%	YIELD 10.51%
	MTUM -19.03%	GROWTH -19.38%	GROWTH -19.9%	MIN.VOL 25.18%	QUALITY 12.17%	YIELD 7.67%	QUALITY 16.21%	MIN.VOL 5.52%	SIZE -42.24%	MIN.VOL 16.43%	VALUE 9.02%	VALUE -5.62%	YIELD 12.24%	YIELD 21.91%	SIZE 2.94%	YIELD -3.2%	MTUM 4.19%	MIN.VOL 17.32%	VALUE -10.78%	YIELD 23.15%	YIELD -0.03%	MTUM 7.33%
Worst	GROWTH -25.66%	MTUM -20.87%	VALUE -19.94%	QUALITY 21.41%	GROWTH 10.9%	QUALITY 5.49%	GROWTH 15.15%	VALUE 3.4%	YIELD -42.98%	MTUM 14.21%	YIELD 6.29%	SIZE -9.75%	MIN.VOL 8.06%	MIN.VOL 18.61%	YIELD 2.48%	VALUE -4.82%	GROWTH 2.8%	VALUE 17.1%	SIZE -12.24%	VALUE 21.75%	VALUE -1.16%	MIN.VOL 7.11%



	8	1	5	SCORE
	Momentum	Value	Quality	
CPN	9	7	10	9.2
AOT	10	6	7	8.6
PTT	9	6	7	8.1
CPALL	7	9	8	7.5
COM7	6	10	9	7.4
BCH	6	10	4	5.6
BANPU	5	7	5	5.1
KTB	4	2	7	4.9
BJC	5	6	4	4.7
KBANK	2	2	8	4.1
TMB	1	3	3	1.9



Machine Learning Investment Process





Data



Factors



ML Prediction



Optimization

Traditional Data

Fundamental Data

- Balance Sheet
- Cash Flow Statement

Market Data

- Price
- Volume

Analytics

- Analyst Recommendations
- Earnings Forecast

Alternative Data

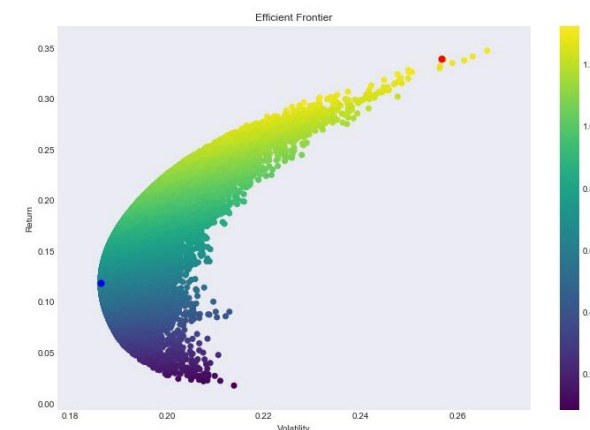
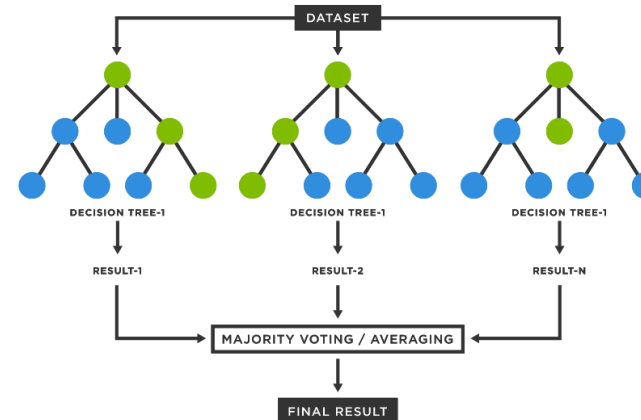
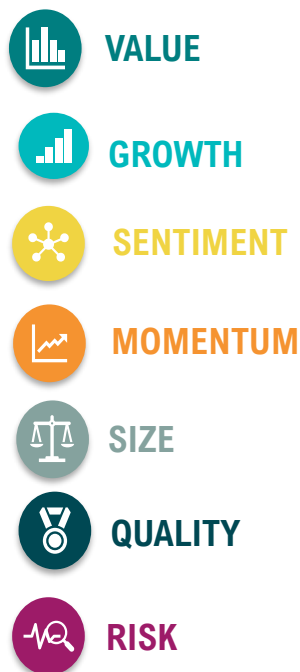
Email Sentiment

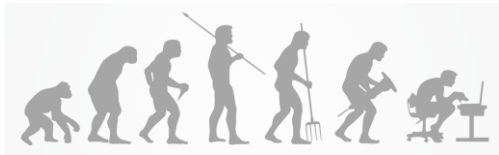
NVDR

Broker Score

Block Trade

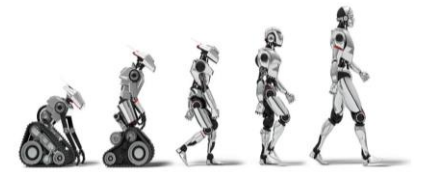
ESG





Natural Language Processing

Man-Machine Collaboration



Broker Email Sentiment

RHB : PTT Global Chemical (Another Strong Year To Come)

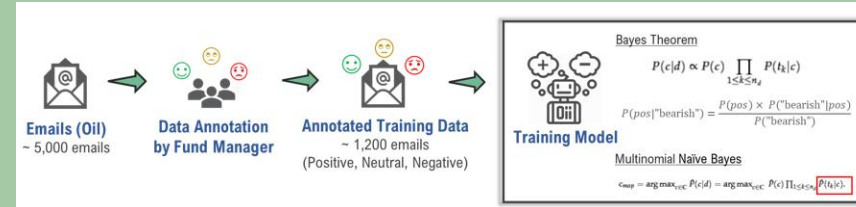
Krungsri Securities: PTTEP - Weak 3Q, but it will be made up in 4Q (TP Bt145.0, NEUTRAL)

IVG - Trade war began to show results?

```
TMB: 0.7896
CPN: 0.5488
BDMS: 0.1275
BANPU: 0.5344
. . .
PTTGC: -0.2357
BTSGIF: -0.4938
```

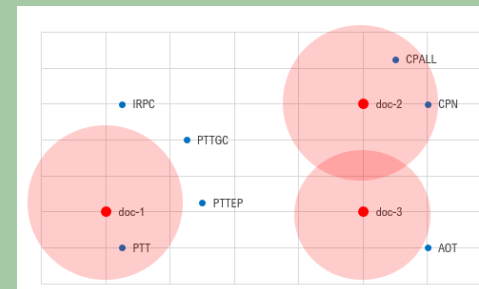
Email Utilization	49%
F1-FN Return	0.315%
Avg IC	0.0298

HITL: Human in The Loop



F1-FN Return	▲ 13%
Avg IC	▲ 17%

Word2Vec Improves Stock Detection in The Energy and Banking Sectors



Email Utilization	▲ 11%
-------------------	-------

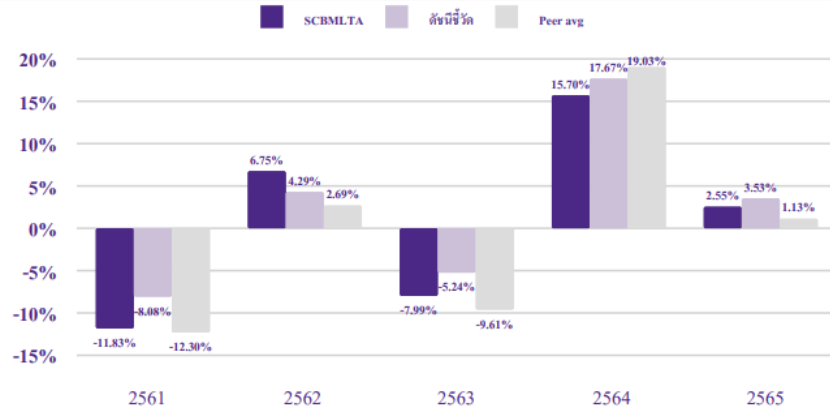
Historical Performance



SCBMLTA

กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Machine Learning Thai Equity (ชนิดสะสมมูลค่า)

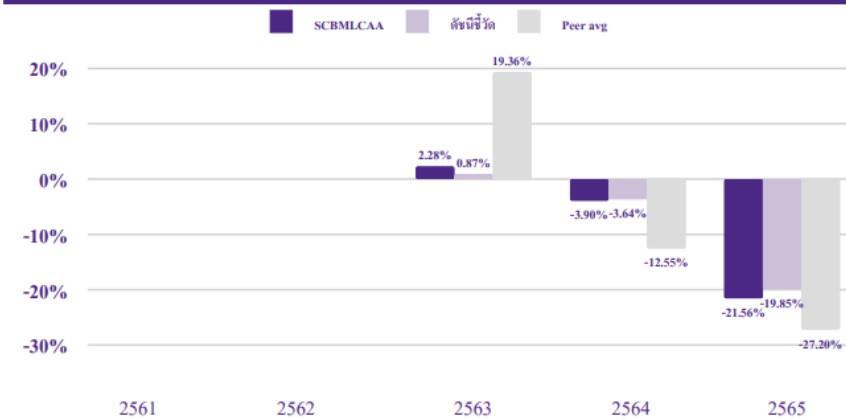
ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (% ต่อปี)



SCBMLCAA

กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Machine Learning China All Share (ชนิดสะสมมูลค่า)

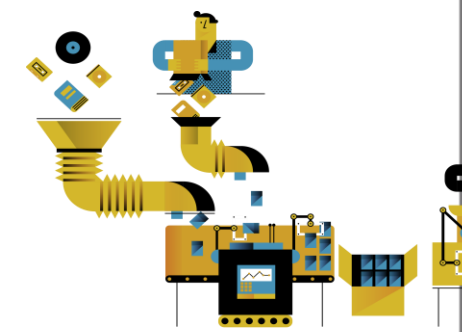
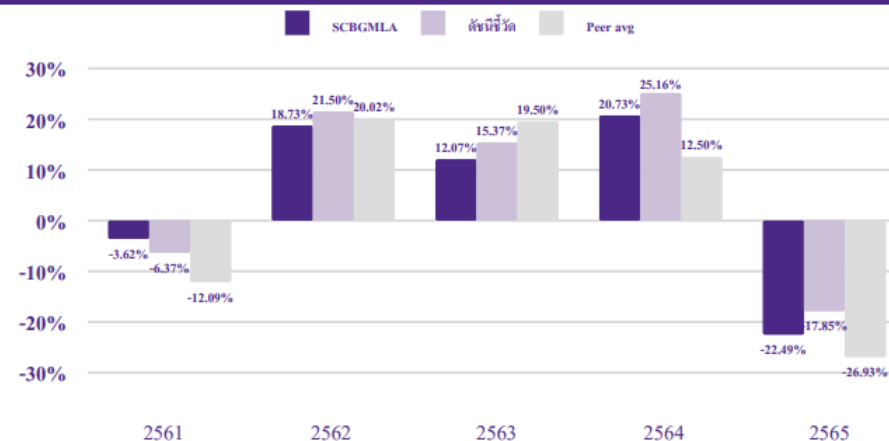
ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (% ต่อปี)



SCBGMLA

กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Global Machine Learning Equity (ชนิดสะสมมูลค่า)

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (% ต่อปี)



Our Technology Related Funds

Type	Fund Name	Fund Code	Fund Description
Passive US	กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ หุ้นยูเอส เอ็นดีคิว	SCBNDQ	ลงทุนใน NASDAQ ETF ซึ่งเป็น Index หลักของโลกในด้านเทคโนโลยี
Passive Asia	กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ China Technology	SCBCTECH	ลงทุนใน China Technology ETF โดยทุกวันนี้จีนมีบทบาทอย่างมากในด้านของเทคโนโลยี
Active	กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Innovation	SCBINNO	ลงทุนในบริษัทที่จะเป็นผู้นำและได้รับประโยชน์จาก Disruptive Technology
	กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Autonomous Technology and Robotics	SCBAUTO	ลงทุนเกี่ยวกับอุตสาหกรรมหุ่นยนต์และเครื่องมืออัตโนมัติ ที่ใช้อย่างแพร่หลายในหลายๆ อุตสาหกรรม เช่น ยานยนต์ โรงงานอุตสาหกรรม การแพทย์ รวมถึงการวิเคราะห์ข้อมูลขนาดใหญ่ หรือ Big Data
	กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ โกลบอลโรโบติกส์	SCBROBO	
	กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Next Generation Internet	SCBNEXT	ลงทุนในหุ้นที่เกี่ยวข้องกับ 5G เทคโนโลยีเสมือนจริง เช่น AR และ Internet of Things (IoT)
	กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Genomic Revolution	SCBGENOME	ลงทุนเกี่ยวกับความก้าวหน้าของนวัตกรรมทางการแพทย์ ที่ปัจจุบันประยุกต์ใช้เทคโนโลยีเป็นอย่างมาก
	กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Fintech Innovation	SCBFINTECH	ลงทุนในบริษัทที่ให้บริการทางการเงินผ่านช่องทางออนไลน์เป็นหลัก รับกับโลกยุคใหม่ที่ใช้เงินสดลดลง
	กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ โกลบอลดิจิทัล	SCBDIGI	ลงทุนเกี่ยวกับนวัตกรรมที่เปลี่ยนชีวิตคน เช่น Cloud Computing, Robotics, IoT, AI