

ABTESSF

กองทุนเปิด อเบอร์ดิน ตราสารทุนไทย เพื่อการออม - ชนิดเพื่อการออม

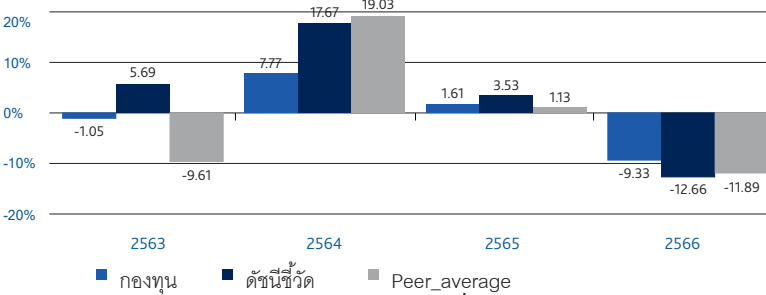
ประเภทกองทุนรวม /กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมตราสารทุน
- กองทุนรวมเพื่อการออม
- กลุ่ม Equity General

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- กองทุนจะลงทุนในหลักทรัพย์ที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยโดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 65 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุนรวม ซึ่งรวมถึงกองทุนรวมอสังหาริมทรัพย์, ทรัสต์เพื่อการลงทุนในอสังหาริมทรัพย์, กองทุนโครงสร้างพื้นฐาน และ/หรือหลักทรัพย์อื่นใดที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยที่จะนิยามใหม่ในอนาคต
- กองทุนมีกลยุทธ์การลงทุนมุ่งหวังให้ผลประกอบการสูงกว่าดัชนีชี้วัด

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (%ต่อปี)



ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด (อัตราเฉลี่ยต่อปีสำหรับผลการดำเนินงานที่แสดงช่วงเวลาตั้งแต่ 1 ปีขึ้นไป)

	ตั้งแต่ต้นปี	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี
กองทุน	-6.35	-5.29	-6.35	-10.12
ดัชนีชี้วัด	-6.07	-4.53	-6.07	-10.60
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	-6.40	-4.68	-6.40	-10.13
ความผันผวนกองทุน	9.13	9.44	9.13	10.27
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	10.14	10.38	10.14	10.95
	3 ปี	5 ปี	10 ปี	ตั้งแต่จัดตั้งกองทุน
กองทุน	-4.13	N/A	N/A	-2.04
ดัชนีชี้วัด	-3.58	N/A	N/A	1.36
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	-4.17	-3.52	0.54	
ความผันผวนกองทุน	10.62	N/A	N/A	12.07
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	11.13	N/A	N/A	12.74

ระดับความเสี่ยง



ความเสี่ยงสูง

ลงทุนในตราสารทุนโดยเฉลี่ยในรอบปีไม่น้อยกว่า 65 % ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน	12/06/2020
วันเริ่มต้น class	12/06/2020
นโยบายการจ่ายเงินปันผล	ไม่จ่ายเงินปันผล
อายุกองทุน	ไม่กำหนด

ผู้จัดการกองทุนรวม

- 1 น.ส. ดรฤทธิณี ภิโยยดิลภชัย (01/12/2021)
- 2 น.ส. ดวงธิดา แซ่แต้ (18/10/2021)

ดัชนีชี้วัด

ดัชนีผลตอบแทนรวมตราสารทุนแห่งประเทศไทย (SET TRI) 100.00%

อ้างอิงตัวชี้วัดเพื่อเปรียบเทียบกับผลการดำเนินงานของกองทุนรวม

คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวม มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต มีบริษัทแม่ดูแลให้ทำตามกฎหมาย

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือบริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่องได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



<https://www.abrdn.com/th-th/investor/fund-centre/fund-literature>

การซื้อขายหน่วยลงทุน

วันทำการซื้อ	ทุกวันทำการ
เวลาทำการ	9.00น. - 15.30น.
การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ	1,000 บาท
การซื้อครั้งถัดไปขั้นต่ำ	1,000 บาท

การขายคืนหน่วยลงทุน

วันทำการขายคืน	ทุกวันทำการ
เวลาทำการ	9.00น. - 13.00น.
การขายคืนขั้นต่ำ	0 บาท
ยอดคงเหลือขั้นต่ำ	0 บาท
หน่วยคงเหลือขั้นต่ำ	0
ระยะเวลาการรับเงิน	T+2 คือ 2 วันทำการหลังจากการขายคืน

ข้อมูลเชิงสถิติ

Maximum Drawdown	-17.47%
Recovering Period	n/a
Sharpe Ratio	-0.05
Alpha	-1.47
Beta	0.88
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน	23.09%

หมายเหตุ : อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน ณ วันที่ 29 มี.ค. 2567

หมายเหตุ

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV รวม VAT)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
ค่าธรรมเนียมการจัดการ	1.6050	1.6050
รวมค่าใช้จ่าย	2.6750	1.8300

หมายเหตุ

การจัดสรรการลงทุนในต่างประเทศ (% of NAV)

ไทย	100.00
-----	--------

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าหน่วยลงทุน รวม VAT)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
ค่าธรรมเนียมเสนอขาย	0.00	0.00
ค่าธรรมเนียมรับซื้อคืน	2.00	0.00
การปรับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า	0.00	0.00
ค่าธรรมเนียมสับเปลี่ยนออก	2.00	0.00
ค่าธรรมเนียมการโอนหน่วย	0.00	0.00

หมายเหตุ

- ค่าธรรมเนียมการรับซื้อคืน ปัจจุบันไม่เรียกเก็บเว้นแต่กรณีสับเปลี่ยนไปบริษัทจัดการอื่นเรียกเก็บ 1% ของมูลค่าหน่วยลงทุนของวันทำการก่อนหน้า
- กรณีสับเปลี่ยนไปยังบริษัทจัดการอื่น ไม่มีค่าธรรมเนียมการสับเปลี่ยนออกแต่ผู้ถือหน่วยจะต้องเสียค่าธรรมเนียมรับซื้อคืน 1%

การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม (% of NAV)

พาณิชย์	16.28
พลังงานและสาธารณูปโภค	12.51
พัฒนาอสังหาริมทรัพย์	11.78
การแพทย์	10.15
ท่องเที่ยวและสันทนาการ	9.16

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน (% of NAV)

ตราสารทุน	97.35
เงินฝากธนาคารและอื่นๆ	2.65

ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก (% of NAV)

บมจ. ดับบลิวเอชเอ คอร์ปอเรชั่น	6.77
บมจ. ซีพี ออลล์	6.49
บมจ. แอดวานซ์ อินโฟร์ เซอร์วิส	5.58
บมจ. ท่าอากาศยานไทย	4.75
บมจ. ไมเนอร์ อินเตอร์เนชั่นแนล	4.55

การลงทุนในกองทุนอื่นเกินกว่า 20 % (กองในประเทศและกองต่างประเทศ)

ชื่อกองทุน	ไม่มี	weblink
ชื่อกองทุน	ไม่มี	weblink
ชื่อกองทุน	ไม่มี	ISIN code
		Bloomberg code
ชื่อกองทุน	ไม่มี	ISIN code
		Bloomberg code

คำเตือน

Maximum Drawdown เปรอ์เซ็นต์ผลขาดทุนสูงสุดของกองทุนรวมในระยะเวลา 5 ปีย้อนหลัง (หรือตั้งแต่จัดตั้งกองทุนกรณีที่ยังไม่ครบ 5 ปี) โดยวัดจากระดับ NAV ต่อหน่วยที่จุดสูงสุดไปจนถึงจุดต่ำสุดในช่วงที่ NAV ต่อหน่วยปรับตัวลดลง ค่า Maximum Drawdown เป็นข้อมูลที่จะช่วยให้ทราบถึงความเสี่ยงที่อาจจะขาดทุนจากการลงทุนในกองทุนรวม Recovering Period ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาตั้งแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลาสั้นเท่าใด

FX Hedging เปรอ์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตกองทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลานึง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพ์กับผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 1 ปีหารด้วยมูลค่า NAV ของกองทุนรวมเฉลี่ยในรอบระยะเวลาเดียวกัน กองทุนรวมที่มีค่า portfolio turnover สูง บ่งชี้ถึงการซื้อขายหลักทรัพย์บ่อยครั้งของผู้จัดการกองทุนและทำให้มีต้นทุนการซื้อขายหลักทรัพย์ที่สูง จึงต้องพิจารณาเปรียบเทียบกับผลการดำเนินงานของกองทุนรวมเพื่อประเมิน ความคุ้มค่าของการซื้อขายหลักทรัพย์ดังกล่าว

Sharpe Ratio อัตราส่วนระหว่างผลตอบแทนส่วนเพิ่มของกองทุนรวมเปรียบเทียบกับความเสี่ยงจากการลงทุน โดยคำนวณจากผลต่างระหว่างอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมกับ อัตราผลตอบแทนที่ปราศจากความเสี่ยง (risk-free rate) เปรียบเทียบกับค่าเบี่ยงเบนมาตรฐาน (standard deviation) ของกองทุนรวม ค่า Sharpe Ratio สะท้อนถึงอัตราผลตอบแทนที่กองทุนรวมควรได้รับเพิ่มขึ้นเพื่อชดเชยกับความเสี่ยงที่กองทุนรวมรับมา โดยกองทุนรวมที่มีค่า Sharpe Ratio สูงกว่าจะเป็นกองทุนที่มีประสิทธิภาพในการบริหารจัดการการลงทุนที่ดีกว่า เนื่องจากได้รับผลตอบแทนส่วนเพิ่มที่สูงกว่าภายใต้ระดับความเสี่ยงเดียวกัน

Alpha ผลตอบแทนส่วนเกินของกองทุนรวมเมื่อเปรียบเทียบกับดัชนีชี้วัด (benchmark) โดยค่า Alpha ที่สูง หมายถึง กองทุนสามารถสร้างผลตอบแทนได้สูงกว่าดัชนีชี้วัด ซึ่งเป็นผลจากประสิทธิภาพของผู้จัดการกองทุนในการคัดเลือกหรือหาจังหวะเข้าลงทุนในหลักทรัพย์ได้อย่างเหมาะสม

Beta ระดับและทิศทางการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุน โดยเปรียบเทียบกับอัตราการเปลี่ยนแปลงของตลาด Beta น้อยกว่า 1 แสดงว่าหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนน้อยกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด Beta มากกว่า 1 แสดงว่าหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนมากกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด

Tracking Error อัตราผลตอบแทนของกองทุนมีประสิทธิภาพในการเลียนแบบดัชนีชี้วัด โดยหาก tracking error ต่ำ หมายถึงกองทุนรวมมีประสิทธิภาพในการสร้างผลตอบแทนให้ใกล้เคียงกับดัชนีชี้วัด กองทุนรวมที่มีค่า tracking error สูง จะมีอัตราผลตอบแทนโดยเฉลี่ยห่างจากดัชนีชี้วัดมากขึ้น

Yield to Maturity อัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในตราสารหนี้โดยถือจนครบกำหนดอายุ ซึ่งคำนวณจากดอกเบี้ยที่จะได้รับในอนาคตตลอดอายุตราสารและเงินต้นที่จะได้รับคืน นำมาคิดลดเป็นมูลค่าปัจจุบัน โดยใช้วิธีวัดอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมตราสารหนี้ คำนวณจากค่าเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักของ Yield to Maturity ของตราสารหนี้แต่ละตัวที่กองทุนมีการลงทุน และเนื่องจาก Yield to Maturity มีหน่วยมาตรฐานเป็นเปอร์เซ็นต์ต่อปี จึงสามารถนำไปใช้เปรียบเทียบอัตราผลตอบแทนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีนโยบายถือครองตราสารหนี้จนครบกำหนดอายุและมีลักษณะการลงทุนที่ใกล้เคียงกันได้

สอบถามข้อมูลเพิ่มเติมโปรดติดต่อ
บริษัท หลักทรัพ์จัดการกองทุน อเบอร์ดีน (ประเทศไทย) จำกัด
โทร 662 352 3388 <https://www.abrdn.com/th-th/investor>
อาคารบางกอกซิตีทาวเวอร์ ชั้น 28 เลขที่ 179 ถนนสาทรใต้
แขวงทุ่งมหาเมฆ เขตสาทร กรุงเทพฯ 10120

ABTESSFX

กองทุนเปิด อเบอร์ดิน ตราสารทุนไทย เพื่อการออม - ชนิดเพื่อการออมพิเศษ

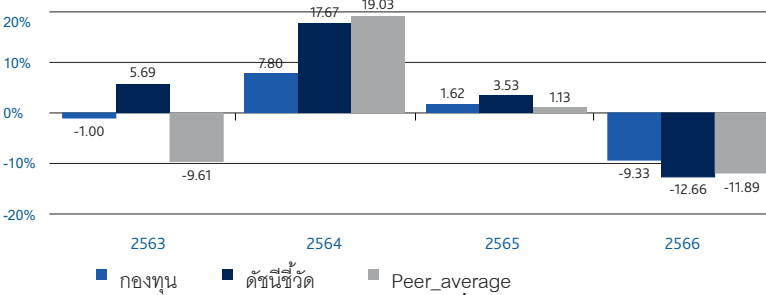
ประเภทกองทุนรวม /กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมตราสารทุน
- กองทุนรวมเพื่อการออม
- กลุ่ม Equity General

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- กองทุนจะลงทุนในหลักทรัพย์ที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยโดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 65 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุนรวม ซึ่งรวมถึงกองทุนรวมอสังหาริมทรัพย์, ทรัสต์เพื่อการลงทุนในอสังหาริมทรัพย์, กองทุนโครงสร้างพื้นฐาน และ/หรือหลักทรัพย์อื่นใดที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยที่จะนิยามใหม่ในอนาคต
- กองทุนมีกลยุทธ์การลงทุนมุ่งหวังให้ผลประกอบการสูงกว่าดัชนีชี้วัด

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (%ต่อปี)



ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด (อัตราเฉลี่ยต่อปีสำหรับผลการดำเนินงานที่แสดงช่วงเวลาตั้งแต่ 1 ปีขึ้นไป)

	ตั้งแต่ต้นปี	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี
กองทุน	-6.35	-5.30	-6.35	-10.12
ดัชนีชี้วัด	-6.07	-4.53	-6.07	-10.60
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	-6.40	-4.68	-6.40	-10.13
ความผันผวนกองทุน	9.13	9.44	9.13	10.27
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	10.14	10.38	10.14	10.95
	3 ปี	5 ปี	10 ปี	ตั้งแต่จัดตั้งกองทุน
กองทุน	-4.12	N/A	N/A	-2.01
ดัชนีชี้วัด	-3.58	N/A	N/A	1.36
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	-4.17	-3.52	0.54	
ความผันผวนกองทุน	10.62	N/A	N/A	12.07
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	11.13	N/A	N/A	12.74

ระดับความเสี่ยง



ความเสี่ยงสูง

ลงทุนในตราสารทุนโดยเฉลี่ยในรอบปีไม่น้อยกว่า 65 % ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน	12/06/2020
วันเริ่มต้น class	12/06/2020
นโยบายการจ่ายเงินปันผล	ไม่จ่ายเงินปันผล
อายุกองทุน	ไม่กำหนด

ผู้จัดการกองทุนรวม

- 1 น.ส. ดรฤทธิณี ภิโยชิตลภชัย (01/12/2021)
- 2 น.ส. ดวงธิดา แซ่แต้ (18/10/2021)

ดัชนีชี้วัด

ดัชนีผลตอบแทนรวมตราสารทุนแห่งประเทศไทย (SET TRI) 100.00%

อ้างอิงตัวชี้วัดเพื่อเปรียบเทียบกับผลการดำเนินงานของกองทุนรวม

คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวม มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต มีบริษัทแม่ดูแลให้ทำตามกฎหมาย

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือบริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่องได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



<https://www.abrdn.com/th-th/investor/fund-centre/fund-literature>

การซื้อขายหน่วยลงทุน

วันทำการซื้อ	ทุกวันทำการ
เวลาทำการ	9.00น. - 15.30น.
การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ	1,000 บาท
การซื้อครั้งถัดไปขั้นต่ำ	1,000 บาท

การขายคืนหน่วยลงทุน

วันทำการขายคืน	ทุกวันทำการ
เวลาทำการ	9.00น. - 13.00น.
การขายคืนขั้นต่ำ	0 บาท
ยอดคงเหลือขั้นต่ำ	0 บาท
หน่วยคงเหลือขั้นต่ำ	0
ระยะเวลาการรับเงิน	T+2 คือ 2 วันทำการหลังจากการขายคืน

ข้อมูลเชิงสถิติ

Maximum Drawdown	-17.47%
Recovering Period	n/a
Sharpe Ratio	-0.05
Alpha	-1.46
Beta	0.88
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน	23.09%

หมายเหตุ : อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน ณ วันที่ 29 มี.ค. 2567

หมายเหตุ

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV รวม VAT)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
ค่าธรรมเนียมการจัดการ	1.6050	1.6050
รวมค่าใช้จ่าย	2.6750	1.8100

หมายเหตุ

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าหน่วยลงทุน รวม VAT)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
ค่าธรรมเนียมเสนอขาย	0.00	0.00
ค่าธรรมเนียมรับซื้อคืน	2.00	0.00
การปรับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า	0.00	0.00
ค่าธรรมเนียมปรับเปลี่ยนออก	2.00	0.00
ค่าธรรมเนียมการโอนหน่วย	0.00	0.00

หมายเหตุ

- ค่าธรรมเนียมการรับซื้อคืน ปัจจุบันไม่เรียกเก็บเว้นแต่กรณีปรับเปลี่ยนไปบริษัทจัดการอื่นเรียกเก็บ 1% ของมูลค่าหน่วยลงทุนของวันทำการก่อนหน้า
- กรณีปรับเปลี่ยนไปยังบริษัทจัดการอื่น ไม่มีค่าธรรมเนียมการปรับเปลี่ยนออกแต่ผู้ถือหน่วยจะต้องเสียค่าธรรมเนียมรับซื้อคืน 1%

การจัดสรรการลงทุนในต่างประเทศ (% of NAV)

ไทย	100.00
-----	--------

การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม (% of NAV)

พาณิชย์	16.28
พลังงานและสาธารณูปโภค	12.51
พัฒนาอสังหาริมทรัพย์	11.78
การแพทย์	10.15
ท่องเที่ยวและสันทนาการ	9.16

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน (% of NAV)

ตราสารทุน	97.35
เงินฝากธนาคารและอื่นๆ	2.65

ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก (% of NAV)

บมจ. ดับบลิวเอชเอ คอร์ปอเรชั่น	6.77
บมจ. ซีพี ออลล์	6.49
บมจ. แอดวานซ์ อินโฟร์ เซอร์วิส	5.58
บมจ. ท่าอากาศยานไทย	4.75
บมจ. ไมเนอร์ อินเตอร์เนชั่นแนล	4.55

การลงทุนในกองทุนอื่นเกินกว่า 20 % (กองในประเทศและกองต่างประเทศ)

ชื่อกองทุน	ไม่มี	weblink
ชื่อกองทุน	ไม่มี	weblink
ชื่อกองทุน	ไม่มี	ISIN code
		Bloomberg code
ชื่อกองทุน	ไม่มี	ISIN code
		Bloomberg code

คำเตือน

Maximum Drawdown เปรอ์เซ็นต์ผลขาดทุนสูงสุดของกองทุนรวมในระยะเวลา 5 ปีย้อนหลัง (หรือตั้งแต่จัดตั้งกองทุนกรณีที่ยังไม่ครบ 5 ปี) โดยวัดจากระดับ NAV ต่อหน่วยที่จุดสูงสุดไปจนถึงจุดต่ำสุดในช่วงที่ NAV ต่อหน่วยปรับตัวลดลง ค่า Maximum Drawdown เป็นข้อมูลที่จะช่วยให้ทราบถึงความเสี่ยงที่อาจจะขาดทุนจากการลงทุนในกองทุนรวม Recovering Period ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาตั้งแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินลงทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลาตามเท่าใด

FX Hedging เปรอ์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตกองทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลานึง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพ์กับผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 1 ปีหารด้วยมูลค่า NAV ของกองทุนรวมเฉลี่ยในรอบระยะเวลาเดียวกัน กองทุนรวมที่มีค่า portfolio turnover สูง บ่งชี้ถึงการซื้อขายหลักทรัพย์บ่อยครั้งของผู้จัดการกองทุนและทำให้มีต้นทุนการซือขายหลักทรัพย์ที่สูง จึงต้องพิจารณาเปรียบเทียบกับผลการดำเนินงานของกองทุนรวมเพื่อประเมิน ความคุ้มค่าของการซือขายหลักทรัพย์ดังกล่าว

Sharpe Ratio อัตราส่วนระหว่างผลตอบแทนส่วนเพิ่มของกองทุนรวมเปรียบเทียบกับความเสี่ยงจากการลงทุน โดยคำนวณจากผลต่างระหว่างอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมกับ อัตราผลตอบแทนที่ปราศจากความเสี่ยง (risk-free rate) เปรียบเทียบกับค่าเบี่ยงเบนมาตรฐาน (standard deviation) ของกองทุนรวม ค่า Sharpe Ratio สะท้อนถึงอัตราผลตอบแทนที่กองทุนรวมควรได้รับเพิ่มขึ้นเพื่อชดเชยกับความเสี่ยงที่กองทุนรวมรับมา โดยกองทุนรวมที่มีค่า Sharpe Ratio สูงกว่าจะเป็นกองทุนที่มีประสิทธิภาพในการบริหารจัดการการลงทุนที่ดีกว่า เนื่องจากได้รับผลตอบแทนส่วนเพิ่มที่สูงกว่าภายใต้ระดับความเสี่ยงเดียวกัน

Alpha ผลตอบแทนส่วนเกินของกองทุนรวมเมื่อเปรียบเทียบกับดัชนีชี้วัด (benchmark) โดยค่า Alpha ที่สูง หมายถึง กองทุนสามารถสร้างผลตอบแทนได้สูงกว่าดัชนีชี้วัด ซึ่งเป็นผลจากประสิทธิภาพของผู้จัดการกองทุนในการคัดเลือกหรือหาจังหวะเข้าลงทุนในหลักทรัพย์ได้อย่างเหมาะสม

Beta ระดับและทิศทางการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุน โดยเปรียบเทียบกับอัตราการเปลี่ยนแปลงของตลาด Beta น้อยกว่า 1 แสดงว่าหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนน้อยกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด Beta มากกว่า 1 แสดงว่าหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนมากกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด

Tracking Error อัตราผลตอบแทนของกองทุนมีประสิทธิภาพในการเลียนแบบดัชนีชี้วัด โดยหาก tracking error ต่ำ หมายถึงกองทุนรวมมีประสิทธิภาพในการสร้างผลตอบแทนให้ใกล้เคียงกับดัชนีชี้วัด กองทุนรวมที่มีค่า tracking error สูง จะมีอัตราผลตอบแทนโดยเฉลี่ยห่างจากดัชนีชี้วัดมากขึ้น

Yield to Maturity อัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในตราสารหนี้โดยถือจนครบกำหนดอายุ ซึ่งคำนวณจากดอกเบี้ยที่จะได้รับในอนาคตตลอดอายุตราสารและเงินต้นที่จะได้รับคืน นำมาคิดลดเป็นมูลค่าปัจจุบัน โดยใช้วิธีวัดอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมตราสารหนี้ คำนวณจากค่าเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักของ Yield to Maturity ของตราสารหนี้แต่ละตัวที่กองทุนมีการลงทุน และเนื่องจาก Yield to Maturity มีหน่วยมาตรฐานเป็นเปอร์เซ็นต์ต่อปี จึงสามารถนำไปใช้เปรียบเทียบอัตราผลตอบแทนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีนโยบายถือครองตราสารหนี้จนครบกำหนดอายุและมีลักษณะการลงทุนที่ใกล้เคียงกันได้

สอบถามข้อมูลเพิ่มเติมโปรดติดต่อ
 บริษัท หลักทรัพ์จัดการกองทุน อเบอร์ดีน (ประเทศไทย) จำกัด
 โทร 662 352 3388 <https://www.abrdn.com/th-th/investor>
 อาคารบางกอกซิตีทาวเวอร์ ชั้น 28 เลขที่ 179 ถนนสาทรใต้
 แขวงทุ่งมหาเมฆ เขตสาทร กรุงเทพฯ 10120