

ABV

กองทุนเปิด อเบอร์ดิน แวลู

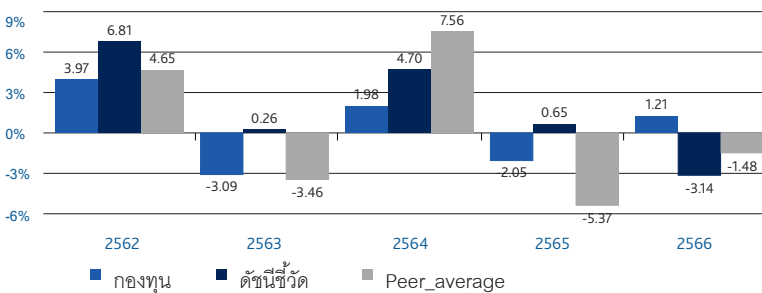
ประเภทกองทุนรวม /กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมผสม
- กลุ่ม Moderate Allocation

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- ลงทุนในหลักทรัพย์และหรือทรัพย์สินอื่นเป็นหรือเกี่ยวข้องกับตราสารแห่งทุนและตราสารกึ่งหนี้ กึ่งทุน รวมทั้งตราสารแห่งหนี้ ทั้งทางภาครัฐบาล รัฐวิสาหกิจ และภาคเอกชนและหลักทรัพย์ หรือตราสารแห่งหนี้ที่เสนอขายในต่างประเทศที่เป็นเงินสกุลบาท
- กองทุนอาจลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมอสังหาริมทรัพย์หรือหน่วยทรัสต์ของทรัสต์ เพื่อการลงทุนในอสังหาริมทรัพย์ (REITs) หรือหน่วยลงทุนของกองทุนรวมโครงสร้างพื้นฐาน (Infrastructure fund)
- ผู้จัดการกองทุนสามารถปรับกลยุทธ์การลงทุนให้เหมาะสมกับสภาพการณ์ในแต่ละขณะได้โดยคำนึงถึงผลประโยชน์ของผู้ถือหน่วยเป็นสำคัญ
- กองทุนมีกลยุทธ์การลงทุนมุ่งหวังให้ผลประกอบการสูงกว่าดัชนีชี้วัด

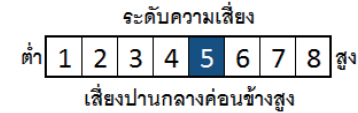
ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (%ต่อปี)



ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปีกลุ่ม (อัตราเฉลี่ยต่อปีสำหรับผลการดำเนินงานที่แสดงช่วงเวลาตั้งแต่ 1 ปีขึ้นไป)

	ตั้งแต่ต้นปี	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี
กองทุน	-1.52	-2.57	-2.14	-1.82
ดัชนีชี้วัด	-0.43	-0.29	0.51	-2.88
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	0.97	0.43	1.78	-0.52
ความผันผวนกองทุน	3.74	3.66	3.64	4.68
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	3.65	3.20	3.58	4.05
	3 ปี	5 ปี	10 ปี	ตั้งแต่จัดตั้งกองทุน
กองทุน	-0.11	-1.08	0.70	6.18
ดัชนีชี้วัด	-0.06	0.34	2.41	5.53
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	-1.56	-0.96	0.92	
ความผันผวนกองทุน	4.91	6.05	4.97	8.51
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	5.05	6.40	5.90	8.96

ระดับความเสี่ยง



เสี่ยงปานกลางค่อนข้างสูง
ลงทุนในตราสารทุน ตราสารหนี้และ/หรือทรัพย์สินทางเลือกโดยมีสัดส่วนการลงทุนในตราสารทุนน้อยกว่า 80 % ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน	13/11/2003
วันเริ่มต้น class	13/11/2003
นโยบายการจ่ายเงินปันผล	ไม่จ่ายเงินปันผล
อายุกองทุน	ไม่กำหนด

ผู้จัดการกองทุนรวม

- 1 นาย พงศ์ธาริน ทรัพย์ยานนท์ (15/08/2005)
- 2 น.ส. ดรฤณรัตน์ ภัยโยคิลักษณ์ (01/12/2021)

ดัชนีชี้วัด

ดัชนีผลตอบแทนรวมตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET TRI) 35.00%

ผลตอบแทนรวมสุทธิของดัชนีพันธบัตรรัฐบาล Mark-to-Market ของสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย 29.25%

ผลตอบแทนรวมของดัชนีพันธบัตรรัฐบาลระยะสั้นของสมาคมตราสารหนี้ไทย 29.25%

ผลตอบแทนรวมสุทธิของดัชนีตราสารหนี้ภาคเอกชน Mark-to-Market ที่มีอันดับความน่าเชื่อถือของผู้ออกตราสารอยู่ในระดับ BBB ขึ้นไป ของสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย 6.50%

อ้างอิงตัวชี้วัดเพื่อเปรียบเทียบกับผลการดำเนินงานของกองทุนรวม

คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวม มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต มีบริษัทแม่ดูแลให้ทำตามกฎหมาย

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือบริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่องได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



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 วันทำการหลังจาก
การขายคืน	วันทำการขายคืน

ข้อมูลเชิงสถิติ

Maximum Drawdown	-14.96%
Recovering Period	n/a
Sharpe Ratio	-0.03
Alpha	-0.74
Beta	0.65
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน	15.26%

หมายเหตุ : อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน ณ วันที่ 28 มิ.ย. 2567

หมายเหตุ

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV รวม VAT)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
ค่าธรรมเนียมการจัดการ	1.0700	1.0700
รวมค่าใช้จ่าย	2.6750	1.2400

หมายเหตุ

การจัดสรรการลงทุนในต่างประเทศ (% of NAV)

ไทย	100.00
-----	--------

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าหน่วยลงทุน รวม VAT)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
ค่าธรรมเนียมเสนอขาย	0.50	0.50
ค่าธรรมเนียมรับซื้อคืน	0.25	0.25
การปรับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า	0.00	0.00
ค่าธรรมเนียมรับซื้อคืน	0.05	0.05
ค่าธรรมเนียมการโอนหน่วย		

หมายเหตุ

- กรณีปรับเปลี่ยนเข้า ผู้ถือหน่วยลงทุนจะต้องเสียค่าธรรมเนียมเสนอขายด้วย
- กรณีปรับเปลี่ยนออก ผู้ถือหน่วยลงทุนจะต้องเสียค่าธรรมเนียมรับซื้อคืนด้วย
- ค่าธรรมเนียมการรับซื้อคืน เฉพาะกรณีถือหน่วยลงทุนไม่เกิน 1 ปี
- ค่าธรรมเนียมการโอนหน่วยลงทุน เรียกเก็บ 200 บาทต่อรายการโอนหน่วยลงทุน

การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม (% of NAV)

อาหารและเครื่องดื่ม	6.13
เทคโนโลยีสารสนเทศและการสื่อสาร	5.52
การแพทย์	3.49
ท่องเที่ยวและสันทนาการ	3.25
พาณิชย์	2.56

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน (% of NAV)

พันธบัตรรัฐบาล	33.46
ตราสารทุน	33.27
หุ้นกู้ภาคเอกชน	28.18
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย	0.98
เงินฝากธนาคารและอื่นๆ	4.11

ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก (% of NAV)

LB249A	3.29
LB336A	3.16
AEON262A	3.00
บมจ.ฮิวแมนิก้า	2.85
ESGLB376A	2.82

การจัดสรรการลงทุนตามอันดับความน่าเชื่อถือ (%)

	Local	National	International
Gov bond/AAA	35.43		
AA	7.63		
A	19.57		

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 เป็นข้อมูลที่ช่วยให้ทราบถึงความเสี่ยงที่อาจจะขาดทุนจากการลงทุนในกองทุนรวม Recovering Period ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาตั้งแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลาสั้นเท่าใด

FX Hedging เปรอ์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตกองทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลานึง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักหลักทรัพย์กับผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 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 โดยใช้วิธีอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมตราสารหนี้ คำนวณจากค่าเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักของ Yield to Maturity ของตราสารหนี้แต่ละตัวที่กองทุนมีการลงทุน และเนื่องจาก Yield to Maturity มีหน่วยมาตรฐานเป็นเปอร์เซ็นต์ต่อปี จึงสามารถนำไปใช้เปรียบเทียบอัตราผลตอบแทนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีนโยบายถือครองตราสารหนี้จนครบกำหนดอายุและมีลักษณะการลงทุนที่ใกล้เคียงกันได้

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