

บริษัท หลักทรัพย์จัดการกองทุน เอไอเอ (ประเทศไทย) จำกัด

กองทุนเปิด เอไอเอ เอ็นแฮนซ์ เซท 50

AIA-ES50

ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมตราสารทุน
- กองทุนที่ลงทุนแบบไม่มีความเสี่ยงในต่างประเทศ
- กลุ่ม Equity Large Cap

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- ลงทุนในหุ้นสามัญของบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยที่เป็น

ส่วนประกอบของดัชนี SET 50 โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV

- อาจลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) โดยที่การเข้าเป็นคู่สัญญาซื้อขายล่วงหน้า เพื่อเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน (Efficient Portfolio Management)
- มุ่งหวังให้ได้รับผลประกอบการเคลื่อนไหวสูงกว่าดัชนีชี้วัด (Active management)

ระดับความเสี่ยง



ลงทุนในตราสารทุนเป็นหลัก

โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน: 14 สิงหาคม 2563

วันเริ่มต้น Class: -

นโยบายการจ่ายปันผล: ไม่จ่าย

อายุกองทุน: ไม่กำหนด

ผู้จัดการกองทุนรวม

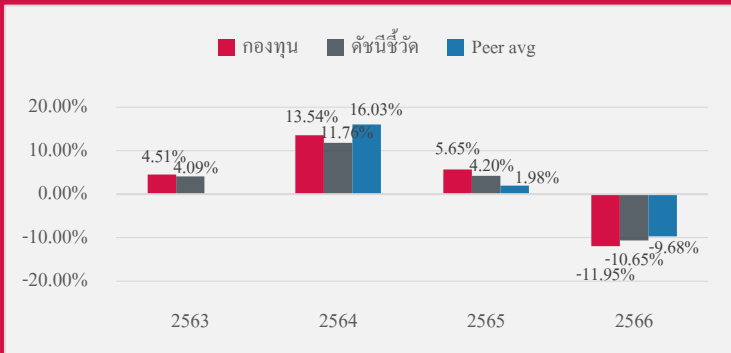
น.ส. วิภาดา จิรพนิช

น.ส. จินตนา เมฆินทรางกูร

ดัชนีชี้วัด:

ดัชนีผลตอบแทนรวม SET50 (SET50 TRI) สัดส่วน 100 %

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (%ต่อปี)



เนื่องจากกองทุนจัดตั้งในปี 2563 ดังนั้นจึงยังไม่มีข้อมูล Peer avg ของปี 2563

ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปีกลม (%ต่อปี)

	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี
กองทุน	6.51	13.06	8.46	2.62
ดัชนีชี้วัด	7.78	14.50	10.43	5.18
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	5.43	12.59	7.90	2.44
ความผันผวนของกองทุน	11.37	12.95	11.97	11.68
ความผันผวนของดัชนีชี้วัด	11.86	12.97	12.37	12.36
	3 ปี	5 ปี	10 ปี	ตั้งแต่จัดตั้ง
กองทุน	0.43	N/A	N/A	3.99
ดัชนีชี้วัด	1.05	N/A	N/A	3.81
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	-0.03	N/A	N/A	N/A
ความผันผวนของกองทุน	11.28	N/A	N/A	13.04
ความผันผวนของดัชนีชี้วัด	11.79	N/A	N/A	13.91

คำเตือน:

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวม

มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

มีได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การจัดอันดับกองทุน Morningstar

(ข้อมูล ณ วันที่ 30 กันยายน 2567)



การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต : ได้รับการรับรองจาก CAC

"ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือ

บริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่อง

ได้หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม"

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



www.aiaim.co.th

การซื้อขายหน่วยลงทุน	การขายคืนหน่วยลงทุน
วันทำการซื้อ : ทุกวันทำการ	วันทำการขายคืน : ทุกวันทำการ
เวลาทำการ : 9.00 - 15.30 น	เวลาทำการ : 9.00 - 15.30 น
การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ : 10,000 บาท	การขายคืนขั้นต่ำ : ไม่กำหนด
การซื้อครั้งถัดไปขั้นต่ำ : 10,000 บาท	ยอดคงเหลือขั้นต่ำ : 100 หน่วย
	ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน : T+3

หมายเหตุ: ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน T+3 คือ 3 วันทำการนับจากวันที่ทำรายการ

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (%ต่อปีของ NAV)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	1.3375	1.0719
รวมค่าใช้จ่าย	2.5948	1.2013

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (%ของมูลค่าซื้อขาย)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การขาย	1.605	1.605
การรับซื้อคืน	1.605	ไม่เรียกเก็บ
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า*	ไม่มี	ไม่มี
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก**	ไม่มี	ไม่มี
ค่าธรรมเนียมการโอนหน่วย	ตามที่นายทะเบียนเรียกเก็บ	ตามที่นายทะเบียนเรียกเก็บ
ค่าใช้จ่ายอื่นๆ	ตามที่จ่ายจริง	ตามที่จ่ายจริง

หมายเหตุ: * ผู้ถือหน่วยลงทุนจะต้องเสียค่าธรรมเนียมการขายด้วย

**ผู้ถือหน่วยลงทุนจะต้องเสียค่าธรรมเนียมการรับซื้อคืนด้วย

- ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว

- ค่าใช้จ่ายอื่น ๆ เมื่อคำนวณรวมกับค่าธรรมเนียมการจัดการ ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์

ค่าธรรมเนียมขายทะเบียนหน่วยลงทุน ค่าธรรมเนียมที่ปรึกษาการลงทุน (ถ้ามี) และค่าธรรมเนียม

ในการจัดจำหน่าย (ถ้ามี) ที่เรียกเก็บจริงต้องไม่เกินค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายทั้งหมดของกองทุน

- ค่าใช้จ่ายในการซื้อขายหลักทรัพย์ เมื่อสั่งซื้อ/ สั่งขาย / สับเปลี่ยนหน่วยลงทุน ไม่เกินร้อยละ 0.25

ของมูลค่าหน่วยลงทุน (ยกเว้น ไม่เรียกเก็บ)

ผู้ลงทุนสามารถดูข้อมูลค่าธรรมเนียมย้อนหลัง 3 ปี ในหนังสือชี้ชวนแบบเต็มได้ที่ www.aiaim.co.th

ข้อมูลเชิงสถิติ

Maximum Drawdown	-18.86 %
Recovering Period	N/A
FX Hedging	N/A
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน	22.33 %
Sharpe Ratio	-0.08
Alpha	-0.62 %
Beta	0.94
Tracking Error	N/A

หมายเหตุ: ข้อมูล max drawdown และ recovering period มาจาก

Morningstar

การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม

	%NAV
หมวดพลังงานและสาธารณูปโภค	19.42 %
หมวดธนาคาร	13.14 %
หมวดเทคโนโลยีสารสนเทศและการสื่อสาร	11.08 %
หมวดพาณิชย์	9.69 %
หมวดขนส่งและโลจิสติกส์	8.19 %

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน

Breakdown	%NAV
เงินลงทุนในหลักทรัพย์	97.43 %
สินทรัพย์และหนี้สินอื่นๆ	2.57 %

ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก

	%NAV
บมจ.ท่าอากาศยานไทย	7.04 %
บมจ.ปตท.	6.61 %
บมจ.แอดวานซ์ อินโฟร์ เซอร์วิส	6.44 %
บมจ.ซีพี ออลล์	5.63 %
บริษัทเคลต้า อีเลคโทรนิคส์ (ประเทศไทย)	5.44 %

ข้อมูลผลการดำเนินงานกองทุนเพิ่มเติม

ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปีกลุ่ม (%)

	1 เดือน
กองทุน	6.97
ดัชนีชี้วัด	6.93
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	N/A
ความผันผวนของกองทุน	15.59
ความผันผวนของดัชนีชี้วัด	15.44

คำอธิบาย

Maximum Drawdown

เปอร์เซ็นต์ผลขาดทุนสูงสุดของกองทุนรวมในระยะเวลา 5 ปีย้อนหลัง (หรือตั้งแต่จัดตั้งกองทุนกรณีที่ยังไม่ครบ 5 ปี) โดยวัดจากระดับ NAV ต่อหน่วยที่จุดสูงสุดไปจนถึงจุดต่ำสุดในช่วงที่ NAV ต่อหน่วยปรับตัวลดลง ค่า Maximum Drawdown เป็นข้อมูลที่ช่วยให้ทราบถึงความเสี่ยงที่อาจจะขาดทุนจากการลงทุนในกองทุนรวม

Recovering Period

ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาดังแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลาตามเท่าใด

FX Hedging

เปอร์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน

ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลาหนึ่ง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์กับผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 1 ปีหารด้วยมูลค่า NAV ของกองทุนรวมเฉลี่ยในรอบระยะเวลาเดียวกัน กองทุนรวมที่มีค่า portfolio turnover สูง บ่งชี้ถึงการซื้อขายหลักทรัพย์บ่อยครั้งของผู้จัดการกองทุนและทำให้มีต้นทุนการซื้อขายหลักทรัพย์ที่สูง จึงต้องพิจารณาเปรียบเทียบกับผลการดำเนินงานของกองทุนรวมเพื่อประเมินความคุ้มค่าของการซื้อขายหลักทรัพย์ดังกล่าว

Sharpe Ratio

อัตราส่วนระหว่างผลตอบแทนส่วนเพิ่มของกองทุนรวมเปรียบเทียบกับความเสี่ยงจากการลงทุน โดยคำนวณจากผลต่างระหว่างอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมกับอัตราผลตอบแทนที่ปราศจากความเสี่ยง (risk-free rate) เปรียบเทียบกับค่าเบี่ยงเบนมาตรฐาน (standard deviation) ของกองทุนรวม ค่า Sharpe Ratio สะท้อนถึงอัตราผลตอบแทนที่กองทุนรวมควรได้รับเพิ่มขึ้นเพื่อชดเชยกับความเสี่ยงที่กองทุนรวมรับมา โดยกองทุนรวมที่มีค่า Sharpe Ratio สูงกว่าจะเป็นกองทุนที่มีประสิทธิภาพในการบริหารจัดการลงทุนที่ดีกว่า เนื่องจากได้รับผลตอบแทนส่วนเพิ่มที่สูงกว่าภายใต้ระดับความเสี่ยงเดียวกัน

Alpha

ผลตอบแทนส่วนเกินของกองทุนรวมเมื่อเปรียบเทียบกับดัชนีชี้วัด (benchmark) โดยค่า Alpha ที่สูง หมายถึง กองทุนสามารถสร้างผลตอบแทนได้สูงกว่าดัชนีชี้วัด ซึ่งเป็นผลจากประสิทธิภาพของผู้จัดการกองทุนในการคัดเลือกหรือหาจังหวะเข้าลงทุนในหลักทรัพย์ได้อย่างเหมาะสม

Beta

ระดับและทิศทางการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุน โดยเปรียบเทียบกับอัตราการเปลี่ยนแปลงของตลาด Beta น้อยกว่า 1 แสดงว่า หลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนน้อยกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด Beta มากกว่า 1 แสดงว่า หลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนมากกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด

Tracking Error

อัตราผลตอบแทนของกองทุนมีประสิทธิภาพในการเลียนแบบดัชนีชี้วัด โดยหาก tracking error ต่ำ หมายถึงกองทุนรวมมีประสิทธิภาพในการสร้างผลตอบแทนให้ใกล้เคียงกับดัชนีชี้วัด กองทุนรวมที่มีค่า tracking error สูง จะมีอัตราผลตอบแทนโดยเฉลี่ยห่างจากดัชนีชี้วัดมากขึ้น

Yield to Maturity

อัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในตราสารหนี้โดยถือจนครบกำหนดอายุ ซึ่งคำนวณจากดอกเบี้ยที่ได้รับในอนาคตตลอดอายุตราสารและเงินต้นที่จะได้รับคืน นำมาคิดลดเป็นมูลค่าปัจจุบัน โดยใช้วัดอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมตราสารหนี้ คำนวณจากค่าเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักของ Yield to Maturity ของตราสารหนี้แต่ละตัวที่กองทุนมีการลงทุน และเนื่องจาก Yield to Maturity มีหน่วยมาตรฐานเป็นเปอร์เซ็นต์ต่อปี จึงสามารถนำไปใช้เปรียบเทียบอัตราผลตอบแทนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีนโยบายถือครองตราสารหนี้จนครบกำหนดอายุและมีลักษณะการลงทุนที่ใกล้เคียงกันได้

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนเอไอเอ (ประเทศไทย) จำกัด

โทรศัพท์: 0-2353-8822 www.aiaim.co.th

181/19 อาคารเอไอเอ ทาวเวอร์ 2 ชั้นที่ 11 ถนนสุรวงศ์ แขวงสุริยวงส์ เขตบางรัก กรุงเทพฯ 10500