

ABSM

กองทุนเปิด อเบอร์ดีน สมอล-มิดแคป - ชนิดสะสมมูลค่า

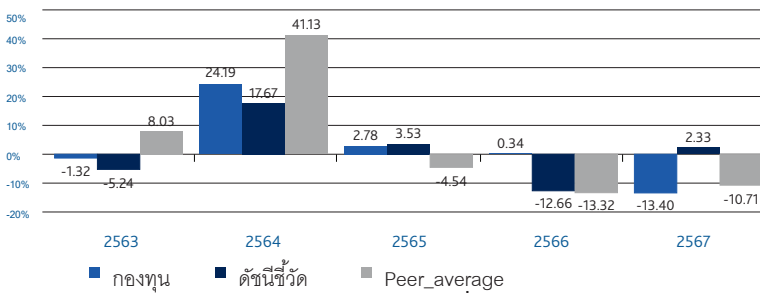
ประเภทกองทุนรวม /กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมตราสารทุน
- กลุ่ม Equity Small - Mid Cap

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- กองทุนมีนโยบายลงทุนในตราสารทุนของบริษัทจดทะเบียนใน SET และ/หรือ mai โดยเน้นลงทุนในตราสารทุนของบริษัทขนาดกลางและขนาดเล็ก เพื่อให้มี net exposure ในตราสารทุนดังกล่าว โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของ มูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุนรวม
- บริษัทขนาดกลางและขนาดเล็ก หมายถึง บริษัทจดทะเบียนใน SET และ/หรือ mai รวมถึงการลงชื่อหุ้น IPO ที่มี market capitalization ไม่เกิน 80,000 ล้านบาท ณ วันทำการก่อนหน้าวันที่ลงทุน
- กองทุนมีกลยุทธ์การลงทุนมุ่งหวังให้ผลประกอบการสูงกว่าดัชนีชี้วัด

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (%ต่อปี)



ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด (อัตราเฉลี่ยต่อปีสำหรับการดำเนินงานที่แสดงช่วงเวลาตั้งแต่ 1 ปีขึ้นไป)

	ตั้งแต่ต้นปี	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี
กองทุน	-20.01	-7.52	-23.26	-30.92
ดัชนีชี้วัด	-15.49	-2.29	-17.05	-10.98
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	-24.15	-10.74	-25.71	-30.21
ความผันผวนกองทุน	20.50	21.55	19.57	16.69
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	19.90	22.08	18.95	15.70

	3 ปี	5 ปี	10 ปี	ตั้งแต่จัดตั้งกองทุน
กองทุน	-12.19	-0.30	-1.53	6.84
ดัชนีชี้วัด	-8.48	0.03	0.58	6.50
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	-17.08	-1.77	-1.12	
ความผันผวนกองทุน	14.59	14.24	13.47	13.57
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	12.79	13.56	14.81	18.34

ระดับความเสี่ยง



เสี่ยงสูง

ลงทุนในตราสารทุนเป็นหลักโดยเฉลี่ยในรอบปีไม่น้อยกว่า 80 % ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน	02/06/2005
วันเริ่มต้น class	02/06/2005
นโยบายการจ่ายเงินปันผล	ไม่จ่ายเงินปันผล
อายุกองทุน	ไม่กำหนด

ผู้จัดการกองทุนรวม

- น.ส. ดรฤณรัตน์ ภัยโยธิตถชัย (01/12/2021)
- น.ส. ดวงธิดา แซ่แต้ (18/10/2021)

ดัชนีชี้วัด

ดัชนีผลตอบแทนรวมตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET TRI) 100.00%

อ้างอิงตัวชี้วัดเพื่อเปรียบเทียบกับผลการดำเนินงานของกองทุนรวม

คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวม ไม่ได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต มีบริษัทแม่ดูแลให้ทำตามกฎหมาย

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือบริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่องได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



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

การซื้อขายหน่วยลงทุน		การขายคืนหน่วยลงทุน		ข้อมูลเชิงสถิติ	
วันทำการซื้อ	ทุกวันทำการ	วันทำการขายคืน	ทุกวันทำการ	Maximum Drawdown	-40.46%
เวลาทำการ	9.00น. - 15.30น.	เวลาทำการ	9.00น. - 13.00น.	Recovering Period	n/a
การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ	1,000 บาท	การขายคืนขั้นต่ำ	1,000 บาท	Sharpe Ratio	-0.06
การซื้อครั้งถัดไปขั้นต่ำ	1,000 บาท	ยอดคงเหลือขั้นต่ำ	0 บาท	Alpha	-5.02
		หน่วยคงเหลือขั้นต่ำ	100	Beta	0.91
		ระยะเวลาการรับเงิน	T+2 คือ 2 วันทำการหลังจากการขายคืน	อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน	63.26%
				หมายเหตุ : อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน ณ วันที่ 31 มี.ค. 2568	

หมายเหตุ

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV รวม VAT)			การจัดสรรการลงทุนในต่างประเทศ (% of NAV)	
ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง	ไทย	100.00
ค่าธรรมเนียมการจัดการ	1.8725	1.8725		
รวมค่าใช้จ่าย	2.6750	2.0300		
หมายเหตุ				

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าหน่วยลงทุน รวม VAT)			การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม (% of NAV)	
ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง	เทคโนโลยีสารสนเทศและการสื่อสาร	16.18
ค่าธรรมเนียมเสนอขาย	1.00	1.00	พาณิชย์	12.97
ค่าธรรมเนียมรับซื้อคืน	0.00	0.00	อาหารและเครื่องดื่ม	12.39
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า	0.00	0.00	การแพทย์	11.25
ค่าธรรมเนียมสับเปลี่ยนออก	0.00	0.00	ธนาคาร	10.28
ค่าธรรมเนียมการโอนหน่วย				
หมายเหตุ				
-กรณีสับเปลี่ยนเข้า ผู้ถือหน่วยลงทุนจะต้องเสียค่าธรรมเนียมเสนอขายด้วย				
-ค่าธรรมเนียมการโอนหน่วยลงทุน เรียกเก็บ 50 บาทต่อ 1,000 หน่วย หรือ เศษของ 1,000 หน่วย				

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน (% of NAV)		ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก (% of NAV)	
ตราสารทุน	94.77	บมจ. โรงพยาบาลพระรามเก้า	7.81
เงินฝากธนาคารและอื่นๆ	5.23	บมจ. เมก้า ไคฟ์ไฮแอ็นซ์	6.97
		บมจ. ฮิวแมนิก้า	6.33
		บมจ. หาดทิพย์	5.38
		บมจ. ดิเดิ้ล โฮลดิ้งส์ จำกัด	4.99

การลงทุนในกองทุนอื่นเกินกว่า 20 % (กองในประเทศและกองต่างประเทศ)

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

คำเตือน

Maximum Drawdown เปอร์เซ็นต์ผลขาดทุนสูงสุดของกองทุนรวมในระยะเวลา 5 ปีย้อนหลัง (หรือตั้งแต่จัดตั้งกองทุนกรณีที่ยังไม่ครบ 5 ปี) โดยวัดจากระดับ NAV ต่อหน่วยที่จุดสูงสุดไปจนถึงจุดต่ำสุดในช่วงที่ NAV ต่อหน่วยปรับตัวลดลง ค่า Maximum Drawdown เป็นข้อมูลที่จะช่วยให้ทราบถึงความเสี่ยงที่อาจจะขาดทุนจากการลงทุนในกองทุนรวม Recovering Period ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาตั้งแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลานานเท่าใด FX Hedging เปอร์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลาหนึ่ง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลัก ทรัพย์กับผลรวมของมูลค่าการขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 1 ปีหารด้วยมูลค่า NAV ของกองทุนรวมเฉลี่ยในรอบระยะเวลาเดียวกัน กองทุนรวมที่มีค่า portfolio turnover สูง บ่งชี้ถึงการซื้อขายหลักทรัพย์บ่อยครั้งของผู้จัดการกองทุนและทำให้มีต้นทุนการซื้อขายหลักทรัพย์ที่สูง จึงต้องพิจารณาเปรียบเทียบกับผลการดำเนินงานของกองทุนรวมเพื่อประเมิน ความคุ้มค่าของการซื้อขายหลักทรัพย์ดังกล่าว

Sharpe Ratio อัตราส่วนระหว่างผลตอบแทนส่วนเพิ่มของกองทุนรวมเปรียบเทียบกับความเสี่ยงจากการลงทุน โดยคำนวณจากผลต่างระหว่างอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวม กับ 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 โดยใช้วัดอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมตราสารหนี้ คำนวณจากค่าเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักของ Yield to Maturity ของตราสารหนี้แต่ละตัวที่กองทุนมีการลงทุน และเนื่องจาก Yield to Maturity มีหน่วยมาตรฐานเป็นเปอร์เซ็นต์ต่อปี จึงสามารถนำไปใช้เปรียบเทียบอัตราผลตอบแทนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีนโยบายถือครองตราสารหนี้จนครบกำหนดอายุและมีลักษณะการลงทุนที่ใกล้เคียงกันได้

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

ABSM-SSF

กองทุนเปิด อเบอร์ดีน สมอล-มิดแคป - ชนิดเพื่อการออม

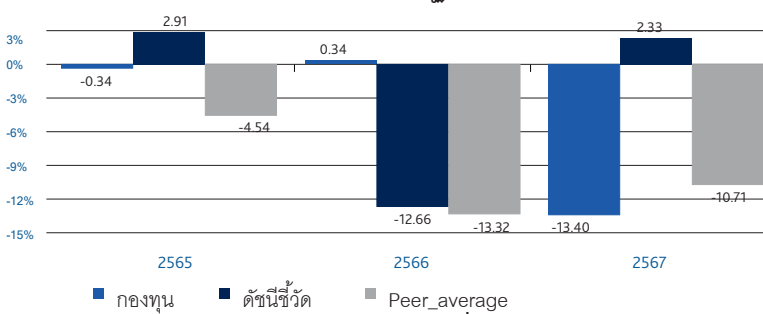
ประเภทกองทุนรวม /กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมตราสารทุน
- กองทุนรวมเพื่อการออม
- กลุ่ม Equity Small - Mid Cap

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- กองทุนมีนโยบายลงทุนในตราสารทุนของบริษัทจดทะเบียนใน SET และ/หรือ mai โดยเน้นลงทุนในตราสารทุนของบริษัทขนาดกลางและขนาดเล็ก เพื่อให้มี net exposure ในตราสารทุนดังกล่าว โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของ มูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุนรวม
- บริษัทขนาดกลางและขนาดเล็ก หมายถึง บริษัทจดทะเบียนใน SET และ/หรือ mai รวมถึงการลงชื้อหุ้น IPO ที่มี market capitalization ไม่เกิน 80,000 ล้านบาท ณ วันที่ทำการก่อนหน้าวันทูลงทุน
- กองทุนมีกลยุทธ์การลงทุนมุ่งหวังให้ผลประกอบการสูงกว่าดัชนีชี้วัด

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (%ต่อปี)



ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด (อัตราเฉลี่ยต่อปีสำหรับผลการดำเนินงานที่แสดงช่วงเวลาตั้งแต่ 1 ปีขึ้นไป)

	ตั้งแต่ต้นปี	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี
กองทุน	-20.01	-7.52	-23.26	-30.92
ดัชนีชี้วัด	-15.49	-2.29	-17.05	-10.98
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	-24.15	-10.74	-25.71	-30.21
ความผันผวนกองทุน	20.50	21.55	19.57	16.69
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	19.90	22.08	18.95	15.70
	3 ปี	5 ปี	10 ปี	ตั้งแต่จัดตั้งกองทุน
กองทุน	N/A	N/A	N/A	-13.43
ดัชนีชี้วัด	N/A	N/A	N/A	-9.43
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	-17.08	-1.77	-1.12	
ความผันผวนกองทุน	N/A	N/A	N/A	14.60
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	N/A	N/A	N/A	13.09

ระดับความเสี่ยง



ความเสี่ยงสูง

ลงทุนในตราสารทุนเป็นหลักโดยเฉลี่ยในรอบปีไม่น้อยกว่า 80 % ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน	02/06/2005
วันเริ่มต้น class	14/11/2022
นโยบายการจ่ายเงินปันผล	ไม่จ่ายเงินปันผล
อายุกองทุน	ไม่กำหนด

ผู้จัดการกองทุนรวม

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

ดัชนีชี้วัด

ดัชนีผลตอบแทนรวมตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET TRI) 100.00%

อ้างอิงตัวชี้วัดเพื่อเปรียบเทียบกับผลการดำเนินงานของกองทุนรวม

คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวม ไม่ได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต มีบริษัทแม่ดูแลให้ทำตามกฎหมาย

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือบริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่องได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



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

การซื้อขายหน่วยลงทุน		การขายคืนหน่วยลงทุน		ข้อมูลเชิงสถิติ	
วันทำการซื้อ	ทุกวันทำการ	วันทำการขายคืน	ทุกวันทำการ	Maximum Drawdown	-40.46%
เวลาทำการ	9.00น. - 15.30น.	เวลาทำการ	9.00น. - 13.00น.	Recovering Period	n/a
การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ	1,000 บาท	การขายคืนขั้นต่ำ	1,000 บาท	Sharpe Ratio	-0.07
การซื้อครั้งถัดไปขั้นต่ำ	1,000 บาท	ยอดคงเหลือขั้นต่ำ	1000 บาท	Alpha	-5.78
		หน่วยคงเหลือขั้นต่ำ	100	Beta	0.89
		ระยะเวลาการรับเงิน	T+2 คือ2 วันทำการหลังจากการขายคืน	อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน	63.26%
				หมายเหตุ : อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน ณ วันที่ 31 มี.ค. 2568	

หมายเหตุ

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV รวม VAT)			การจัดสรรการลงทุนในต่างประเทศ (% of NAV)	
ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง	ไทย	100.00
ค่าธรรมเนียมการจัดการ	1.8725	1.8725		
รวมค่าใช้จ่าย	2.6750	2.0300		
หมายเหตุ				

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าหน่วยลงทุน รวม VAT)			การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม (% of NAV)	
ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง	เทคโนโลยีสารสนเทศและการสื่อสาร	16.18
ค่าธรรมเนียมเสนอขาย	1.00	0.00	พาณิชย์	12.97
ค่าธรรมเนียมรับซื้อคืน	2.00	0.00	อาหารและเครื่องดื่ม	12.39
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า	0.00	0.00	การแพทย์	11.25
ค่าธรรมเนียมสับเปลี่ยนออก			ธนาคาร	10.28
ค่าธรรมเนียมการโอนหน่วย				
หมายเหตุ				
- ค่าธรรมเนียมการรับซื้อคืน ปัจจุบันไม่เรียกเก็บเว้นแต่กรณีสับเปลี่ยนไปบริษัทจัดการอื่นเรียกเก็บ 1% ของมูลค่าหน่วยลงทุนของวันทำการก่อนหน้า				
- ค่าสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก มีหลายเงื่อนไข โปรดดูรายละเอียดในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม				
- ค่าธรรมเนียมการโอนหน่วยลงทุน เรียกเก็บ 50 บาทต่อ 1,000 หน่วย หรือเศษของ 1,000 หน่วย				

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน (% of NAV)		ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก (% of NAV)	
ตราสารทุน	94.77	บมจ. โรงพยาบาลพระรามเก้า	7.81
เงินฝากธนาคารและอื่นๆ	5.23	บมจ. เมก้า ไคฟ์ไฮแอ็นซ์	6.97
		บมจ.ฮิวแมนิก้า	6.33
		บมจ.หาดทิพย์	5.38
		บมจ.ติดล้อ โฮลดิ้งส์ จำกัด	4.99

การลงทุนในกองทุนอื่นเกินกว่า 20 % (กองในประเทศและกองต่างประเทศ)

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

คำเตือน

Maximum Drawdown เปอร์เซ็นต์ผลขาดทุนสูงสุดของกองทุนรวมในระยะเวลา 5 ปีย้อนหลัง (หรือตั้งแต่จัดตั้งกองทุนกรณีที่ยังไม่ครบ 5 ปี) โดยวัดจากระดับ NAV ต่อหน่วยที่จุดสูงสุดไปจนถึงจุดต่ำสุดในช่วงที่ NAV ต่อหน่วยปรับตัวลดลง ค่า Maximum Drawdown เป็นข้อมูลที่จะช่วยให้ทราบถึงความเสี่ยงที่อาจจะขาดทุนจากการลงทุนในกองทุนรวม Recovering Period ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาตั้งแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลานานเท่าใด FX Hedging เปอร์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลาหนึ่ง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลัก ทรัพย์กับผลรวมของมูลค่าการขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 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 โดยใช้วัดอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมตราสารหนี้ คำนวณจากค่าเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักของ Yield to Maturity ของตราสารหนี้แต่ละตัวที่กองทุนมีการลงทุน และเนื่องจาก Yield to Maturity มีหน่วยมาตรฐานเป็นเปอร์เซ็นต์ต่อปี จึงสามารถนำไปใช้เปรียบเทียบอัตราผลตอบแทนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีนโยบายถือครองตราสารหนี้จนครบกำหนดอายุและมีลักษณะการลงทุนที่ใกล้เคียงกันได้

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