

บริษัท หลักทรัพย์จัดการกองทุน เอไอเอ (ประเทศไทย) จำกัด

กองทุนเปิด เอไอเอ โมเดอเรท อโลเคชัน ฟันด์

AIA-TMA

ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมผสม
- กองทุนรวมหน่วยลงทุนประเภท Fund of Funds ที่ลงทุนแบบมีความเสี่ยงทั้งในและต่างประเทศ
- กลุ่ม Moderate Allocation

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

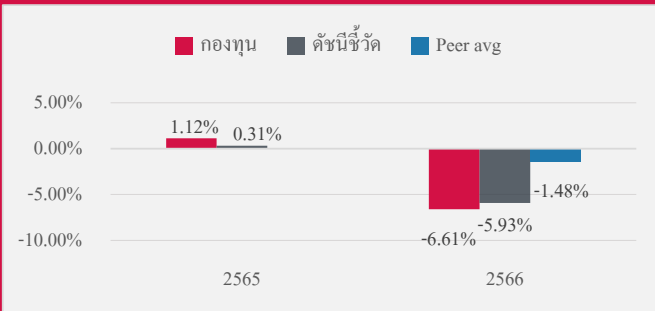
- ลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งหน่วยลงทุนของทรัสต์สิน (กองทุนปลายทาง) ดังต่อไปนี้ ตั้งแต่ 2 กองทุนขึ้นไป โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV ทั้งนี้ กองทุนจะลงทุนในกองทุนโลกกองทุนหนึ่ง โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่เกิน 79% ของ NAV

1. กองทุนรวมตราสารหนี้ที่จดทะเบียนในประเทศไทย ที่มีนโยบายการลงทุนทั้งในประเทศ และลงทุนในต่างประเทศไม่เกินร้อยละ 60% ของ NAV
  2. กองทุนรวมตราสารหนี้ที่จดทะเบียนในประเทศไทย ที่มีนโยบายการลงทุนในหุ้นที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย และ/หรือ ตลาดหลักทรัพย์ เอ็ม เอ ไอ และ/หรือสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives)
  3. กองทุนรวมอสังหาริมทรัพย์ที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยทั้งในและต่างประเทศ ที่มีนโยบายการลงทุนในตราสารหนี้และ/หรือตราสารหนี้
  4. กองทุนรวมอสังหาริมทรัพย์ และ/หรือทรัสต์เพื่อการลงทุนในอสังหาริมทรัพย์ และ/หรือกองทุนรวมโครงสร้างพื้นฐานที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย
- กองทุนอาจลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) เพื่อลดความเสี่ยง (Hedging) หรือเพื่อ

เป็นการเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน (Efficient Portfolio Management)

- มุ่งหวังให้ได้รับผลประกอบการเคลื่อนไหวสูงกว่าดัชนีชี้วัด (Active management)

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (%ต่อปี)

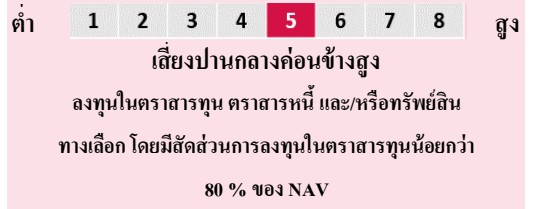


เนื่องจากกองทุนจัดตั้งในปี 2565 ดังนั้นจึงยังไม่มีข้อมูล Peer avg ของปี 2565

ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด (%ต่อปี)

	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี
กองทุน	-2.14	-0.77	0.80	-6.58
ดัชนีชี้วัด	-0.94	0.23	1.78	-5.71
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	0.97	0.43	1.78	-0.52
ความผันผวนของกองทุน	6.15	5.07	5.83	6.67
ความผันผวนของดัชนีชี้วัด	6.52	5.36	6.39	7.02
	3 ปี	5 ปี	10 ปี	ตั้งแต่จัดตั้ง
กองทุน	N/A	N/A	N/A	-3.32
ดัชนีชี้วัด	N/A	N/A	N/A	-2.85
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	N/A	N/A	N/A	N/A
ความผันผวนของกองทุน	N/A	N/A	N/A	6.69
ความผันผวนของดัชนีชี้วัด	N/A	N/A	N/A	7.04

ระดับความเสี่ยง



ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน: 4 เมษายน 2565

วันเริ่มต้น Class: -

นโยบายการจ่ายปันผล: ไม่จ่าย

อายุกองทุน: ไม่กำหนด

ผู้จัดการกองทุนรวม

คุณหญิง ทรงอธิกมาศ

คุณปิยเมศ อารยะธำกูร

ดัชนีชี้วัด:

(1) ผลตอบแทนรวมสุทธิของดัชนีพันธบัตรรัฐบาล

Mark-to-Market อายุไม่น้อยกว่าเท่ากับ 1 ปี

ของสมาคมตราสารหนี้ไทย สัดส่วน (%): 8.00

(2) ผลตอบแทนรวมสุทธิของดัชนีพันธบัตรรัฐบาล

Mark-to-Market อายุไม่น้อยกว่าเท่ากับ 10 ปี

ของสมาคมตราสารหนี้ไทย สัดส่วน (%): 20.00

(3) ผลตอบแทนรวมสุทธิของดัชนีตราสารหนี้ภาคเอกชน

Mark-to-Market ที่มีอันดับความน่าเชื่อถือของผู้ออกตราสาร

อยู่ในระดับ A- ขึ้นไป อายุไม่น้อยกว่าเท่ากับ 10 ปี

ของสมาคมตราสารหนี้ไทย สัดส่วน (%): 12.00

(4) ดัชนีผลตอบแทนรวม SET 50 (SET50 TRI)

สัดส่วน (%): 60.00

คำเตือน:

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวม มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต : ได้รับการรับรองจาก CAC

"ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือ  
บริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่อง  
ได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม"

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



www.aiaim.co.th

การซื้อขายหน่วยลงทุน	การขายคืนหน่วยลงทุน	ข้อมูลเชิงสถิติ
วันที่ทำการซื้อ : ทุกวันทำการ	วันที่ทำการขายคืน : ทุกวันทำการ	<b>Maximum Drawdown</b> -11.29 %
เวลาทำการ : 9.00 - 14.30 น	เวลาทำการ : 9.00 - 14.30 น	<b>Recovering Period</b> N/A
การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ : 10,000 บาท	การขายคืนขั้นต่ำ : ไม่กำหนด	<b>FX Hedging</b> N/A
การซื้อครั้งถัดไปขั้นต่ำ : 10,000 บาท	ยอดคงเหลือขั้นต่ำ : 100 หน่วย	<b>อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน</b> 30.54 %
	ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน : T+3	<b>Sharpe Ratio</b> N/A
หมายเหตุ: ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน 3 วันทำการนับตั้งแต่วันที่ถัดจากวันทำการ		<b>Alpha</b> N/A
รับซื้อคืนหน่วยลงทุน		<b>Beta</b> N/A
		<b>Tracking Error</b> N/A

หมายเหตุ: ข้อมูล maximum drawdown และ recovering period

มาจาก Morningstar

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (%ต่อปีของ NAV)		
ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	1.8725	1.1235
รวมค่าใช้จ่าย	3.1298	1.2487

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (%ของมูลค่าซื้อขาย)		
ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การขาย	2.14	1.605
การรับซื้อคืน	2.14	ไม่เรียกเก็บ
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า*	ไม่มี	ไม่มี
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก**	ไม่มี	ไม่มี
ค่าธรรมเนียมการโอนหน่วย	ตามที่นายทะเบียนเรียกเก็บ	ตามที่นายทะเบียนเรียกเก็บ
ค่าใช้จ่ายอื่นๆ	ตามที่จ่ายจริง	ตามที่จ่ายจริง

หมายเหตุ \* ผู้ถือหน่วยลงทุนจะต้องเสียค่าธรรมเนียมการขายด้วย


\*\*ผู้ถือหน่วยลงทุนจะต้องเสียค่าธรรมเนียมการรับซื้อคืนด้วย

- ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว
- ค่าใช้จ่ายอื่น ๆ เมื่อคำนวณรวมกับค่าธรรมเนียมการจัดการ ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ ค่าธรรมเนียมนายทะเบียนหน่วยลงทุน ค่าธรรมเนียมที่ปรึกษาการลงทุน (ถ้ามี) และค่าธรรมเนียมในการจัดจำหน่าย (ถ้ามี) ที่เรียกเก็บจริงต้องไม่เกินค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายทั้งหมดของกองทุน
- กรณีที่กองทุนลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมภายใต้การจัดการของบริษัทจัดการ (กองทุนปลายทาง) บริษัทจัดการจะไม่เรียกเก็บค่าธรรมเนียมการจัดการของกองทุนต้นทางซ้ำซ้อนกับกองทุนปลายทาง ผู้ลงทุนสามารถดูข้อมูลค่าธรรมเนียมย้อนหลัง 3 ปี ในหนังสือชี้ชวนแบบเต็มได้ที่ [www.aiaim.co.th](http://www.aiaim.co.th)

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน	
Breakdown	%NAV
เงินลงทุนในหลักทรัพย์	98.21 %
สินทรัพย์และหนี้สินอื่นๆ	1.79 %

ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก	
	%NAV
กองทุนเปิด เอไอเอ ไทย อีควิตี้	32.96 %
กองทุนเปิด เอไอเอ อินคัม ฟันด์	32.50 %
กองทุนเปิด เอไอเอ เอ็นแชนซ์ เซท 50	24.44 %
กองทุนเปิด เอไอเอ ไทย อีควิตี้ ดิสคัฟเวอรี	5.98 %
กองทุนเปิด เอไอเอ ตราสารหนี้ระยะสั้น	1.59 %

## การลงทุนในกองทุนอื่นเกินกว่า 20%

ชื่อกองทุน	ISIN code	Bloomberg code	Web link	QR Code
กองทุนเปิด เอไอเอ ไทย อีควิตี้	TH9871010004	AIATEAT	www.aiaim.co.th	
กองทุนเปิด เอไอเอ อินคัม ฟันด์	TH9869010008	AIAINCM		
กองทุนเปิด เอไอเอ เอ็นแอสซ์ เรท 50	TH9860010007	AIAESAE		

## ข้อมูลผลการดำเนินงานของกองทุนเปิด เอไอเอ โมเดอเรท โอลิแกนซ์ ฟันด์ เติมเต็ม

## ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปีกลมุด (%)

	1 เดือน
กองทุน	1.54
ดัชนีชี้วัด	2.12
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	N/A
ความผันผวนของกองทุน	5.72
ความผันผวนของดัชนีชี้วัด	5.57

## คำอธิบาย

<b>Maximum Drawdown</b>	เปอร์เซ็นต์ผลขาดทุนสูงสุดของกองทุนรวมในระยะเวลา 5 ปีย้อนหลัง (หรือตั้งแต่จัดตั้งกองทุนกรณีที่ยังไม่ครบ 5 ปี) โดยวัดจากระดับ NAV ต่อหน่วยที่จุดสูงสุดไปจนถึงจุดต่ำสุดในช่วงที่ NAV ต่อหน่วยปรับตัวลดลง ค่า Maximum Drawdown เป็นข้อมูลที่ช่วยให้ทราบถึงความเสี่ยงที่อาจจะขาดทุนจากการลงทุนในกองทุนรวม
<b>Recovering Period</b>	ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาตั้งแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่เงินลงทุนกลับมามีเงินต้นใช้ระยะเวลาตามเท่าใด
<b>FX Hedging</b>	เปอร์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน
<b>อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน</b>	ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลาหนึ่ง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อหลักทรัพย์กับผลรวมของมูลค่าการขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 1 ปีหารด้วยมูลค่า NAV ของกองทุนรวมเฉลี่ยในรอบระยะเวลาเดียวกัน กองทุนรวมที่มีค่า portfolio turnover สูง บ่งชี้ถึงการซื้อขายหลักทรัพย์บ่อยครั้งของผู้จัดการกองทุนและทำให้มีต้นทุนการซื้อขายหลักทรัพย์ที่สูง จึงต้องพิจารณาเปรียบเทียบกับผลการดำเนินงานของกองทุนรวมเพื่อประเมินความคุ้มค่าของการซื้อขายหลักทรัพย์ดังกล่าว
<b>Sharpe Ratio</b>	อัตราส่วนระหว่างผลตอบแทนส่วนเพิ่มของกองทุนรวมเปรียบเทียบกับความเสี่ยงจากการลงทุน โดยคำนวณจากผลต่างระหว่างอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมกับอัตราผลตอบแทนที่ปราศจากความเสี่ยง (risk-free rate) หารด้วยค่าเบี่ยงเบนมาตรฐาน (standard deviation) ของกองทุนรวม ค่า Sharpe Ratio สะท้อนถึงอัตราผลตอบแทนที่กองทุนรวมควรได้รับเพิ่มขึ้นเพื่อชดเชยกับความเสี่ยงที่กองทุนรวมรับมา โดยกองทุนรวมที่มีค่า Sharpe Ratio สูงกว่าจะเป็นกองทุนที่มีประสิทธิภาพในการบริหารจัดการลงทุนที่ดีกว่า เนื่องจากได้รับผลตอบแทนส่วนเพิ่มที่สูงกว่าภายใต้ระดับความเสี่ยงเดียวกัน
<b>Alpha</b>	ผลตอบแทนส่วนเกินของกองทุนรวมเมื่อเปรียบเทียบกับดัชนีชี้วัด (benchmark) โดยค่า Alpha ที่สูง หมายถึง กองทุนสามารถสร้างผลตอบแทนได้สูงกว่าดัชนีชี้วัด ซึ่งเป็นผลจากประสิทธิภาพของผู้จัดการกองทุนในการคัดเลือกหรือหาจังหวะการลงทุนในหลักทรัพย์ได้อย่างเหมาะสม
<b>Beta</b>	ระดับและทิศทางการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุน โดยเปรียบเทียบกับอัตราการเปลี่ยนแปลงของตลาด Beta น้อยกว่า 1 แสดงว่า หลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนน้อยกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด Beta มากกว่า 1 แสดงว่า หลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนมากกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด
<b>Tracking Error</b>	อัตราผลตอบแทนของกองทุนมีประสิทธิภาพในการเลียนแบบดัชนีชี้วัด โดยหาก tracking error ต่ำ หมายถึงกองทุนรวมมีประสิทธิภาพในการสร้างผลตอบแทนให้ใกล้เคียงกับดัชนีชี้วัด กองทุนรวมที่มีค่า tracking error สูง จะมีอัตราผลตอบแทนโดยเฉลี่ยห่างจากดัชนีชี้วัดมากขึ้น
<b>Yield to Maturity</b>	อัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในตราสารหนี้โดยถือจนครบกำหนดอายุ ซึ่งคำนวณจากดอกเบี้ยที่ได้รับในอนาคตตลอดอายุตราสารและเงินคืนที่จะได้รับคืนนำมาคิดลดเป็นมูลค่าปัจจุบัน โดยใช้วิธีคิดอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมตราสารหนี้ 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 แขวงสุริยวงค์ เขตบางรัก กรุงเทพฯ 10500