



**การซื้อขายหุ้นในวันลงทุน**

วันทำการวันที่ซื้อ	ทุกวันทำการ
เวลาทำการ	9.00น. - 15.30น.
การซื้อคั้งแลกขั้นต่ำ	1,000 บาท
จำนวนเงินคั้งต่อไป	1,000 บาท
ขั้นต่ำ	

**การขายคืนหุ้นในวันลงทุน**

วันทำการขายคืน	ทุกวันทำการ
เวลาทำการ	9.00น. - 13.00น.
การขายคืนขั้นต่ำ	1,000 บาท
ยอดคงเหลือขั้นต่ำ	0 บาท
หน่วยคิดเหลือขั้นต่ำ	100
ระยะเวลาการรับเงิน	T+5 คือ 5 วันทำการหลังจากค่าขายคืน
วันทำการขายคืน	วันทำการขายคืน

**ข้อมูลเชิงสถิติ**

Maximum Drawdown	-40.79%
Recovering Period	n/a
FX Hedging	90.60%
Sharpe Ratio	0.00
Alpha	-3.10
Beta	0.86

**หมายเหตุ**

ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน คือ 5 วันทำการนับจากวันทำการ โดยไม่นับรวมวันหยุดต่างประเทศ

**ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV รวม VAT)**

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
ค่าธรรมเนียมการจัดการ	1.8725	1.8725
รวมค่าใช้จ่าย	2.6750	2.0500

**หมายเหตุ****การจัดสรรภาระลงทุนในกลุ่มอุดสาหกรรม (% of NAV)**

Industrials	22.18
Financials	19.06
Health Care	14.08
Information Technology	13.75
Consumer Discretionary	9.68

**ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหุ้น (% ของมูลค่าหุ้นน่าวယูลงทุน รวม VAT)**

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
ค่าธรรมเนียมเสนอขาย	3.00	1.50
ค่าธรรมเนียมรับซื้อคืน	0.00	0.00
ภาษีที่ต้องเสียเมื่อขายหุ้นเข้า	0.00	0.00
ค่าธรรมเนียมสับเปลี่ยนออก	0.00	0.00
ค่าธรรมเนียมการโอนหุ้นนำ		

**หมายเหตุ**

- กรณีการสับเปลี่ยนเข้า ผู้ถือหุ้นนำยังต้องเสียค่าธรรมเนียมเสนอขายด้วย
- ค่าธรรมเนียมการโอนหุ้นนำ 300 บาทต่อ 1,000 หน่วยหรือเศษของ 1,000 หน่วย

**สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน (% of NAV)**

หน่วยลงทุน	98.35
เงินฝากธนาคารและอื่นๆ	1.65

**ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก (% of NAV)**

abrdn SICAV I - North American Smaller Companies Fund	98.35
-------------------------------------------------------	-------

**ทรัพย์สินที่ลงทุนของกองทุนหลัก 5 อันดับแรก (% of NAV)**

Integer Holdings Corp	3.10
Onto Innovation Inc	2.99
WNS Holdings Ltd	2.93
Workiva Inc	2.85
Wintrust Financial Corp	2.81

## การลงทุนในกองทุนอื่นเกินกว่า 20 % (กองในประเทศไทยและกองต่างประเทศ)

ชื่อกองทุน	ไม่มี	weblink	
ชื่อกองทุน	ไม่มี	weblink	
ชื่อกองทุน	abrdn SICAV I - North American Smaller Companies Fund	ISIN code	LU1725895533
		Bloomberg code	ABNAZ2A LX
ชื่อกองทุน	ไม่มี	ISIN code	
		Bloomberg code	



## คำเตือน

Maximum Drawdown เปอร์เซ็นต์ผลขาดทุนสูงสุดของกองทุนรวมในระยะเวลา 5 ปีข้อนหลัง (หรือตั้งแต่จัดตั้งกองทุนกรณีที่ยังไม่ครบ 5 ปี) โดยวัดจากระดับ NAV ต่อหันน่วยที่จุดสูงสุดไปจนถึงจุดต่ำสุดในช่วงที่ NAV ต่อหันน่วยปั้บตัวลดลง ค่า Maximum Drawdown เป็นชี้อ้อมูลที่ช่วยให้ทราบถึงความเสี่ยงที่อาจจะขาดทุนจากการลงทุนในกองทุนรวม Recovering Period ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาดังต่อไปนี้ ค่าrecovering period คือระยะเวลาที่กองทุนฟื้นตัวกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นได้ FX Hedging เปอร์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการนำมารวมกับความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตของกองทุนในช่วงเวลาหนึ่ง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อห้องลักษณะที่ต่ำกว่าและรวมของมูลค่าการขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 1 ปีหารด้วยมูลค่า NAV ของกองทุนรวมเฉลี่ยในรอบระยะเวลาเดียวกัน กองทุนรวมที่มีค่า portfolio turnover สูง ปัจจัยที่สำคัญคือการซื้อขายหลักทรัพย์ที่สูง จึงต้องพิจารณาเบริญเพิ่มกับผลการดำเนินงานของกองทุนรวมเพื่อประเมิน ความถี่มั่นคงของการซื้อขายหลักทรัพย์ต่อๆ กันไป

Sharpe Ratio อัตราส่วนระหว่างผลตอบแทนส่วนเพิ่มของกองทุนรวมเบริญเพิ่มกับความเสี่ยงจากการลงทุน โดยคำนวณจากผลต่างระหว่างอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมกับอัตราผลตอบแทนที่ปราศจากความเสี่ยง (risk-free rate) เบริญเพิ่มกับค่าเบี่ยงเบนมาตรฐาน (standard deviation) ของกองทุนรวม ค่า Sharpe Ratio สะท้อนถึงอัตราผลตอบแทนที่ก่อขึ้นเพื่อชดเชยภาระความเสี่ยงที่กองทุนรวมรับมา โดยกองทุนรวมที่มีค่า Sharpe Ratio สูงกว่าจะเป็นกองทุนที่มีประสิทธิภาพในการบริหารจัดการลงทุนที่ดีกว่า เนื่องจากได้รับผลตอบแทนส่วนเพิ่มที่สูงกว่าภายในระยะเวลาเดียวกัน

Alpha ผลตอบแทนส่วนภัยของกองทุนรวมเพื่อเบริญเพิ่มกับดัชนีชี้วัด (benchmark) โดยค่า Alpha ที่สูง หมายถึง กองทุนสามารถสร้างผลตอบแทนได้สูงกว่าดัชนีชี้วัด ซึ่งเป็นผลจากประสิทธิภาพของห้องลักษณะการลงทุนในการคัดเลือกห้องห้องที่เหมาะสม

Beta ระดับและทิศทางการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุน โดยเบริญเพิ่มกับอัตราผลตอบแทนของคลาด Beta น้อยกว่า 1 แสดงว่า หลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนน้อยกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของคลุมหลักทรัพย์ของคลาด Beta หากมากกว่า 1 แสดงว่า หลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนมากกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของคลุมหลักทรัพย์ของคลาด

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

Yield to Maturity อัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในตราสารหนี้โดยอัจฉริยะที่จะได้รับในอนาคตตลอดอายุตราสารและเงินต้นที่จะได้รับคืน นำมาคิดลดเป็นมูลค่าปัจจุบัน โดยใช้วัดอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมตราสารหนี้ จำนวนจากคาดเดาได้ต่อไปนี้ หักภาษีของ Yield to Maturity ของตราสารหนี้จะลดลงที่กองทุนรวม การลงทุน และเนื่องจาก Yield to Maturity มีหน่วยมาตราฐานเป็นเบอร์เซ็นต์ต่อปี จึงสามารถนำไปใช้เบริญเพิ่มกับอัตราผลตอบแทนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีอยู่เดิม ของตราสารหนี้นั้นๆ ที่กองทุนรวมได้รับ

## สอบถามข้อมูลเพิ่มเติมโปรดติดต่อ

บริษัท หลักทรัพย์จัดการกองทุน อเบอร์ดิน (ประเทศไทย) จำกัด  
โทรศัพท์ 662 352 3388 <https://www.abrdn.com/th-th/investor>  
อาคารบางกอกซิตี้ทาวเวอร์ ชั้น 28 เลขที่ 179 ถนนสาทรใต้  
แขวงทุ่งมหาเมฆ กรุงเทพฯ 10120

ABAGS-SSF

กองทุนเปิด อเบอร์ดีน อเมริกัน โกรธ - สมอลเลอร์ คอมพานี พันด์  
- ชนิดเพื่อการออม

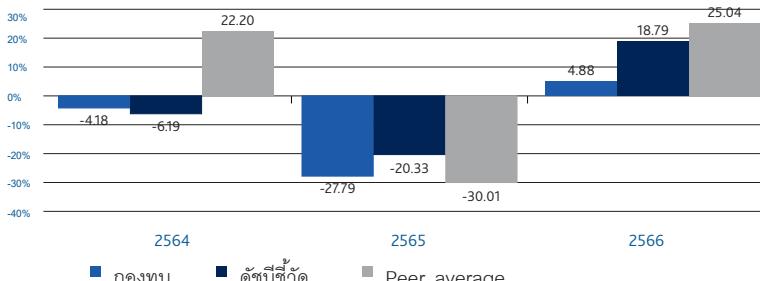
## ประเภทกองทัพร่วม /กลุ่มกองทัพร่วม

- กองทุนรวมตราสารทุน
  - กองทุนรวมฟีเดอร์ (feeder fund)
  - กองทุนรวมเพื่อการออม
  - กลุ่ม US Equity

## นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- ลงทุนในเนมเยลลงทุนของกองทุนต่างประเทศ ชื่อ abrdn SICAV I - North American Smaller Companies Fund Z Acc USD ซึ่งบริหารด้วยการโดย abrdn Investments Luxembourg S.A. โดยมี net exposure เลี้ยงในกองบันก์ซึ่งไม่ต่างกว่าห้าอย่าง 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน
  - กองทุนเหล่านี้มีวัตถุประสงค์ในการลงทุนเพื่อสร้างผลตอบแทนตามในระยะยาว โดยจะลงทุนอย่างน้อยร้อยละ 70 ของทรัพย์สินของกองทุนในตราสารทุนและหลักทรัพย์ที่เกี่ยวข้องกับหุ้นตราสารทุน (equities or equities related securities) ของบริษัทขนาดกลางที่คาดว่าเป็นหัวใจสำคัญในตลาดทุนทั่วโลกหรือในภูมิภาคที่ขยายตัวอย่างรวดเร็วและมีแนวโน้มเจิดจรัสที่จะประสบความสำเร็จทางการเงินในระยะหนึ่งหรือสองปี หรือในภูมิภาคที่มีรายได้ให้หรือกำไรในสัดส่วนที่น่าประทับใจจากการดำเนินงานหรือเม็ดเดือนดา หรือบริษัทที่มีรายได้หรือกำไรในสัดส่วนที่น่าประทับใจจากการดำเนินงานหรือเม็ดเดือนดา หรือบริษัทที่มีรายได้หรือกำไรในสัดส่วนที่น่าประทับใจในระยะต่อไป
  - กองทุนได้รับมติพิเศษจากผู้ถือหุ้นว่าลงทุนให้มากองทุนเปิด บลเอฟดี อเอนจิเนีย โภค พันด์ (ABAG) มาควบเข้าด้วยกับกองทุน โดยมีบริษัทด้วยการได้รับเงินการโอนทรัพย์สิน สิทธิ์ และหน้าที่ทั้งหมดของกองทุน ABAG ภายหลังกองทุน ABAGS-M-T ตั้งแต่วันที่ 20 เมษายน 2566
  - กองทุนมุ่งหวังให้ผลประกอบการเคลื่อนไหวตามของทุนหลัก โดยกองทุนเหล่านี้มีกลยุทธ์การลงทุนเพื่อมุ่งหวังให้ผลประกอบการสูงกว่าั้นชั้นเริ่ด (active management)

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปกติทุน (%ต่อปี)



	ตั้งแต่ต้นปี	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี
กองทุน	-1.09	19.51	-2.14	-2.59
ตัวบันทึกด้วยตัวเอง	-3.29	21.67	1.54	7.54
ค่าเชลี่ยนกลุ่มเดียวกัน	0.72	17.17	3.76	17.53
ความผันผวนกองทุน	15.10	18.63	18.54	18.15
ความผันผวนตัวบันทึกด้วยตัวเอง	18.37	22.79	20.36	19.76
	3 ปี	5 ปี	10 ปี	ตั้งแต่จัดตั้ง กองทุน
กองทุน	N/A	N/A	N/A	-14.44
ตัวบันทึกด้วยตัวเอง	N/A	N/A	N/A	-6.91
ค่าเชลี่ยนกลุ่มเดียวกัน	1.14	8.15	8.71	
ความผันผวนกองทุน	N/A	N/A	N/A	23.01
ความผันผวนตัวบันทึกด้วยตัวเอง	N/A	N/A	N/A	24.28

ระดับความเสี่ยง

ระดับความเสี่ยง

ตำแหน่ง	1	2	3	4	5	6	7	8	สูง
---------	---	---	---	---	---	---	---	---	-----

ເສື່ອງສູງ

୧୮୭

ลงทุนในตราสารทุนเป็นหลักโดยเฉลี่ยในรอบปีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม

วันจัดทำเป็นของทุน	03/11/2015
วันเริ่มต้น class	16/11/2021
นโยบายการจ่ายเงินปันผล	ไม่จ่ายเงินปันผล
อายุกองทุน	ไม่กำหนด

ผู้จัดการกองทัพร่วม

- 1 นส. ดรุณรัตน์ กิยโยดิลกชัย (01/12/2021)  
2 นส. ดวงกิตา แม่เต้า (18/10/2021)

ଶ୍ରୀମଦ୍ଭଗବତ

ดัชนี Russell 2000 Index 100.00%

ข้ออ้างว่าห้ามนำเข้าสินค้าที่ไม่ได้รับอนุญาต แต่ก็สามารถนำเข้ามาขายได้ เช่น ยาเสพติด ยาบูโร ยาห้ามนำเข้าประเทศ ฯลฯ ทำให้เกิดปัญหาด้านอาชญากรรมและสุขภาพ รวมถึงผลกระทบทางเศรษฐกิจ ดังนั้น จึงควรดำเนินการตรวจสอบอย่างเคร่งครัด ไม่ใช่แค่การห้ามนำเข้าสินค้า แต่ควรมีมาตรการเฝ้าระวังและดำเนินการตามกฎหมายอย่างเคร่งครัด ไม่ให้มีการหลบเลี่ยงกฎหมาย

ตัวชี้วัดแสดงในรูปสกุลเงิน USD ซึ่งแตกต่างจากสกุลเงินบาทของกองทุน  
ทั้งนี้ไม่ใช่เป็นเพียงผลการดำเนินงานหรือความผันผวนของกอง  
ทุนกับดัชนีหุ้น ควรใช้ข้อมูลที่อยู่ในรูปสกุลเงินเดียวทั้งหมดให้เปรียบเทียบ  
ได้โดยปราศจากการผลิตต่างจากความแตกต่างของตัวเลขแปลงเป็น

## คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
  - ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวม มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต มีบริษัทแม่ด้วยให้ทำตามกฎหมาย

หนังสือชีววนจนันเต็ม

ผู้ลงทุนสามารถตีเค้าเครื่องมือบริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่องได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



**การซื้อขายหุ้นในวันลงทุน**

วันทำการวันที่ซื้อ	ทุกวันทำการ
เวลาทำการ	9.00น. - 15.30น.
การซื้อคั้งแลกขั้นต่ำ	1,000 บาท
จำนวนคั้งแลกต่อไป	1,000 บาท
ขั้นต่ำ	

**การขายคืนหุ้นในวันลงทุน**

วันทำการขายคืน	ทุกวันทำการ
เวลาทำการ	9.00น. - 13.00น.
การขายคืนขั้นต่ำ	0 บาท
ยอดคงเหลือขั้นต่ำ	0 บาท
หน่วยคงเหลือขั้นต่ำ	0
ระยะเวลาการรับเงิน	T+5 คือ 5 วันทำการหลังจากค่าขายคืน
วันทำการขายคืน	วันทำการขายคืน

**ข้อมูลเชิงสถิติ**

Maximum Drawdown	-40.32%
Recovering Period	n/a
FX Hedging	90.60%
Sharpe Ratio	-0.04
Alpha	-9.47
Beta	0.89

**หมายเหตุ**

ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน คือ 5 วันทำการนับจากวันทำการ โดยไม่นับรวมวันหยุดต่างประเทศ

**ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV รวม VAT)**

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
ค่าธรรมเนียมการจัดการ	1.8725	1.8725
รวมค่าใช้จ่าย	2.6750	2.0500

**หมายเหตุ****การจัดสรรภาระลงทุนในกลุ่มอุดสาหกรรม (% of NAV)**

Industrials	22.18
Financials	19.06
Health Care	14.08
Information Technology	13.75
Consumer Discretionary	9.68

**ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหุ้น (% ของมูลค่าหุ้นน่าวယูลงทุน รวม VAT)**

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
ค่าธรรมเนียมเสนอขาย	3.00	0.00
ค่าธรรมเนียมรับซื้อคืน	2.00	0.00
ค่าสับเปลี่ยนหุ้นน่าวယูลงทุนเข้า	0.00	0.00
ค่าธรรมเนียมสับเปลี่ยนออก		
ค่าธรรมเนียมการโอนหุ้น		

**หมายเหตุ**

- ค่าธรรมเนียมการรับซื้อคืน บัญชีบันไดเรียกเก็บเงินแต่กรณีสับเปลี่ยนไปบริษัทจัดการอื่นเรียกเก็บ 1% ของมูลค่าหุ้นน่าวယูลงทุนของวันทำการก่อนหน้า
- ค่าสับเปลี่ยนหุ้นน่าวယูลงทุนออก มีผลตั้งแต่วันที่ 1 ปีครึ่งรายละเฉียดในห้องล็อครหัสฉบับเดิม
- ค่าธรรมเนียมการโอนหุ้นน่าวယูลงทุน เรียกเก็บ 300 บาทต่อ 1,000 หน่วย หรือ เศษของ 1,000 หน่วย

**สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน (% of NAV)**

หน่วยลงทุน	98.35
เงินฝากธนาคารและอื่นๆ	1.65

**ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก (% of NAV)**

abrdn SICAV I - North American Smaller Companies Fund	98.35
-------------------------------------------------------	-------

**ทรัพย์สินที่ลงทุนของกองทุนหลัก 5 อันดับแรก (% of NAV)**

Integer Holdings Corp	3.10
Onto Innovation Inc	2.99
WNS Holdings Ltd	2.93
Workiva Inc	2.85
Wintrust Financial Corp	2.81

## การลงทุนในกองทุนอื่นเกินกว่า 20 % (กองในประเทศไทยและกองต่างประเทศ)

ชื่อกองทุน	ไม่มี	weblink	
ชื่อกองทุน	ไม่มี	weblink	
ชื่อกองทุน	abrdn SICAV I - North American Smaller Companies Fund	ISIN code	LU1725895533
		Bloomberg code	ABNAZ2A LX
ชื่อกองทุน	ไม่มี	ISIN code	
		Bloomberg code	



## คำเตือน

Maximum Drawdown เปอร์เซ็นต์ผลขาดทุนสูงสุดของกองทุนรวมในระยะเวลา 5 ปีข้อนหลัง (หรือตั้งแต่จัดตั้งกองทุนกรณีที่ยังไม่ครบ 5 ปี) โดยวัดจากระดับ NAV ต่อห้นวยที่จุดสูงสุดไปจนถึงจุดต่ำสุดในช่วงที่ NAV ต่อห้นวยปรับตัวลดลง ค่า Maximum Drawdown เป็นชี้อ้อมูลที่ช่วยให้ทราบถึงความเสี่ยงที่อาจมีขึ้นจากการลงทุนในกองทุนรวม Recovering Period ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาดังต่อไปนี้ ค่า recovering period คือระยะเวลาที่กองทุนฟื้นตัวกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นได้ FX Hedging เปอร์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการบังกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตของกองทุนในช่วงเวลาหนึ่ง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อห้องลักษณะที่ต่ำกว่าและรวมของมูลค่าการขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 1 ปีหารด้วยมูลค่า NAV ของกองทุนรวมเฉลี่ยในรอบระยะเวลาเดียวกัน กองทุนรวมที่มีค่า portfolio turnover สูง ปัจจัยที่สำคัญคือการซื้อขายหลักทรัพย์โดยครั้งของผู้ซื้อจัดการกองทุนและทำให้มีต้นทุนการซื้อขายหลักทรัพย์ที่สูง จึงต้องพิจารณาเบริญบันกับผลการดำเนินงานของกองทุน รวมเพื่อประเมิน ความถี่มั่นคงค่าของราคารือขายหลักทรัพย์ดังกล่าว

Sharpe Ratio อัตราส่วนระหว่างผลตอบแทนส่วนเพิ่มของกองทุนรวมเบริญบันกับความเสี่ยงจากการลงทุน โดยคำนวณจากผลต่างระหว่างอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวม กับ อัตราผลตอบแทนที่ปราศจากความเสี่ยง (risk-free rate) เบริญบันกับค่าเบริญบันมาตรฐาน (standard deviation) ของกองทุนรวม ค่า Sharpe Ratio สะท้อนถึงอัตราผลตอบแทนที่ก่อขึ้นเพื่อชดเชยภาระความเสี่ยงที่กองทุนรวมรับมา โดยกองทุนรวมที่มีค่า Sharpe Ratio สูงกว่าจะเป็นกองทุนที่มีประสิทธิภาพในการบริหารจัดการลงทุนที่ดีกว่า เนื่องจากได้รับผลตอบแทนส่วนเพิ่มที่สูงกว่าภายในระยะเวลาเดียวกัน

Alpha ผลตอบแทนส่วนภัยของกองทุนรวมเพื่อเบริญบันกับดัชนีชี้วัด (benchmark) โดยค่า Alpha ที่สูง หมายถึง กองทุนสามารถสร้างผลตอบแทนได้สูงกว่าดัชนีชี้วัด ซึ่งเป็นผลจากประสิทธิภาพของผู้จัดการกองทุนในการคัดเลือกหุ้นหรือหุ้นที่เหมาะสม

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

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

Yield to Maturity อัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในตราสารหนี้โดยอัจฉริยะ คำนวณโดยใช้ต้นทุนที่จะได้รับในอนาคตตลอดอายุตราสารและเงินต้นที่จะได้รับคืน นำมาคิดลดเป็นมูลค่าปัจจุบัน โดยใช้วัดอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมตราสารหนี้ คำนวณจากคาดการณ์ที่ต่อไปนี้ ค่า yield to maturity ของตราสารหนี้จะลดลงเมื่ออายุของตราสารนั้นลดลง แต่จะเพิ่มขึ้นเมื่ออายุของตราสารนั้นเพิ่มขึ้น การลงทุน และเนื่องจาก Yield to Maturity มีหน่วยมาตราฐานเป็นเบอร์เซ็นต์ต่อปี จึงสามารถนำไปใช้เบริญบันกับอัตราผลตอบแทนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีอายุต่างกันได้

## สอบถามข้อมูลเพิ่มเติมโปรดติดต่อ

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