

# ABEG

## กองทุนเปิด อเบอร์ดิน ยูโรเปียน ซัสเทนเนเบิล เอกควิตี้ ฟันด์

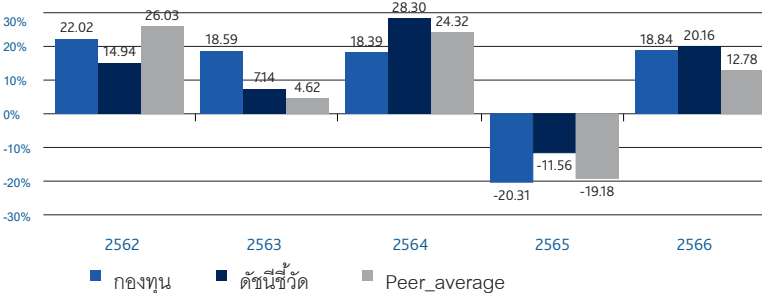
### ประเภทกองทุนรวม /กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมตราสารทุน
- กองทุนรวมฟีดเดอร์ (feeder fund)
- กลุ่ม European Equity

### นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- ลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนต่างประเทศ ชื่อ abrdn SICAV I - European Sustainable Equity Fund Z Acq EUR ซึ่งบริหารจัดการโดย abrdn Investments Luxembourg S.A. โดยมี net exposure เฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่ต่ำกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน
- กองทุนหลักมีนโยบายเพิ่มมูลค่าผลตอบแทนระยะยาวให้ผู้ลงทุนด้วยการลงทุนในอัตราอย่างน้อยร้อยละ 90 ของทรัพย์สินของกองทุนในหลักทรัพย์ประเภทตราสารแห่งทุนหรือตราสารที่เกี่ยวข้องกับตราสารแห่งทุน (equities or equities related securities) ของบริษัทที่มีการจดทะเบียนซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์หรือศูนย์ซื้อขายหลักทรัพย์ หรือจดทะเบียนจัดตั้งในทวีปยุโรป หรือประกอบกิจการในยุโรปหรือบริษัทที่มีสัดส่วนรายได้หรือกำไรจากการประกอบกิจการหรือมีสัดส่วนของทรัพย์สินอยู่ที่ทวีปยุโรปอย่างมีนัยสำคัญ ทั้งนี้กองทุนส่งเสริมการลงทุนในบริษัทที่มีการดำเนินงานสิ่งแวดล้อมหรือสังคม แต่กองทุนหลักไม่ได้มีนโยบายการลงทุนที่จัดเป็นประเภทการลงทุนที่ยั่งยืน (sustainable investment objective)
- กองทุนมุ่งหวังให้ผลประโยชน์การเคลื่อนไหวตามกองทุนหลัก โดยกองทุนหลักมีกลยุทธ์การลงทุนเพื่อมุ่งหวังให้ผลประโยชน์การสูงกว่าดัชนีชี้วัด (active management)

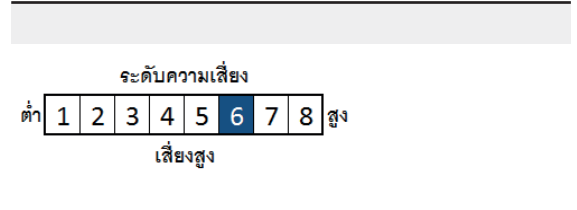
### ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (%ต่อปี)



### ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด (อัตราเฉลี่ยต่อปีสำหรับผลการดำเนินงานที่แสดงช่วงเวลาตั้งแต่ 1 ปีขึ้นไป)

	ตั้งแต่ต้นปี	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี
กองทุน	14.37	14.37	24.17	24.02
ดัชนีชี้วัด	11.80	11.80	16.66	22.58
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	9.38	9.38	17.22	12.50
ความผันผวนกองทุน	13.38	13.38	13.99	15.03
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	10.60	10.60	11.17	12.24
	3 ปี	5 ปี	10 ปี	ตั้งแต่จัดตั้งกองทุน
กองทุน	8.67	11.06	5.20	2.15
ดัชนีชี้วัด	12.69	12.07	6.53	4.49
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	4.86	7.94	6.08	
ความผันผวนกองทุน	19.39	19.83	17.39	20.72
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	21.08	22.11	19.35	21.90

### ระดับความเสี่ยง



ความเสี่ยง  
ลงทุนในตราสารทุนเป็นหลักโดยเฉลี่ยในรอบปีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของ NAV

### ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน	06/12/2006
วันเริ่มต้น class	06/12/2006
นโยบายการจ่ายเงินปันผล	ไม่จ่ายเงินปันผล
อายุกองทุน	ไม่กำหนด

### ผู้จัดการกองทุนรวม

1. น.ส. ดร.นริศนา ภิโยชิตลภชัย (01/12/2021)
2. น.ส. ดวงธิดา แซ่แต้ (18/10/2021)

### ดัชนีชี้วัด

ดัชนี FTSE World Europe 100.00%

อ้างอิงตัวชี้วัดเพื่อเปรียบเทียบกับผลการดำเนินงานของกองทุนรวม กองทุนมีนโยบายป้องกันความเสี่ยงด้านอัตราแลกเปลี่ยนตามดุลยพินิจผู้จัดการกองทุน โดยปัจจุบันกองทุนไม่ใช้เครื่องมือป้องกันความเสี่ยงอัตราแลกเปลี่ยน ตัวชี้วัดปรับด้วยอัตราแลกเปลี่ยนเป็นสกุลเงินบาท

### 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	1,000 บาท
ยอดคงเหลือขั้นต่ำ	0 บาท
หน่วยคงเหลือขั้นต่ำ	100
ระยะเวลาการรับเงิน	T+5 คือ 5 วันทำการหลังจากการขายคืน

**ข้อมูลเชิงสถิติ**

Maximum Drawdown	-29.02%
Recovering Period	341 วัน
FX Hedging	0.00%
Sharpe Ratio	0.02
Alpha	1.56
Beta	0.51

**หมายเหตุ**

ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน คือ 5 วันทำการนับจากวันทำการ โดยไม่นับรวมวันหยุดต่างประเทศ

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

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
ค่าธรรมเนียมการจัดการ	1.8725	1.8725
รวมค่าใช้จ่าย	2.6750	2.0900

**หมายเหตุ**

**การจัดสรรการลงทุนในต่างประเทศ (% of NAV)**

สหราชอาณาจักร	17.22
ฝรั่งเศส	16.78
เนเธอร์แลนด์	15.00
เยอรมนี	14.07
เดนมาร์ก	10.09

**ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าหน่วยลงทุน รวม VAT)**

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
ค่าธรรมเนียมเสนอขาย	3.00	1.50
ค่าธรรมเนียมรับซื้อคืน	0.00	0.00
การปรับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า	0.00	0.00
ค่าธรรมเนียมปรับเปลี่ยนออก	0.00	0.00
ค่าธรรมเนียมการโอนหน่วย		

**หมายเหตุ**

- กรณีการปรับเปลี่ยนเข้า ผู้ถือหน่วยลงทุนจะต้องเสียค่าธรรมเนียมเสนอขายด้วย
- ค่าธรรมเนียมการโอนหน่วยลงทุน เรียกเก็บ 300 บาทต่อ 1,000 หน่วยหรือเศษของ 1,000 หน่วย

**การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม (% of NAV)**

Financials	25.45
Industrials	17.10
Information Technology	15.56
Health Care	14.45
Consumer Staples	9.42

**สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน (% of NAV)**

หน่วยลงทุน	97.71
เงินฝากธนาคารและอื่นๆ	2.29

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

abrdn SICAV I - European Sustainable Equity Fund	97.71
--	-------

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

ASML Holding NV	8.03
Novo Nordisk A/S	8.02
RELX PLC	4.96
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	4.92
Adyen NV	4.53

**การลงทุนในกองทุนอื่นเกินกว่า 20 % (กองในประเทศและกองต่างประเทศ)**

ชื่อกองทุน	ไม่มี	weblink	
ชื่อกองทุน	ไม่มี	weblink	
ชื่อกองทุน	abrdn SICAV I - European Sustainable Equity Fund	ISIN code	LU0278923536
		Bloomberg code	ABEEZAE LX
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 โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์กับผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 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 โดยใช้ตัวอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมตราสารหนี้ 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