

# ABV กองทุนเปิด อเบอร์ดิน แวลู

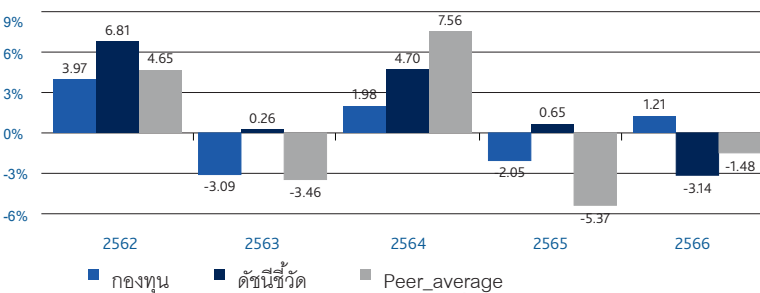
## ประเภทกองทุนรวม /กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมผสม
- กลุ่ม Moderate Allocation

## นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- ลงทุนในหลักทรัพย์และหรือทรัพย์สินอื่นเป็นหรือเกี่ยวข้องกับตราสารแห่งทุนและตราสารกึ่งหนี้ กึ่งทุน รวมทั้งตราสารแห่งหนี้ ทั้งทางภาครัฐบาล รัฐวิสาหกิจ และภาคเอกชนและหลักทรัพย์ หรือตราสารแห่งหนี้ที่เสนอขายในต่างประเทศที่เป็นเงินสกุลบาท
- กองทุนอาจลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมอสังหาริมทรัพย์หรือหน่วยทรัสต์ของทรัสต์ เพื่อการลงทุนในอสังหาริมทรัพย์ (REITs) หรือหน่วยลงทุนของกองทุนรวมโครงสร้างพื้นฐาน (Infrastructure fund)
- ผู้จัดการกองทุนสามารถปรับกลยุทธ์การลงทุนให้เหมาะสมกับสภาพการณ์ในแต่ละขณะได้โดยคำนึงถึงผลประโยชน์ของผู้ถือหน่วยเป็นสำคัญ
- กองทุนมีกลยุทธ์การลงทุนมุ่งหวังให้ผลประกอบการสูงกว่าดัชนีชี้วัด

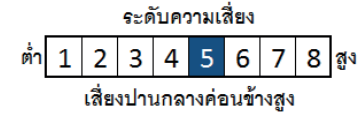
## ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (%ต่อปี)



## ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด (อัตราเฉลี่ยต่อปีสำหรับผลการดำเนินงานที่แสดง ช่วงเวลาดังแต่ 1 ปีขึ้นไป)

|                          | ตั้งแต่ต้นปี | 3 เดือน | 6 เดือน | 1 ปี                 |
|--------------------------|--------------|---------|---------|----------------------|
| กองทุน                   | 0.43         | -0.48   | 2.78    | -1.73                |
| ดัชนีชี้วัด              | -0.49        | -0.31   | 1.04    | -2.30                |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน | 0.73         | 0.36    | 2.64    | 0.55                 |
| ความผันผวนกองทุน         | 3.65         | 3.48    | 3.87    | 4.90                 |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด    | 3.76         | 3.87    | 3.75    | 4.18                 |
|                          | 3 ปี         | 5 ปี    | 10 ปี   | ตั้งแต่จัดตั้งกองทุน |
| กองทุน                   | 0.38         | -0.01   | 1.24    | 6.56                 |
| ดัชนีชี้วัด              | -0.40        | 1.16    | 2.85    | 5.76                 |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน | -1.68        | -0.49   | 1.26    |                      |
| ความผันผวนกองทุน         | 4.91         | 6.04    | 4.97    | 8.54                 |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด    | 5.07         | 6.40    | 5.93    | 8.99                 |

## ระดับความเสี่ยง



เสี่ยงปานกลางค่อนข้างสูง  
ลงทุนในตราสารทุน ตราสารหนี้และ/หรือทรัพย์สินทางเลือกโดยมีสัดส่วน การลงทุนในตราสารทุนน้อยกว่า 80 % ของ NAV

## ข้อมูลกองทุนรวม

|                        |                  |
|------------------------|------------------|
| วันจดทะเบียนกองทุน     | 13/11/2003       |
| วันเริ่มต้น class      | 13/11/2003       |
| นโยบายการจ่ายเงินปันผล | ไม่จ่ายเงินปันผล |
| อายุกองทุน             | ไม่กำหนด         |

## ผู้จัดการกองทุนรวม

- 1 นาย พงศ์ธาริน ทรัพย์ยานนท์ (15/08/2005)
- 2 น.ส. ดรฤณรัตน์ ภัยโยคิลักษณ์ (01/12/2021)

## ดัชนีชี้วัด

ดัชนีผลตอบแทนรวมตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET TRI) 35.00%  
ผลตอบแทนรวมสุทธิของดัชนีพันธบัตรรัฐบาล Mark-to-Market ของสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย 29.25%  
ผลตอบแทนรวมของดัชนีพันธบัตรรัฐบาลระยะสั้นของสมาคมตราสารหนี้ไทย 29.25%  
ผลตอบแทนรวมสุทธิของดัชนีตราสารหนี้ภาคเอกชน Mark-to-Market ที่มีอันดับความน่าเชื่อถือของผู้ออกตราสารอยู่ในระดับ BBB ขึ้นไป ของสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย 6.50%  
อ้างอิงตัวชี้วัดเพื่อเปรียบเทียบกับผลการดำเนินงานของกองทุนรวม

## 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    | 0 บาท                              |
| ยอดคงเหลือขั้นต่ำ   | 0 บาท                              |
| หน่วยคงเหลือขั้นต่ำ | 0                                  |
| ระยะเวลาการรับเงิน  | T+2 คือ 2 วันทำการหลังจากการขายคืน |

**ข้อมูลเชิงสถิติ**

|                            |         |
|----------------------------|---------|
| Maximum Drawdown           | -14.96% |
| Recovering Period          | n/a     |
| Sharpe Ratio               | -0.04   |
| Alpha                      | -0.51   |
| Beta                       | 0.66    |
| อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน | 16.28%  |

หมายเหตุ : อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน ณ วันที่ 29 มี.ค. 2567

**หมายเหตุ**

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

|                       |               |          |
|-----------------------|---------------|----------|
| ค่าธรรมเนียม          | สูงสุดไม่เกิน | เก็บจริง |
| ค่าธรรมเนียมการจัดการ | 1.0700        | 1.0700   |
| รวมค่าใช้จ่าย         | 2.6750        | 1.2400   |

**หมายเหตุ**

**การจัดสรรการลงทุนในต่างประเทศ (% of NAV)**

|     |        |
|-----|--------|
| ไทย | 100.00 |
|-----|--------|

**ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าหน่วยลงทุน รวม VAT)**

|                              |               |          |
|------------------------------|---------------|----------|
| ค่าธรรมเนียม                 | สูงสุดไม่เกิน | เก็บจริง |
| ค่าธรรมเนียมเสนอขาย          | 0.50          | 0.50     |
| ค่าธรรมเนียมรับซื้อคืน       | 0.25          | 0.25     |
| การปรับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า | 0.00          | 0.00     |
| ค่าธรรมเนียมรับเปลี่ยนแปลง   | 0.05          | 0.05     |
| ค่าธรรมเนียมการโอนหน่วย      |               |          |

**หมายเหตุ**

- กรณีปรับเปลี่ยนเข้า ผู้ถือหน่วยลงทุนจะต้องเสียค่าธรรมเนียมเสนอขายด้วย
- กรณีปรับเปลี่ยนออก ผู้ถือหน่วยลงทุนจะต้องเสียค่าธรรมเนียมรับซื้อคืนด้วย
- ค่าธรรมเนียมการรับซื้อคืน เฉพาะกรณีถือหน่วยลงทุนไม่เกิน 1 ปี
- ค่าธรรมเนียมการโอนหน่วยลงทุน เรียกเก็บ 200 บาทต่อรายการโอนหน่วยลงทุน

**การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม (% of NAV)**

|                                |      |
|--------------------------------|------|
| การแพทย์                       | 5.53 |
| เทคโนโลยีสารสนเทศและการสื่อสาร | 5.04 |
| อาหารและเครื่องดื่ม            | 4.99 |
| พาณิชย์                        | 3.69 |
| ท่องเที่ยวและสันทนาการ         | 3.35 |

**สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน (% of NAV)**

|                             |       |
|-----------------------------|-------|
| ตราสารทุน                   | 34.31 |
| พันธบัตรรัฐบาล              | 32.64 |
| หุ้นกู้ภาคเอกชน             | 27.81 |
| พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย | 3.98  |
| เงินฝากธนาคารและอื่นๆ       | 1.26  |

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

|                          |      |
|--------------------------|------|
| LB249A                   | 3.07 |
| บมจ. โรงพยาบาลพระรามเก้า | 3.00 |
| LB336A                   | 2.93 |
| AEON262A                 | 2.79 |
| บมจ. ฮิวแมนีต้า          | 2.64 |

**การจัดสรรการลงทุนตามอันดับความน่าเชื่อถือ (%)**

|              |       |          |               |
|--------------|-------|----------|---------------|
|              | Local | National | International |
| Gov bond/AAA | 37.54 |          |               |
| AA           | 7.07  |          |               |
| A            | 19.83 |          |               |

**การลงทุนในกองทุนอื่นเกินกว่า 20 % (กองในประเทศและกองต่างประเทศ)**

|            |       |                |
|------------|-------|----------------|
| ชื่อกองทุน | ไม่มี | weblink        |
| ชื่อกองทุน | ไม่มี | weblink        |
| ชื่อกองทุน | ไม่มี | ISIN code      |
|            |       | Bloomberg code |
| ชื่อกองทุน | ไม่มี | ISIN code      |
|            |       | Bloomberg code |

**คำเตือน**

Maximum Drawdown เปรอ์เซ็นต์ผลขาดทุนสูงสุดของกองทุนรวมในระยะเวลา 5 ปีย้อนหลัง (หรือตั้งแต่จัดตั้งกองทุนกรณีที่ยังไม่ครบ 5 ปี) โดยวัดจากระดับ NAV ต่อหน่วยที่จุดสูงสุดไปจนถึงจุดต่ำสุดในช่วงที่ NAV ต่อหน่วยปรับตัวลดลง ค่า Maximum Drawdown เป็นข้อมูลที่จะช่วยให้ทราบถึงความเสี่ยงที่อาจจะขาดทุนจากการลงทุนในกองทุนรวม 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 โดยใช้วิธีอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมตราสารหนี้ 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