

กองทุนเปิด แอสเซทพลัส สمول แอนด์ มิด แคป อีควิตี้ เพื่อการออม
Asset Plus Small and Mid Cap Equity Super Savings Fund (ASP-SME-MSSF) ชื่อย่อ class : ASP-SME-SSFX

ประเภทกองทุนรวม/กลุ่มกองทุนรวม

ประเภทกองทุนรวม : กองทุนรวมตราสารทุน/กองทุนรวมเพื่อการออม (SSF)/กองทุนรวมไม่มีการลงทุนในต่างประเทศ

กลุ่มกองทุนรวม : Equity General

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- กองทุนมีนโยบายที่จะลงทุนในหุ้นสามัญของบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย และ/หรือตลาดหลักทรัพย์ เอ็ม เอ ไอ ที่มีปัจจัยพื้นฐานดี และ/หรือมีแนวโน้มการเจริญเติบโตทางธุรกิจ โดยจะเน้นลงทุนในตราสารทุนของบริษัทขนาดกลางและขนาดเล็กรวมถึงหุ้นสามัญที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย และ/หรือตลาดหลักทรัพย์ เอ็ม เอ ไอ และ/หรือหุ้นที่อยู่ระหว่าง IPO เพื่อจดทะเบียนซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ดังกล่าว
- บริษัทขนาดกลางและขนาดเล็กสำหรับกองทุนนี้ ให้นหมายถึง บริษัทจดทะเบียนที่อยู่ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย และ/หรือตลาดหลักทรัพย์ เอ็ม เอ ไอ รวมถึงการจองซื้อหุ้นที่เสนอขายแก่ประชาชนทั่วไปเป็นครั้งแรก (IPO) ที่มี Market Cap ที่มีมูลค่าหลักทรัพย์ตามราคาตลาด (Market Capitalization) ไม่เกิน 80,000 ล้านบาท ณ วันที่ทำการก่อนหน้าวันที่กองทุนลงทุน
- กองทุนอาจลงทุนหรือมีไว้ในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) เพื่อเพิ่มประสิทธิภาพการลงทุน (Efficient Portfolio Management) ซึ่งรวมถึงการป้องกันความเสี่ยงที่มีอยู่จากการลงทุน
- กองทุนมุ่งหวังให้ผลประโยชน์สูงกว่าดัชนีชี้วัด (active management)



ลงทุนในตราสารทุนเป็นหลัก โดยเฉลี่ยในรอบปีไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน : 21 เม.ย. 63

วันเริ่มต้น class : 21 เม.ย. 63

นโยบายการจ่ายเงินปันผล : ไม่จ่าย

อายุกองทุน : ไม่กำหนด

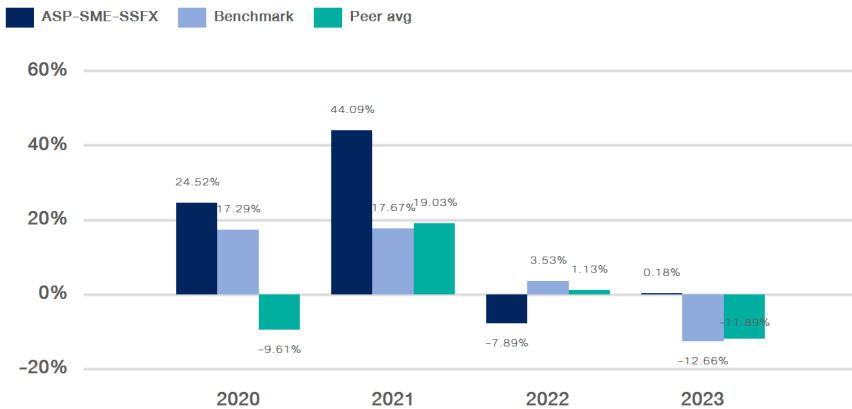
ผู้จัดการกองทุน

น.ส. ทิพย์วดี อภิชัยสิริ (ตั้งแต่ 21 เม.ย. 63)

ดัชนีชี้วัด

ดัชนีผลตอบแทนรวมตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET TRI) ในสัดส่วน 100%

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (%ต่อปี)



ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบบิกทวด (%ต่อปี)

	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี
กองทุน	-1.74	1.90	-12.33	-3.01
ดัชนีชี้วัด	-2.54	0.05	-11.35	-12.75
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	-2.59	0.14	-10.54	-10.54
ความผันผวนกองทุน	11.86	12.58	14.62	15.29
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	10.41	10.13	11.63	12.08
	3 ปี	5 ปี	10 ปี	ตั้งแต่จัดตั้งกองทุน
กองทุน	5.84	N/A	N/A	13.43
ดัชนีชี้วัด	0.05	N/A	N/A	5.20
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	-1.09	N/A	N/A	N/A
ความผันผวนกองทุน	13.47	N/A	N/A	14.21
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	11.34	N/A	N/A	13.21

คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวมมิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต : ได้รับการรับรองจาก CAC

จัดอันดับกองทุน Morningstar :



"ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือบริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่องได้บนหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม"

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



www.assetfund.co.th

การซื้อขายหน่วยลงทุน

วันทำการซื้อ : ไม่เปิดให้ซื้อหน่วยลงทุน เนื่องจากกฎหมายกำหนดให้ซื้อได้ถึงวันที่ 30 มิ.ย. 2563 เท่านั้น

เวลาทำการ : ตั้งแต่เวลาเปิดทำการ - 15:30 น.

การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ : 5,000 บาท

การซื้อครั้งถัดไปขั้นต่ำ : 5,000 บาท

การขายคืนหน่วยลงทุน

วันทำการขายคืน : ทุกวันทำการ โดยเริ่มตั้งแต่วันที่ 1 ก.ค. 2563 เป็นต้นไป

เวลาทำการ : ตั้งแต่เวลาเปิดทำการ - 15:30 น.

การขายคืนขั้นต่ำ : 0 บาท

ยอดคงเหลือขั้นต่ำ : 0 บาท

ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน : T+3

หมายเหตุ : T+3 = 3 วันทำการ นับถัดจากวันทำการขายคืนหน่วยลงทุน

ข้อมูลเชิงสถิติ

Maximum Drawdown :	-19.13 %
Recovering Period :	-
Fx Hedging :	-
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน :	1.58 เท่า
Sharpe Ratio :	0.27
Alpha :	5.80 %
Beta :	0.86

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	1.99	1.61
รวมค่าใช้จ่าย	4.49	2.78

หมายเหตุ : - ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม หรือภาษีอื่นใด (ถ้ามี)

- อัตราที่เรียกเก็บจริงของรวมค่าใช้จ่ายเป็นข้อมูลตามรอบปีบัญชีล่าสุดของกองทุน

การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม 5 อันดับแรก

	% NAV
Food & Beverage	14.93
Market for alternative Investment	12.66
Commerce	11.89
Banking	9.01
Finance & Securities	7.85

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การขาย	1.50	0.00
การรับซื้อคืน	ไม่มี	ไม่มี
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า	1.50	0.00
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก	1.00	0.00
การโอนหน่วย	50.00	50.00

หมายเหตุ : - ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม หรือภาษีอื่นใด (ถ้ามี)

- ค่าธรรมเนียมการโอนหน่วยคิดเป็นบาท/รายการ

- หน่วยลงทุนเพื่อการออมไม่สามารถโอนหน่วยลงทุนได้เป็นไปตามที่กฎหมายกำหนด

ทั้งนี้ บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงจากกองทุนรวมและ/หรือจากผู้ถือ

หน่วยลงทุนเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน

	% NAV	ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก*	% NAV
ตราสารทุน	83.00	SAPPE	8.13
เงินฝาก/ตั๋วแลกเงิน	16.96	SISB	5.67
อื่นๆ	0.04	TCAP	4.90
		TISCO	4.11
		ICHI	4.11

หมายเหตุ:

*SAPPE : Sappe Public Company Limited, SISB : SISB Public Company Limited, TCAP : THANACHART CAPITAL PUBLIC COMPANY LIMITED, TISCO : TISCO FINANCIAL GROUP PUBLIC COMPANY LIMITED และ ICHI : ICHITAN GROUP Public Company Limited

- ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน ในปีที่จะจดทะเบียนกองทุนจะแสดงตั้งแต่วันที่จดทะเบียนกองทุนจนถึงสิ้นปีปฏิทิน

คำอธิบาย

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

Recovering Period ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาตั้งแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินลงทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลานานเท่าใด

FX Hedging เปรอ์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลานึง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์กับผลรวมของมูลค่าการขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 1 ปีหารด้วยมูลค่า NAV ของกองทุนรวมเฉลี่ยในรอบระยะเวลาดังกล่าว กองทุนที่มีค่า portfolio turnover สูง บ่งชี้ถึงการซื้อขายหลักทรัพย์บ่อยครั้งของผู้จัดการกองทุนและทำให้มีต้นทุนการซื้อขายหลักทรัพย์ที่สูง จึงต้องพิจารณาเปรียบเทียบกับผลการดำเนินงานของกองทุนรวมเพื่อประเมินความคุ้มค่าของการซื้อขายหลักทรัพย์ดังกล่าว

Sharpe Ratio อัตราส่วนระหว่างผลตอบแทนส่วนเพิ่มของกองทุนรวมเปรียบเทียบกับความเสี่ยงจากการลงทุน โดยคำนวณจากผลต่างระหว่างอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมกับอัตราผลตอบแทนที่ปราศจากความเสี่ยง (risk-free rate) หารด้วยค่าเบี่ยงเบนมาตรฐาน (standard deviation) ของกองทุนรวม ค่า Sharpe Ratio สะท้อนถึงอัตราผลตอบแทนที่กองทุนรวมควรได้รับเพิ่มขึ้นเพื่อชดเชยกับความเสี่ยงที่กองทุนรวมรับมา โดยกองทุนที่มีค่า Sharpe Ratio สูงกว่าจะเป็นกองทุนที่มีประสิทธิภาพในการบริหารจัดการการลงทุนที่ดีกว่า เนื่องจากได้รับผลตอบแทนส่วนเพิ่มที่สูงกว่าภายใต้ระดับความเสี่ยงเดียวกัน

Alpha ผลตอบแทนส่วนเกินของกองทุนรวมเมื่อเปรียบเทียบกับดัชนีชี้วัด (benchmark) โดยค่า Alpha ที่สูง หมายถึง กองทุนสามารถสร้างผลตอบแทนได้สูงกว่าดัชนีชี้วัด ซึ่งเป็นผลจากประสิทธิภาพของผู้จัดการกองทุนในการคัดเลือกหรือหาจังหวะการลงทุนในหลักทรัพย์ได้อย่างเหมาะสม

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

Tracking Error อัตราผลตอบแทนของกองทุนมีประสิทธิภาพในการเลียนแบบดัชนีชี้วัด โดยหาก tracking error ต่ำ หมายถึงกองทุนรวมมีประสิทธิภาพในการสร้างผลตอบแทนให้ใกล้เคียงกับดัชนีชี้วัด กองทุนที่มีค่า tracking error สูง จะมีอัตราผลตอบแทนโดยเฉลี่ยห่างจากดัชนีชี้วัดมากขึ้น

Yield to Maturity อัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในตราสารหนี้โดยถือจนครบกำหนดอายุ ซึ่งคำนวณจากดอกเบี้ยที่จะได้รับในอนาคตตลอดอายุตราสารและเงินต้นที่จะได้รับคืน นำมาคิดลดเป็นมูลค่าปัจจุบัน โดยใช้วัดอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมตราสารหนี้ คำนวณจากค่าเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักของ Yield to Maturity ของตราสารหนี้แต่ละตัวที่กองทุนมีการลงทุน และเนื่องจาก Yield to Maturity มีหน่วยมาตรฐานเป็นเปอร์เซ็นต์ต่อปี จึงสามารถนำไปใช้เปรียบเทียบกับอัตราผลตอบแทนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีนโยบายถือครองตราสารหนี้จนครบกำหนดอายุและมีลักษณะการลงทุนที่ใกล้เคียงกันได้

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน แอสเซท พลัส จำกัด

ที่อยู่ : เลขที่ 175 อาคารสารคดีตึกยาวอร์ ชั้น 17 ถนนสาทรใต้ แขวงทุ่งมหาเมฆ เขตสาทร กรุงเทพมหานคร 10120

โทรศัพท์ : 0-2672-1111, E-mail : customercare@assetfund.co.th, Website : www.assetfund.co.th

กองทุนเปิด แอสเซทพลัส สمول แอนด์ มิด แคป อีควิตี้ เพื่อการออม
Asset Plus Small and Mid Cap Equity Super Savings Fund (ASP-SME-MSSF)

ชนิดหน่วยลงทุน : เพื่อการออม
ชื่อย่อ class : ASP-SME-SSF

ประเภทกองทุนรวม/กลุ่มกองทุนรวม

ประเภทกองทุนรวม : กองทุนรวมตราสารทุน/กองทุนรวมเพื่อการออม (SSF)/กองทุนรวมไม่มีการลงทุนในต่างประเทศ

กลุ่มกองทุนรวม : Equity General

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- กองทุนมีนโยบายที่จะลงทุนในหุ้นสามัญของบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยและ/หรือตลาดหลักทรัพย์ เอ็ม เอ ไอ ที่มีปัจจัยพื้นฐานดี และ/หรือมีแนวโน้มการเจริญเติบโตทางธุรกิจ โดยจะเน้นลงทุนในตราสารทุนของบริษัทขนาดกลางและขนาดเล็กรวมถึงหุ้นสามัญที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยและ/หรือตลาดหลักทรัพย์ เอ็ม เอ ไอ และ/หรือหุ้นที่อยู่ระหว่าง IPO เพื่อจดทะเบียนซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ดังกล่าว
- บริษัทขนาดกลางและขนาดเล็กรวมถึงหุ้นสามัญที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยและ/หรือตลาดหลักทรัพย์ เอ็ม เอ ไอ รวมถึงการจองซื้อหุ้นที่เสนอขายแก่ประชาชนทั่วไปเป็นครั้งแรก (IPO) ที่มี Market Cap ที่มีมูลค่าหลักทรัพย์ตามราคาตลาด (Market Capitalization) ไม่เกิน 80,000 ล้านบาท ณ วันที่ทำการก่อนหน้าวันที่กองทุนลงทุน
- กองทุนอาจลงทุนหรือมีไว้ในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) เพื่อเพิ่มประสิทธิภาพการลงทุน (Efficient Portfolio Management) ซึ่งรวมถึงการป้องกันความเสี่ยงที่มีอยู่จากการลงทุน
- กองทุนมุ่งหวังให้ผลประกอบการสูงกว่าดัชนีชี้วัด (active management)



ลงทุนในตราสารทุนเป็นหลัก โดยเฉลี่ยในรอบปีไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน : 21 เม.ย. 63

วันเริ่มต้น class : 01 ก.ค. 63

นโยบายการจ่ายเงินปันผล : ไม่จ่าย

อายุกองทุน : ไม่กำหนด

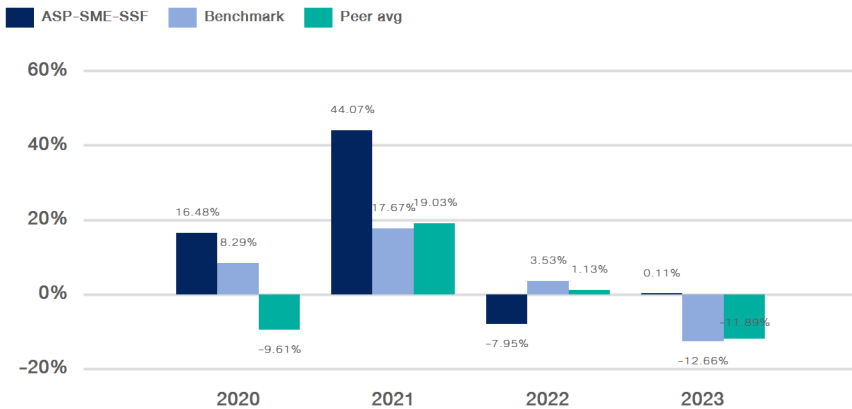
ผู้จัดการกองทุน

น.ส. ทิพย์วดี อภิชัยสิริ (ตั้งแต่ 21 เม.ย. 63)

ดัชนีชี้วัด

ดัชนีผลตอบแทนรวมตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET TRI) ในสัดส่วน 100%

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (%ต่อปี)



ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบบิกทูด (%ต่อปี)

	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี
กองทุน	-1.74	1.90	-12.33	-3.07
ดัชนีชี้วัด	-2.54	0.05	-11.35	-12.75
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	-2.59	0.14	-10.54	-10.54
ความผันผวนกองทุน	11.86	12.58	14.62	15.29
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	10.41	10.13	11.63	12.08
	3 ปี	5 ปี	10 ปี	ตั้งแต่จัดตั้งกองทุน
กองทุน	5.79	N/A	N/A	12.09
ดัชนีชี้วัด	0.05	N/A	N/A	3.21
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	-1.09	N/A	N/A	N/A
ความผันผวนกองทุน	13.47	N/A	N/A	14.35
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	11.34	N/A	N/A	12.82

คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวมมิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต : ได้รับการรับรองจาก CAC

จัดอันดับกองทุน Morningstar :



หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



"ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือบริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่องได้บนหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม"

การซื้อขายหน่วยลงทุน

วันทำการซื้อ : ทุกวันทำการ โดยเริ่มตั้งแต่วันที่ 1 ก.ค. 2563 เป็นต้นไป

เวลาทำการ : ตั้งแต่เวลาเปิดทำการ - 15:30 น.

การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ : 1 บาท

การซื้อครั้งถัดไปขั้นต่ำ : 1 บาท

หมายเหตุ : T+3 = 3 วันทำการ นับถัดจากวันทำการขายคืนหน่วยลงทุน

การขายคืนหน่วยลงทุน

วันทำการขายคืน : ทุกวันทำการ โดยเริ่มตั้งแต่วันที่ 1 ก.ค. 2563 เป็นต้นไป

เวลาทำการ : ตั้งแต่เวลาเปิดทำการ - 15:30 น.

การขายคืนขั้นต่ำ : 0 บาท

ยอดคงเหลือขั้นต่ำ : 0 บาท

ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน : T+3

ข้อมูลเชิงสถิติ

Maximum Drawdown :	-19.15 %
Recovering Period :	-
Fx Hedging :	-
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน :	1.58 เท่า
Sharpe Ratio :	0.26
Alpha :	5.74 %
Beta :	0.86

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	1.99	1.61
รวมค่าใช้จ่าย	4.49	2.78

หมายเหตุ : - ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม หรือภาษีอื่นใด (ถ้ามี)

- อัตราที่เรียกเก็บจริงของรวมค่าใช้จ่ายเป็นข้อมูลตามรอบปีบัญชีล่าสุดของกองทุน

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การขาย	1.50	0.00
การรับซื้อคืน	ไม่มี	ไม่มี
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า	1.50	0.00
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก	1.00	0.00
การโอนหน่วย	50.00	50.00

หมายเหตุ : - ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม หรือภาษีอื่นใด (ถ้ามี)

- ค่าธรรมเนียมการโอนหน่วยคิดเป็นบาท/รายการ

- หน่วยลงทุนเพื่อการออมไม่สามารถโอนหน่วยลงทุนได้เป็นไปตามที่กฎหมายกำหนด

ทั้งนี้ บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงจากกองทุนรวมและ/หรือจากผู้ถือ

หน่วยลงทุนเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ

การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม 5 อันดับแรก

	% NAV
Food & Beverage	14.93
Market for alternative Investment	12.66
Commerce	11.89
Banking	9.01
Finance & Securities	7.85

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน

	% NAV		% NAV
ตราสารทุน	83.00	SAPPE	8.13
เงินฝาก/ตั๋วแลกเงิน	16.96	SISB	5.67
อื่นๆ	0.04	TCAP	4.90
		TISCO	4.11
		ICHI	4.11

ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก*

หมายเหตุ:

*SAPPE : Sappe Public Company Limited, SISB : SISB Public Company Limited, TCAP : THANACHART CAPITAL PUBLIC COMPANY LIMITED, TISCO : TISCO FINANCIAL GROUP PUBLIC COMPANY LIMITED และ ICHI : ICHITAN GROUP Public Company Limited

- ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน ในปีที่จะจดทะเบียนกองทุนจะแสดงตั้งแต่วันที่จดทะเบียนกองทุนจนถึงสิ้นปีปฏิทิน

คำอธิบาย

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

Recovering Period ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาตั้งแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินลงทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลานานเท่าใด

FX Hedging เปรอ์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลานึง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์กับผลรวมของมูลค่าการขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 1 ปีหารด้วยมูลค่า NAV ของกองทุนรวมเฉลี่ยในรอบระยะเวลาดังกล่าว กองทุนที่มีค่า portfolio turnover สูง บ่งชี้ถึงการซื้อขายหลักทรัพย์บ่อยครั้งของผู้จัดการกองทุนและทำให้มีต้นทุนการซื้อขายหลักทรัพย์ที่สูง จึงต้องพิจารณาเปรียบเทียบกับผลการดำเนินงานของกองทุนรวมเพื่อประเมินความคุ้มค่าของการซื้อขายหลักทรัพย์ดังกล่าว

Sharpe Ratio อัตราส่วนระหว่างผลตอบแทนส่วนเพิ่มของกองทุนรวมเปรียบเทียบกับความเสี่ยงจากการลงทุน โดยคำนวณจากผลต่างระหว่างอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมกับอัตราผลตอบแทนที่ปราศจากความเสี่ยง (risk-free rate) หารด้วยค่าเบี่ยงเบนมาตรฐาน (standard deviation) ของกองทุนรวม ค่า Sharpe Ratio สะท้อนถึงอัตราผลตอบแทนที่กองทุนรวมควรได้รับเพิ่มขึ้นเพื่อชดเชยกับความเสี่ยงที่กองทุนรวมรับมา โดยกองทุนที่มีค่า Sharpe Ratio สูงกว่าจะเป็นกองทุนที่มีประสิทธิภาพในการบริหารจัดการลงทุนที่ดีกว่า เนื่องจากได้รับผลตอบแทนส่วนเพิ่มที่สูงกว่าภายใต้ระดับความเสี่ยงเดียวกัน

Alpha ผลตอบแทนส่วนเกินของกองทุนรวมเมื่อเปรียบเทียบกับดัชนีชี้วัด (benchmark) โดยค่า Alpha ที่สูง หมายถึง กองทุนสามารถสร้างผลตอบแทนได้สูงกว่าดัชนีชี้วัด ซึ่งเป็นผลจากประสิทธิภาพของผู้จัดการกองทุนในการคัดเลือกหรือหาจังหวะการลงทุนในหลักทรัพย์ได้อย่างเหมาะสม

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

Tracking Error อัตราผลตอบแทนของกองทุนมีประสิทธิภาพในการเลียนแบบดัชนีชี้วัด โดยหาก tracking error ต่ำ หมายถึงกองทุนรวมมีประสิทธิภาพในการสร้างผลตอบแทนให้ใกล้เคียงกับดัชนีชี้วัด กองทุนที่มีค่า tracking error สูง จะมีอัตราผลตอบแทนโดยเฉลี่ยห่างจากดัชนีชี้วัดมากขึ้น

Yield to Maturity อัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในตราสารหนี้โดยถือจนครบกำหนดอายุ ซึ่งคำนวณจากดอกเบี้ยที่จะได้รับในอนาคตตลอดอายุตราสารและเงินต้นที่จะได้รับคืน นำมาคิดลดเป็นมูลค่าปัจจุบัน โดยใช้วัดอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมตราสารหนี้ คำนวณจากค่าเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักของ Yield to Maturity ของตราสารหนี้แต่ละตัวที่กองทุนมีการลงทุน และเนื่องจาก Yield to Maturity มีหน่วยมาตรฐานเป็นเปอร์เซ็นต์ต่อปี จึงสามารถนำไปใช้เปรียบเทียบอัตราผลตอบแทนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีนโยบายถือครองตราสารหนี้จนครบกำหนดอายุและมีลักษณะการลงทุนที่ใกล้เคียงกันได้

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน แอสเซท พลัส จำกัด

ที่อยู่ : เลขที่ 17 อาคารสารรัชต์ทาวเวอร์ ชั้น 17 ถนนสาทรใต้ แขวงทุ่งมหาเมฆ เขตสาทร กรุงเทพมหานคร 10120

โทรศัพท์ : 0-2672-1111, E-mail : customercare@assetfund.co.th, Website : www.assetfund.co.th