

กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ หุ้นยูเอส เอ็นดีคิว

ชนิดสะสมมูลค่า
SCBNDQ(A)

ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- ประเภทกองทุนรวม: กองทุนรวมตราสารทุน/กองทุนรวมที่มีนโยบายเปิดให้มีการลงทุนในกองทุนรวมอื่นภายใต้ บลจ. เดียวกัน/กองทุนรวมฟีดเดอร์ (Feeder Fund)/กองทุนรวมที่เน้นลงทุนแบบมีความเสี่ยงต่างประเทศ
- กลุ่มกองทุนรวม: US Equity

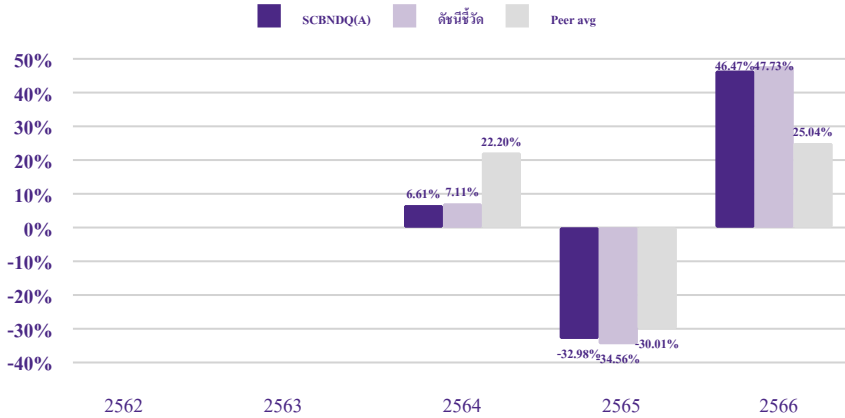
นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

เน้นลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมต่างประเทศเพียงกองทุนเดียว (Feeder Fund) ได้แก่ Invesco NASDAQ 100 ETF (กองทุนหลัก) สกุลเงิน USD กองทุนหลักมีวัตถุประสงค์ลงทุนให้ผลการดำเนินงานของกองทุนก่อนหักค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายใกล้เคียงกับผลตอบแทนของดัชนี NASDAQ-100 Index โดยลงทุนอย่างน้อย 90% ในหลักทรัพย์ที่เป็นส่วนประกอบของดัชนีดังกล่าว ซึ่งประกอบด้วยหลักทรัพย์ของบริษัททั้งในและนอกประเทศสหรัฐอเมริกาที่ไม่ใช่สถาบันการเงิน ที่ใหญ่ที่สุด 100 บริษัท ที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ NASDAQ

กองทุนอาจลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวม หรือกองทุนรวมอสังหาริมทรัพย์ (กอง1) หรือทรัสต์เพื่อการลงทุนในอสังหาริมทรัพย์ (REITs) หรือกองทุนรวมโครงสร้างพื้นฐาน (infra) ซึ่งอยู่ภายใต้การจัดการของบริษัทจัดการในสัดส่วนไม่เกิน 20% ของ NAV

- ชื่อ บลจ.ที่บริหารจัดการกองทุนหลัก: Invesco Capital Management LLC
- กองทุนอาจลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) เพื่อเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน (Efficient portfolio management) และ/หรือการบริหารความเสี่ยง โดยป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยนของหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินในสกุลเงินต่างประเทศที่กองทุนถืออยู่เทียบกับสกุลเงินบาท ณ ขณะใดขณะหนึ่งไม่น้อยกว่า 90% ของมูลค่าทรัพย์สินที่ลงทุนในต่างประเทศ
- กลยุทธ์ในการบริหารกองทุนรวม: กองทุนไทยมุ่งหวังให้ผลประกอบการเคลื่อนไหวตามกองทุนหลัก ส่วนกองทุนหลักมุ่งหวังให้ผลประกอบการเคลื่อนไหวตามดัชนีชี้วัด (Passive Management)

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (% ต่อปี)



หมายเหตุ: ในปีที่กองทุนจดทะเบียน ผลการดำเนินงานจะแสดงตั้งแต่วันที่จดทะเบียนกองทุนจนถึงสิ้นปีปฏิทิน

ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด

| | YTD | 3 เดือน | 6 เดือน | 1 ปี ¹ | 3 ปี ¹ | 5 ปี ¹ | 10 ปี ¹ | ตั้งแต่จัดตั้ง ¹ |
|---------------------------------------|------|---------|---------|-------------------|-------------------|-------------------|--------------------|-----------------------------|
| SCBNDQ(A) | 7.47 | 7.47 | 21.76 | 33.66 | N/A | N/A | N/A | 4.64 |
| ดัชนีชี้วัด | 7.66 | 7.66 | 21.95 | 34.07 | N/A | N/A | N/A | 4.28 |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน ² | 8.66 | 8.66 | 20.91 | 26.41 | N/A | N/A | N/A | N/A |
| ความผันผวนของกองทุน | 7.70 | 7.70 | 10.82 | 15.99 | N/A | N/A | N/A | 23.95 |
| ความผันผวนของดัชนีชี้วัด | 7.99 | 7.99 | 11.10 | 16.31 | N/A | N/A | N/A | 24.15 |

หมายเหตุ: ¹ % ต่อปี

² ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน ตามการจัดกลุ่มกองทุนรวมของ AIMC category

ระดับความเสี่ยง

| | | | | | | | | | |
|-----|---|---|---|---|---|---------------|---|---|-----|
| ต่ำ | 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | สูง |
| | | | | | | 6 : เสี่ยงสูง | | | |

ลงทุนในตราสารทุนเป็นหลัก โดยเฉลี่ยในรอบปีไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม

| | |
|----------------------------|---------------------|
| วันจดทะเบียนกองทุน | 27 สิงหาคม 2564 |
| วันเริ่มต้น Class | 27 สิงหาคม 2564 |
| นโยบายการจ่ายเงินปันผล | ไม่จ่าย |
| อายุกองทุน | ไม่กำหนดอายุโครงการ |
| ผู้จัดการกองทุนรวม | |
| นายวิจักขณ์ ณ เชียงใหม่ | 9 เมษายน 2566 |
| น.ส.นริศรา คินรัตน์สกุลชัย | 2 พฤศจิกายน 2564 |

ดัชนีชี้วัด

ผลการดำเนินงานของกองทุนรวมหลัก 100% ปรับด้วยต้นทุนการป้องกันความเสี่ยงอัตราแลกเปลี่ยนเพื่อคำนวณผลตอบแทนเป็นสกุลเงินบาท ณ วันที่ลงทุน (ในอัตราส่วน 95%) และปรับด้วยอัตราแลกเปลี่ยนเพื่อเทียบกับค่าสกุลเงินบาท ณ วันที่คำนวณผลตอบแทน (ในอัตราส่วน 5%)

คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวม มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต

ได้รับการรับรองจาก CAC



| การซื้อขายหน่วยลงทุน | การขายคืนหน่วยลงทุน |
|---|--|
| วันทำการซื้อ: ทุกวันทำการ | วันทำการขายคืน: ทุกวันทำการ |
| เวลาทำการ: เปิดทำการ ถึง 15.30 น. SCB EASY APP ถึง 16.00 น. | เวลาทำการ: เปิดทำการ ถึง 15.30 น. SCB EASY APP ถึง 16.00 น. |
| มูลค่าขั้นต่ำในการซื้อขายครั้งแรก: 1 บาท | มูลค่าขั้นต่ำในการขายคืน: 1 บาท |
| มูลค่าขั้นต่ำในการซื้อขายครั้งถัดไป: 1 บาท | ยอดคงเหลือขั้นต่ำ: 1 บาท |
| | ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน: T+3 คือ 3 วันทำการ หลังจากวันทำการขายคืน |
| | (ขอสงวนสิทธิ์เปลี่ยนแปลงระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืนจริงซึ่งอาจเร็วขึ้นหรือช้าลงกว่าเดิมได้ ทั้งนี้ ไม่เกิน 6 วันทำการนับจากวันทำการขายคืน) |

| ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV รวม VAT) | | |
|---|---------------|----------|
| ค่าธรรมเนียม | สูงสุดไม่เกิน | เก็บจริง |
| การจัดการ | 2.68 | 0.27 |
| รวมค่าใช้จ่าย | 3.21 | 0.37 |

หมายเหตุ: - บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ
- เปลี่ยนค่าธรรมเนียมหมายเหตุเขียน จากเดิม 0.06955 เป็น 0.06527 โดยมีผลตั้งแต่วันที่ 1 พฤษภาคม 2567 เป็นต้นไป

| ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย รวม VAT) | | |
|---|------------------------|------------------------|
| ค่าธรรมเนียม | สูงสุดไม่เกิน | เก็บจริง |
| การขาย | 3.21 | ยกเว้นไม่เรียกเก็บ |
| การรับซื้อคืน | 3.21 | ยกเว้นไม่เรียกเก็บ |
| การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า | 3.21 | ยกเว้นไม่เรียกเก็บ |
| การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก | 3.21 | ยกเว้นไม่เรียกเก็บ |
| การโอนหน่วย | 10 บาท ต่อ 1,000 หน่วย | 10 บาท ต่อ 1,000 หน่วย |

หมายเหตุ: - บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ
- ค่าใช้จ่ายในการซื้อขายหลักทรัพย์ เมื่อสั่งซื้อ/ส่งขาย/สับเปลี่ยนหน่วยลงทุน ไม่เกินร้อยละ 0.75 ของมูลค่าหน่วยลงทุน (เก็บจริง 0.045%)

| สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน | | ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก | |
|--------------------------------|-------|-------------------------------|-------|
| ประเภททรัพย์สิน | % NAV | ชื่อทรัพย์สิน | % NAV |
| หน่วยลงทุน | 98.99 | หน่วยลงทุน INVESCO NASDAQ 100 | 98.99 |
| เงินฝาก | 3.30 | ETF | |
| อื่น ๆ | -0.28 | | |
| ตราสารอนุพันธ์ | -2.01 | | |

| ข้อมูลเชิงสถิติ | |
|----------------------------|--------------|
| Maximum Drawdown | -35.00% |
| Recovering Period | 1 ปี 1 เดือน |
| FX Hedging | 96.46% |
| อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน | 0.49 เท่า |
| Sharpe ratio | - |
| Alpha | -0.46% |
| Beta | 0.92 |
| Tracking Error | - |

| ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรกของกองทุนหลัก | |
|--|-------|
| ชื่อทรัพย์สิน | % NAV |
| Microsoft | 8.75 |
| Apple | 7.41 |
| Nvidia | 6.32 |
| Amazon | 5.25 |
| Meta Platforms 'A' | 4.76 |

| การจัดสรรการลงทุนในต่างประเทศของกองทุนหลัก | |
|--|-------|
| ประเทศ | % NAV |
| สหรัฐอเมริกา | 97.30 |
| จีน | 1.02 |
| เนเธอร์แลนด์ | 0.61 |
| บราซิล | 0.55 |
| สหราชอาณาจักร | 0.52 |

| การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรมของกองทุนหลัก | |
|---|-------|
| กลุ่มอุตสาหกรรม (Sector) | % NAV |
| ไม่มีข้อมูล | |

หมายเหตุ: ข้อมูลกองทุนหลักเป็นข้อมูล ณ วันที่ 31 มีนาคม 2567

การลงทุนในกองทุนรวมอื่นเกินกว่า 20% ของ NAV

ชื่อกองทุน: Invesco NASDAQ 100 ETF

ISIN code: US46138G6492

Bloomberg code: QQQM UQ

คำอธิบาย

Maximum Drawdown เปรอ์เซ็นต์ผลขาดทุนสูงสุดของกองทุนรวมในระยะเวลา 5 ปีย้อนหลัง (หรือตั้งแต่จัดตั้งกองทุนกรณีที่ยังไม่ครบ 5 ปี) โดยวัดจากระดับ NAV ต่อหน่วยที่จุดสูงสุด ไปจนถึงจุดต่ำสุดในช่วงที่ NAV ต่อหน่วยปรับตัวลดลง ค่า Maximum Drawdown เป็นข้อมูลที่ช่วยให้ทราบถึงความเสี่ยงที่อาจจะขาดทุนจากการลงทุนในกองทุนรวม

Recovering Period ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาดังแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลาเท่าใด

FX Hedging เปรอ์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน (Portfolio Turnover) ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตของกองทุนรวมในช่วงเวลาใดช่วงเวลานึง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์กับผลรวมของมูลค่าการขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 1 ปีหารด้วยมูลค่า NAV ของกองทุนรวมเฉลี่ยในรอบระยะเวลาเดียวกัน กองทุนรวมที่มีค่า Portfolio Turnover สูง บ่งชี้ถึงการซื้อขายหลักทรัพย์บ่อยครั้งของผู้จัดการกองทุนและทำให้มีต้นทุนการซื้อขายหลักทรัพย์ที่สูง จึงต้องพิจารณาเปรียบเทียบกับผลการดำเนินงานของกองทุนรวมเพื่อประเมินความคุ้มค่าของการซื้อขายหลักทรัพย์ดังกล่าว

Sharpe Ratio อัตราส่วนระหว่างผลตอบแทนส่วนเพิ่มของกองทุนรวมเปรียบเทียบกับความเสี่ยงจากการลงทุน โดยคำนวณจากผลต่างระหว่างอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมกับอัตราผลตอบแทนที่ปราศจากความเสี่ยง (risk-free rate) เปรียบเทียบกับค่าเบี่ยงเบนมาตรฐาน (standard deviation) ของกองทุนรวม ค่า Sharpe Ratio สะท้อนถึงอัตราผลตอบแทนที่กองทุนรวมควรได้รับเพิ่มขึ้นเพื่อชดเชยกับความเสี่ยงที่กองทุนรวมรับมา โดยกองทุนรวมที่มีค่า Sharpe Ratio สูงกว่าจะเป็นกองทุนรวมที่มีประสิทธิภาพในการบริหารจัดการลงทุนที่ดีกว่า เนื่องจากได้รับผลตอบแทนส่วนเพิ่มที่สูงกว่าภายใต้ระดับความเสี่ยงเดียวกัน

Alpha ผลตอบแทนส่วนเกินของกองทุนรวมเมื่อเปรียบเทียบกับดัชนีชี้วัด (benchmark) โดยค่า Alpha ที่สูง หมายถึง กองทุนรวมสามารถสร้างผลตอบแทนได้สูงกว่าดัชนีชี้วัด ซึ่งเป็นผลจากประสิทธิภาพของผู้จัดการกองทุนรวมในการคัดเลือกหรือหาจังหวะเข้าลงทุนในหลักทรัพย์ได้อย่างเหมาะสม

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

Tracking Error อัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมมีประสิทธิภาพในการเลียนแบบดัชนีชี้วัด โดยหาก Tracking Error ต่ำ หมายถึงกองทุนรวมมีประสิทธิภาพในการสร้างผลตอบแทนให้ใกล้เคียงกับดัชนีชี้วัด กองทุนรวมที่มีค่า Tracking Error สูง จะมีอัตราผลตอบแทนโดยเฉลี่ยห่างจากดัชนีชี้วัดมากขึ้น

Yield to Maturity อัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในตราสารหนี้โดยถือจนครบกำหนดอายุ ซึ่งคำนวณจากค่าเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักของ Yield to Maturity ของตราสารหนี้แต่ละตัวที่กองทุนรวมมีการลงทุน และเนื่องจาก Yield to Maturity มีหน่วยมาตรฐานเป็นเปอร์เซ็นต์ต่อปี จึงสามารถนำไปใช้เปรียบเทียบอัตราผลตอบแทนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีนโยบายถือครองตราสารหนี้จนครบกำหนดอายุและมีลักษณะการลงทุนที่ใกล้เคียงกันได้

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด

โทรศัพท์ : 0-2949-1500 หรือ 0-2777-7777 website: www.scbam.com

ที่อยู่ : ชั้น 7 – 8 อาคาร 1 ไทยพาณิชย์ ปาร์ค พลาซ่า เลขที่ 18 ถนนรัชดาภิเษก

แขวงจตุจักร เขตจตุจักร กรุงเทพฯ 10900

กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ หุ้นยูเอส เอ็นดีคิว

ชนิดช่องทางอิเล็กทรอนิกส์ SCBNDQ(E)

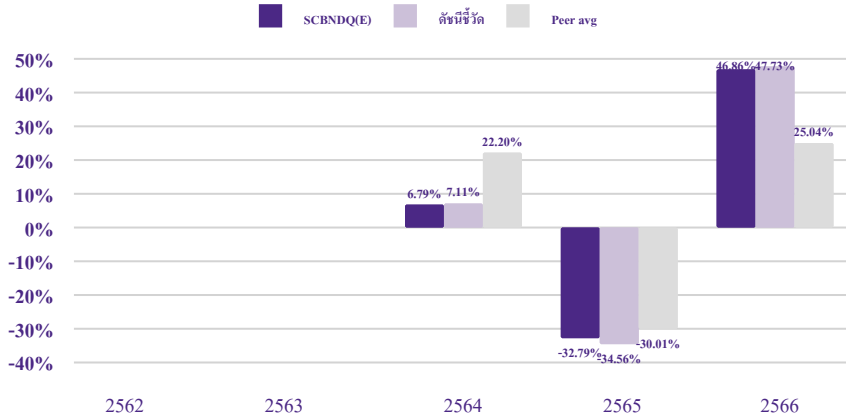
ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- ประเภทกองทุนรวม: กองทุนรวมตราสารทุน/กองทุนรวมที่มีนโยบายเปิดให้มีการลงทุนในกองทุนรวมอื่นภายใต้ บลจ. เดียวกัน/กองทุนรวมฟีดเดอร์ (Feeder Fund)/กองทุนรวมที่เน้นลงทุนแบบมีความเสี่ยงต่างประเทศ
- กลุ่มกองทุนรวม: US Equity

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- เน้นลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมต่างประเทศเพียงกองทุนเดียว (Feeder Fund) ได้แก่ Invesco NASDAQ 100 ETF (กองทุนหลัก) สกุลเงิน USD กองทุนหลักมีวัตถุประสงค์ลงทุนให้ผลการดำเนินงานของกองทุนก่อนหักค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายใกล้เคียงกับผลตอบแทนของดัชนี NASDAQ-100 Index โดยลงทุนอย่างน้อย 90% ในหลักทรัพย์ที่เป็นส่วนประกอบของดัชนีดังกล่าว ซึ่งประกอบด้วยหลักทรัพย์ของบริษัททั้งในและนอกประเทศสหรัฐอเมริกาที่ไม่ใช่สถาบันการเงิน ที่ใหญ่ที่สุด 100 บริษัท ที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ NASDAQ
- กองทุนอาจลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวม หรือกองทุนรวมอสังหาริมทรัพย์ (กอง1) หรือทรัสต์เพื่อการลงทุนในอสังหาริมทรัพย์ (REITs) หรือกองทุนรวมโครงสร้างพื้นฐาน (infra) ซึ่งอยู่ภายใต้การจัดการของบริษัทจัดการในสัดส่วนไม่เกิน 20% ของ NAV
- ชื่อ บลจ.ที่บริหารจัดการกองทุนหลัก: Invesco Capital Management LLC
- กองทุนอาจลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) เพื่อเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน (Efficient portfolio management) และ/หรือการบริหารความเสี่ยง โดยป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยนของหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินในสกุลเงินต่างประเทศที่กองทุนถืออยู่เทียบกับสกุลเงินบาท ณ ขณะใดขณะหนึ่งไม่น้อยกว่า 90% ของมูลค่าทรัพย์สินที่ลงทุนในต่างประเทศ
- กลยุทธ์ในการบริหารกองทุนรวม: กองทุนไทยมุ่งหวังให้ผลประกอบการเคลื่อนไหวตามกองทุนหลัก ส่วนกองทุนหลักมุ่งหวังให้ผลประกอบการเคลื่อนไหวตามดัชนีชี้วัด (Passive Management)

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (% ต่อปี)



หมายเหตุ: ในปีที่กองทุนจดทะเบียน ผลการดำเนินงานจะแสดงตั้งแต่วันที่จดทะเบียนกองทุนจนถึงสิ้นปีปฏิทิน

ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด

| | YTD | 3 เดือน | 6 เดือน | 1 ปี ¹ | 3 ปี ¹ | 5 ปี ¹ | 10 ปี ¹ | ตั้งแต่จัดตั้ง ¹ |
|---------------------------------------|------|---------|---------|-------------------|-------------------|-------------------|--------------------|-----------------------------|
| SCBNDQ(E) | 7.55 | 7.55 | 21.92 | 34.02 | N/A | N/A | N/A | 4.96 |
| ดัชนีชี้วัด | 7.66 | 7.66 | 21.95 | 34.07 | N/A | N/A | N/A | 4.28 |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน ² | 8.66 | 8.66 | 20.91 | 26.41 | N/A | N/A | N/A | N/A |
| ความผันผวนของกองทุน | 7.69 | 7.69 | 10.82 | 15.99 | N/A | N/A | N/A | 23.95 |
| ความผันผวนของดัชนีชี้วัด | 7.99 | 7.99 | 11.10 | 16.31 | N/A | N/A | N/A | 24.15 |

หมายเหตุ: ¹ % ต่อปี

² ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน ตามการจัดกลุ่มกองทุนรวมของ AIMC category

ระดับความเสี่ยง

| | | | | | | | | | |
|-----|---|---|---|---|---|---------------|---|---|-----|
| ต่ำ | 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | สูง |
| | | | | | | 6 : เสี่ยงสูง | | | |

ลงทุนในตราสารทุนเป็นหลัก โดยเฉลี่ยในรอบปีไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม

| | |
|----------------------------|---------------------|
| วันจดทะเบียนกองทุน | 27 สิงหาคม 2564 |
| วันเริ่มต้น Class | 27 สิงหาคม 2564 |
| นโยบายการจ่ายเงินปันผล | ไม่จ่าย |
| อายุกองทุน | ไม่กำหนดอายุโครงการ |
| ผู้จัดการกองทุนรวม | |
| นายวิจักขณ์ ณ เชียงใหม่ | 9 เมษายน 2566 |
| น.ส.นริศรา คินรัตน์สกุลชัย | 2 พฤศจิกายน 2564 |

ดัชนีชี้วัด

ผลการดำเนินงานของกองทุนรวมหลัก 100% ปรับด้วยต้นทุนการป้องกันความเสี่ยงอัตราแลกเปลี่ยนเพื่อคำนวณผลตอบแทนเป็นสกุลเงินบาท ณ วันที่ลงทุน (ในอัตราส่วน 95%) และปรับด้วยอัตราแลกเปลี่ยนเพื่อเทียบกับค่าสกุลเงินบาท ณ วันที่คำนวณผลตอบแทน (ในอัตราส่วน 5%)

คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวม มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต

ได้รับการรับรองจาก CAC



| การซื้อขายหน่วยลงทุน | การขายคืนหน่วยลงทุน |
|--|---|
| วันทำการซื้อ: ทุกวันทำการ | วันทำการขายคืน: ทุกวันทำการ |
| เวลาทำการ: เปิดทำการ ถึง 15.30 น. | เวลาทำการ: เปิดทำการ ถึง 15.30 น. |
| มูลค่าขั้นต่ำในการซื้อขายครั้งแรก: 1 บาท | มูลค่าขั้นต่ำในการขายคืน: 1 บาท |
| มูลค่าขั้นต่ำในการซื้อขายครั้งถัดไป: 1 บาท | ยอดคงเหลือขั้นต่ำ: 1 บาท |
| | ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน: T+3 คือ 3 วันทำการ หลังจากวันทำการขายคืน |
| | (ขอสงวนสิทธิ์เปลี่ยนแปลงระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืนจริงซึ่งอาจเร็วขึ้นหรือช้าลงกว่าเดิมได้ ทั้งนี้ไม่เกิน 6 วันทำการนับจากวันทำการขายคืน) |

หมายเหตุ: ซื้อขายหน่วยลงทุนผ่าน SCBAM Fund Click Application

บริษัทจัดการอาจปฏิเสธคำสั่งซื้อและ/หรือคำสั่งเปลี่ยนแปลงหน่วยลงทุนเข้า หากมูลค่าหน่วยลงทุนคงเหลือมูลค่าการสั่งซื้อหน่วยลงทุนสุทธิ และมูลค่าการเปลี่ยนแปลงหน่วยลงทุนเข้าสุทธิของแต่ละบัญชีผู้ถือหน่วยลงทุนและ/หรือผู้ถือหน่วยลงทุนแต่ละราย ในทุกหน่วยลงทุนชนิดช่องทางอิเล็กทรอนิกส์ และทุกหน่วยลงทุนชนิดเพื่อสิทธิประโยชน์ทางภาษีผ่านช่องทางอิเล็กทรอนิกส์* เมื่อรวมกันทุกกองทุนภายใต้การบริหารจัดการของบริษัทจัดการแล้ว มีมูลค่ารวมกันมากกว่าหนึ่งล้านบาท (มูลค่ารวมทั้งหนึ่ง) ทั้งนี้ สำหรับหน่วยลงทุนชนิดช่องทางอิเล็กทรอนิกส์ของกองทุนรวมเพื่อสิทธิประโยชน์ทางภาษี** และหน่วยลงทุนชนิดเพื่อสิทธิประโยชน์ทางภาษีผ่านช่องทางอิเล็กทรอนิกส์* จะกำหนดมูลค่ารวมกันไม่เกินสองแสนบาท (มูลค่ารวมทั้งสอง) โดยมูลค่ารวมทั้งสองนับรวมอยู่ภายในมูลค่ารวมทั้งหนึ่ง

*หมายถึง ชนิดเพื่อการออมผ่านช่องทางอิเล็กทรอนิกส์ และชนิดเพื่อสิทธิประโยชน์ทางภาษีผ่านช่องทางอิเล็กทรอนิกส์อื่นๆที่อาจมีขึ้นในอนาคต

**หมายถึง กองทุนรวมเพื่อการเลี้ยงชีพ และกองทุนรวมเพื่อสิทธิประโยชน์ทางภาษีอื่นๆที่อาจมีขึ้นในอนาคต

| ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV รวม VAT) | | |
|---|---------------|--------------------|
| ค่าธรรมเนียม | สูงสุดไม่เกิน | เก็บจริง |
| การจัดการ | 2.68 | ยกเว้นไม่เรียกเก็บ |
| รวมค่าใช้จ่าย | 3.21 | 0.10 |

หมายเหตุ: - บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ

- เปลี่ยนค่าธรรมเนียมหมายเหตุเขียน จากเดิม 0.06955 เป็น 0.06527 โดยมีผลตั้งแต่วันที่ 1 พฤษภาคม 2567 เป็นต้นไป

| ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย รวม VAT) | | |
|---|------------------------|------------------------|
| ค่าธรรมเนียม | สูงสุดไม่เกิน | เก็บจริง |
| การขาย | 3.21 | ยกเว้นไม่เรียกเก็บ |
| การรับซื้อคืน | 3.21 | 0.11 |
| การเปลี่ยนแปลงหน่วยลงทุนเข้า | 3.21 | ยกเว้นไม่เรียกเก็บ |
| การเปลี่ยนแปลงหน่วยลงทุนออก | 3.21 | 0.11 |
| การโอนหน่วย | 10 บาท ต่อ 1,000 หน่วย | 10 บาท ต่อ 1,000 หน่วย |

หมายเหตุ: - บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ

- ค่าใช้จ่ายในการซื้อขายหลักทรัพย์ เมื่อสั่งซื้อ/ส่งขาย/เปลี่ยนแปลงหน่วยลงทุน ไม่เกินร้อยละ 0.75 ของมูลค่าหน่วยลงทุน (เก็บจริง 0.045%)

| สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน | | ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก | |
|--------------------------------|-------|-------------------------------|-------|
| ประเภททรัพย์สิน | % NAV | ชื่อทรัพย์สิน | % NAV |
| หน่วยลงทุน | 98.99 | หน่วยลงทุน INVESCO NASDAQ 100 | 98.99 |
| เงินฝาก | 3.30 | ETF | |
| อื่นๆ | -0.28 | | |
| ตราสารอนุพันธ์ | -2.01 | | |

| ข้อมูลเชิงสถิติ | |
|----------------------------|--------------|
| Maximum Drawdown | -34.78% |
| Recovering Period | 1 ปี 1 เดือน |
| FX Hedging | 96.46% |
| อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน | 0.49 เท่า |
| Sharpe ratio | - |
| Alpha | -0.13% |
| Beta | 0.92 |
| Tracking Error | - |

| ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรกของกองทุนหลัก | |
|--|-------|
| ชื่อทรัพย์สิน | % NAV |
| Microsoft | 8.75 |
| Apple | 7.41 |
| Nvidia | 6.32 |
| Amazon | 5.25 |
| Meta Platforms 'A' | 4.76 |

| การจัดสรรการลงทุนในต่างประเทศของกองทุนหลัก | |
|--|-------|
| ประเทศ | % NAV |
| สหรัฐอเมริกา | 97.30 |
| จีน | 1.02 |
| เนเธอร์แลนด์ | 0.61 |
| บราซิล | 0.55 |
| สหราชอาณาจักร | 0.52 |

| การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรมของกองทุนหลัก | |
|---|-------|
| กลุ่มอุตสาหกรรม (Sector) | % NAV |
| ไม่มีข้อมูล | |

หมายเหตุ: ข้อมูลกองทุนหลักเป็นข้อมูล ณ วันที่ 31 มีนาคม 2567

การลงทุนในกองทุนรวมอื่นเกินกว่า 20% ของ NAV

ชื่อกองทุน: Invesco NASDAQ 100 ETF

ISIN code: US46138G6492

Bloomberg code: QQQM UQ

คำอธิบาย

Maximum Drawdown เปรอ์เซ็นต์ผลขาดทุนสูงสุดของกองทุนรวมในระยะเวลา 5 ปีย้อนหลัง (หรือตั้งแต่จัดตั้งกองทุนกรณีที่ยังไม่ครบ 5 ปี) โดยวัดจากระดับ NAV ต่อหน่วยที่จุดสูงสุด ไปจนถึงจุดต่ำสุดในช่วงที่ NAV ต่อหน่วยปรับตัวลดลง ค่า Maximum Drawdown เป็นข้อมูลที่ช่วยให้ทราบถึงความเสี่ยงที่อาจจะขาดทุนจากการลงทุนในกองทุนรวม

Recovering Period ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาดังแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลาเท่าใด

FX Hedging เปรอ์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน (Portfolio Turnover) ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตของกองทุนรวมในช่วงเวลาใดช่วงเวลานึง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์กับผลรวมของมูลค่าการขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 1 ปีหารด้วยมูลค่า NAV ของกองทุนรวมเฉลี่ยในรอบระยะเวลาเดียวกัน กองทุนรวมที่มีค่า Portfolio Turnover สูง บ่งชี้ถึงการซื้อขายหลักทรัพย์บ่อยครั้งของผู้จัดการกองทุนและทำให้มีต้นทุนการซื้อขายหลักทรัพย์ที่สูง จึงต้องพิจารณาเปรียบเทียบกับผลการดำเนินงานของกองทุนรวมเพื่อประเมินความคุ้มค่าของการซื้อขายหลักทรัพย์ดังกล่าว

Sharpe Ratio อัตราส่วนระหว่างผลตอบแทนส่วนเพิ่มของกองทุนรวมเปรียบเทียบกับความเสี่ยงจากการลงทุน โดยคำนวณจากผลต่างระหว่างอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมกับอัตราผลตอบแทนที่ปราศจากความเสี่ยง (risk-free rate) เปรียบเทียบกับค่าเบี่ยงเบนมาตรฐาน (standard deviation) ของกองทุนรวม ค่า Sharpe Ratio สะท้อนถึงอัตราผลตอบแทนที่กองทุนรวมควรได้รับเพิ่มขึ้นเพื่อชดเชยกับความเสี่ยงที่กองทุนรวมรับมา โดยกองทุนรวมที่มีค่า Sharpe Ratio สูงกว่าจะเป็นกองทุนรวมที่มีประสิทธิภาพในการบริหารจัดการลงทุนที่ดีกว่า เนื่องจากได้รับผลตอบแทนส่วนเพิ่มที่สูงกว่าภายใต้ระดับความเสี่ยงเดียวกัน

Alpha ผลตอบแทนส่วนเกินของกองทุนรวมเมื่อเปรียบเทียบกับดัชนีชี้วัด (benchmark) โดยค่า Alpha ที่สูง หมายถึง กองทุนรวมสามารถสร้างผลตอบแทนได้สูงกว่าดัชนีชี้วัด ซึ่งเป็นผลจากประสิทธิภาพของผู้จัดการกองทุนรวมในการคัดเลือกหรือหาจังหวะเข้าลงทุนในหลักทรัพย์ได้อย่างเหมาะสม

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

Tracking Error อัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมมีประสิทธิภาพในการเลียนแบบดัชนีชี้วัด โดยหาก Tracking Error ต่ำ หมายถึงกองทุนรวมมีประสิทธิภาพในการสร้างผลตอบแทนให้ใกล้เคียงกับดัชนีชี้วัด กองทุนรวมที่มีค่า Tracking Error สูง จะมีอัตราผลตอบแทนโดยเฉลี่ยห่างจากดัชนีชี้วัดมากขึ้น

Yield to Maturity อัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในตราสารหนี้โดยถือจนครบกำหนดอายุ ซึ่งคำนวณจากค่าเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักของ Yield to Maturity ของตราสารหนี้แต่ละตัวที่กองทุนรวมมีการลงทุน และเนื่องจาก Yield to Maturity มีหน่วยมาตรฐานเป็นเปอร์เซ็นต์ต่อปี จึงสามารถนำไปใช้เปรียบเทียบอัตราผลตอบแทนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีนโยบายถือครองตราสารหนี้จนครบกำหนดอายุและมีลักษณะการลงทุนที่ใกล้เคียงกันได้

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด

โทรศัพท์ : 0-2949-1500 หรือ 0-2777-7777 website: www.scbam.com

ที่อยู่ : ชั้น 7 – 8 อาคาร 1 ไทยพาณิชย์ ปาร์ค พลาซ่า เลขที่ 18 ถนนรัชดาภิเษก

แขวงจตุจักร เขตจตุจักร กรุงเทพฯ 10900

กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ หุ้นยูเอส เอ็นดีคิว

ชนิดผู้ลงทุนกลุ่ม/บุคคล
SCBNDQ(P)

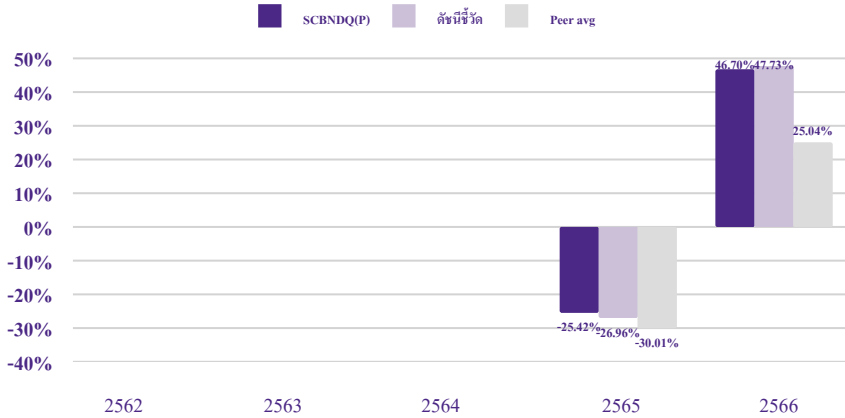
ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- ประเภทกองทุนรวม: กองทุนรวมตราสารทุน/กองทุนรวมที่มีนโยบายเปิดให้มีการลงทุนในกองทุนรวมอื่นภายใต้ บลจ. เดียวกัน/กองทุนรวมฟีดเดอร์ (Feeder Fund)/กองทุนรวมที่เน้นลงทุนแบบมีความเสี่ยงต่างประเทศ
- กลุ่มกองทุนรวม: US Equity

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- เน้นลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมต่างประเทศเพียงกองทุนเดียว (Feeder Fund) ได้แก่ Invesco NASDAQ 100 ETF (กองทุนหลัก) สกุลเงิน USD กองทุนหลักมีวัตถุประสงค์ลงทุนให้ผลการดำเนินงานของกองทุนก่อนหักค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายใกล้เคียงกับผลตอบแทนของดัชนี NASDAQ-100 Index โดยลงทุนอย่างน้อย 90% ในหลักทรัพย์ที่เป็นส่วนประกอบของดัชนีดังกล่าว ซึ่งประกอบด้วยหลักทรัพย์ของบริษัททั้งในและนอกประเทศสหรัฐอเมริกาที่ไม่ใช่สถาบันการเงิน ที่ใหญ่ที่สุด 100 บริษัท ที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ NASDAQ
- กองทุนอาจลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวม หรือกองทุนรวมอสังหาริมทรัพย์ (กอง1) หรือทรัสต์เพื่อการลงทุนในอสังหาริมทรัพย์ (REITs) หรือกองทุนรวมโครงสร้างพื้นฐาน (infra) ซึ่งอยู่ภายใต้การจัดการของบริษัทผู้จัดการในสัดส่วนไม่เกิน 20% ของ NAV
- ชื่อ บลจ.ที่บริหารจัดการกองทุนหลัก: Invesco Capital Management LLC
- กองทุนอาจลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) เพื่อเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน (Efficient portfolio management) และ/หรือการบริหารความเสี่ยง โดยป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยนของหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินในสกุลเงินต่างประเทศที่กองทุนถืออยู่เทียบกับสกุลเงินบาท ณ ขณะใดขณะหนึ่งไม่น้อยกว่า 90% ของมูลค่าทรัพย์สินที่ลงทุนในต่างประเทศ
- กลยุทธ์ในการบริหารกองทุนรวม: กองทุนไทยมุ่งหวังให้ผลประกอบการเคลื่อนไหวตามกองทุนหลัก ส่วนกองทุนหลักมุ่งหวังให้ผลประกอบการเคลื่อนไหวตามดัชนีชี้วัด (Passive Management)

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (% ต่อปี)



หมายเหตุ: ในปีที่กองทุนจดทะเบียน ผลการดำเนินงานจะแสดงตั้งแต่วันที่จดทะเบียนกองทุนจนถึงสิ้นปีปฏิทิน

ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด

| | YTD | 3 เดือน | 6 เดือน | 1 ปี ¹ | 3 ปี ¹ | 5 ปี ¹ | 10 ปี ¹ | ตั้งแต่จัดตั้ง ¹ |
|---------------------------------------|------|---------|---------|-------------------|-------------------|-------------------|--------------------|-----------------------------|
| SCBNDQ(P) | 7.52 | 7.52 | 21.80 | 33.88 | N/A | N/A | N/A | 7.92 |
| ดัชนีชี้วัด | 7.66 | 7.66 | 21.95 | 34.07 | N/A | N/A | N/A | 7.28 |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน ² | 8.66 | 8.66 | 20.91 | 26.41 | N/A | N/A | N/A | N/A |
| ความผันผวนของกองทุน | 7.70 | 7.70 | 10.82 | 16.00 | N/A | N/A | N/A | 24.61 |
| ความผันผวนของดัชนีชี้วัด | 7.99 | 7.99 | 11.10 | 16.31 | N/A | N/A | N/A | 24.79 |

หมายเหตุ: ¹ % ต่อปี

² ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน ตามการจัดกลุ่มกองทุนรวมของ AIMC category

ระดับความเสี่ยง

| | | | | | | | | | |
|-----|---|---|---|---|---|---------------|---|---|-----|
| ต่ำ | 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | สูง |
| | | | | | | 6 : เสี่ยงสูง | | | |

ลงทุนในตราสารทุนเป็นหลัก โดยเฉลี่ยในรอบปีไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม

| | |
|----------------------------|---------------------|
| วันจดทะเบียนกองทุน | 27 สิงหาคม 2564 |
| วันเริ่มต้น Class | 11 กุมภาพันธ์ 2565 |
| นโยบายการจ่ายเงินปันผล | ไม่จ่าย |
| อายุกองทุน | ไม่กำหนดอายุโครงการ |
| ผู้จัดการกองทุนรวม | |
| นายวิจักขณ์ ณ เชียงใหม่ | 9 เมษายน 2566 |
| น.ส.นริศรา คิณรัตน์สกุลชัย | 2 พฤศจิกายน 2564 |

ดัชนีชี้วัด

ผลการดำเนินงานของกองทุนรวมหลัก 100% ปรับด้วยต้นทุนการป้องกันความเสี่ยงอัตราแลกเปลี่ยนเพื่อคำนวณผลตอบแทนเป็นสกุลเงินบาท ณ วันที่ลงทุน (ในอัตราส่วน 95%) และปรับด้วยอัตราแลกเปลี่ยนเพื่อเทียบกับค่าสกุลเงินบาท ณ วันที่คำนวณผลตอบแทน (ในอัตราส่วน 5%)

คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวม ไม่ได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต

ได้รับการรับรองจาก CAC



| การซื้อขายหน่วยลงทุน | การขายคืนหน่วยลงทุน |
|--|--|
| วันทำการซื้อ: ทุกวันทำการ | วันทำการขายคืน: ทุกวันทำการ |
| เวลาทำการ: เปิดทำการ ถึง 15.30 น. | เวลาทำการ: เปิดทำการ ถึง 15.30 น. |
| มูลค่าขั้นต่ำในการซื้อขายครั้งแรก: 1 บาท | มูลค่าขั้นต่ำในการขายคืน: 1 บาท |
| มูลค่าขั้นต่ำในการซื้อขายครั้งถัดไป: 1 บาท | ยอดคงเหลือขั้นต่ำ: 1 บาท |
| | ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน: T+3 คือ 3 วันทำการ หลังจากวันทำการขายคืน |
| | (ขอสงวนสิทธิ์เปลี่ยนแปลงระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืนจริงซึ่งอาจเร็วขึ้นหรือช้าลงกว่าเดิมได้ ทั้งนี้ ไม่เกิน 6 วันทำการนับจากวันทำการขายคืน) |

หมายเหตุ: โดยเบื้องต้นบริษัทจัดการกำหนดให้บริการเฉพาะผู้ลงทุนกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ และ/หรือ กองทุนส่วนบุคคลภายใต้การบริหารของบริษัทจัดการเท่านั้น

| ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV รวม VAT) | | |
|---|---------------|--------------------|
| ค่าธรรมเนียม | สูงสุดไม่เกิน | เก็บจริง |
| การจัดการ | 1.61 | ยกเว้นไม่เรียกเก็บ |
| รวมค่าใช้จ่าย | 2.14 | 0.10 |

หมายเหตุ: - บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ
- เปลี่ยนค่าธรรมเนียมนายทะเบียน จากเดิม 0.06955 เป็น 0.06527 โดยมีผลตั้งแต่วันที่ 1 พฤษภาคม 2567 เป็นต้นไป

| ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย รวม VAT) | | |
|---|------------------------|------------------------|
| ค่าธรรมเนียม | สูงสุดไม่เกิน | เก็บจริง |
| การขาย | 3.21 | ยกเว้นไม่เรียกเก็บ |
| การรับซื้อคืน | 3.21 | ยกเว้นไม่เรียกเก็บ |
| การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า | 3.21 | ยกเว้นไม่เรียกเก็บ |
| การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก | 3.21 | ยกเว้นไม่เรียกเก็บ |
| การโอนหน่วย | 10 บาท ต่อ 1,000 หน่วย | 10 บาท ต่อ 1,000 หน่วย |

หมายเหตุ: - บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ
- ค่าใช้จ่ายในการซื้อขายหลักทรัพ์ เมื่อสั่งซื้อ/ส่งขาย/สับเปลี่ยนหน่วยลงทุน ไม่เกินร้อยละ 0.75 ของมูลค่าหน่วยลงทุน (เก็บจริง 0.045%)

| สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน | | ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก | |
|--------------------------------|-------|-------------------------------|-------|
| ประเภททรัพย์สิน | % NAV | ชื่อทรัพย์สิน | % NAV |
| หน่วยลงทุน | 98.99 | หน่วยลงทุน INVESCO NASDAQ 100 | 98.99 |
| เงินฝาก | 3.30 | ETF | |
| อื่น ๆ | -0.28 | | |
| ตราสารอนุพันธ์ | -2.01 | | |

| ข้อมูลเชิงสถิติ | |
|----------------------------|-----------|
| Maximum Drawdown | -30.01% |
| Recovering Period | 7 เดือน |
| FX Hedging | 96.46% |
| อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน | 0.49 เท่า |
| Sharpe ratio | - |
| Alpha | -0.27% |
| Beta | 0.92 |
| Tracking Error | - |

| ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรกของกองทุนหลัก | |
|--|-------|
| ชื่อทรัพย์สิน | % NAV |
| Microsoft | 8.75 |
| Apple | 7.41 |
| Nvidia | 6.32 |
| Amazon | 5.25 |
| Meta Platforms 'A' | 4.76 |

| การจัดสรรการลงทุนในต่างประเทศของกองทุนหลัก | |
|--|-------|
| ประเทศ | % NAV |
| สหรัฐอเมริกา | 97.30 |
| จีน | 1.02 |
| เนเธอร์แลนด์ | 0.61 |
| บราซิล | 0.55 |
| สหราชอาณาจักร | 0.52 |

| การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรมของกองทุนหลัก | |
|---|-------|
| กลุ่มอุตสาหกรรม (Sector) | % NAV |
| ไม่มีข้อมูล | |

หมายเหตุ: ข้อมูลกองทุนหลักเป็นข้อมูล ณ วันที่ 31 มีนาคม 2567

การลงทุนในกองทุนรวมอื่นเกินกว่า 20% ของ NAV

ชื่อกองทุน: Invesco NASDAQ 100 ETF

ISIN code: US46138G6492

Bloomberg code: QQQM UQ

คำอธิบาย

Maximum Drawdown เปรอ์เซ็นต์ผลขาดทุนสูงสุดของกองทุนรวมในระยะเวลา 5 ปีย้อนหลัง (หรือตั้งแต่จัดตั้งกองทุนกรณีที่ยังไม่ครบ 5 ปี) โดยวัดจากระดับ NAV ต่อหน่วยที่จุดสูงสุด ไปจนถึงจุดต่ำสุดในช่วงที่ NAV ต่อหน่วยปรับตัวลดลง ค่า Maximum Drawdown เป็นข้อมูลที่ช่วยให้ทราบถึงความเสี่ยงที่อาจจะขาดทุนจากการลงทุนในกองทุนรวม

Recovering Period ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาดังแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลาเท่าใด

FX Hedging เปรอ์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน (Portfolio Turnover) ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตของกองทุนรวมในช่วงเวลาใดช่วงเวลานึง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์กับผลรวมของมูลค่าการขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 1 ปีหารด้วยมูลค่า NAV ของกองทุนรวมเฉลี่ยในรอบระยะเวลาเดียวกัน กองทุนรวมที่มีค่า Portfolio Turnover สูง บ่งชี้ถึงการซื้อขายหลักทรัพย์บ่อยครั้งของผู้จัดการกองทุนและทำให้มีต้นทุนการซื้อขายหลักทรัพย์ที่สูง จึงต้องพิจารณาเปรียบเทียบกับผลการดำเนินงานของกองทุนรวมเพื่อประเมินความคุ้มค่าของการซื้อขายหลักทรัพย์ดังกล่าว

Sharpe Ratio อัตราส่วนระหว่างผลตอบแทนส่วนเพิ่มของกองทุนรวมเปรียบเทียบกับความเสี่ยงจากการลงทุน โดยคำนวณจากผลต่างระหว่างอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมกับอัตราผลตอบแทนที่ปราศจากความเสี่ยง (risk-free rate) เปรียบเทียบกับค่าเบี่ยงเบนมาตรฐาน (standard deviation) ของกองทุนรวม ค่า Sharpe Ratio สะท้อนถึงอัตราผลตอบแทนที่กองทุนรวมควรได้รับเพิ่มขึ้นเพื่อชดเชยกับความเสี่ยงที่กองทุนรวมรับมา โดยกองทุนรวมที่มีค่า Sharpe Ratio สูงกว่าจะเป็นกองทุนรวมที่มีประสิทธิภาพในการบริหารจัดการลงทุนที่ดีกว่า เนื่องจากได้รับผลตอบแทนส่วนเพิ่มที่สูงกว่าภายใต้ระดับความเสี่ยงเดียวกัน

Alpha ผลตอบแทนส่วนเกินของกองทุนรวมเมื่อเปรียบเทียบกับดัชนีชี้วัด (benchmark) โดยค่า Alpha ที่สูง หมายถึง กองทุนรวมสามารถสร้างผลตอบแทนได้สูงกว่าดัชนีชี้วัด ซึ่งเป็นผลจากประสิทธิภาพของผู้จัดการกองทุนรวมในการคัดเลือกหรือหาจังหวะเข้าลงทุนในหลักทรัพย์ได้อย่างเหมาะสม

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

Tracking Error อัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมมีประสิทธิภาพในการเลียนแบบดัชนีชี้วัด โดยหาก Tracking Error ต่ำ หมายถึงกองทุนรวมมีประสิทธิภาพในการสร้างผลตอบแทนให้ใกล้เคียงกับดัชนีชี้วัด กองทุนรวมที่มีค่า Tracking Error สูง จะมีอัตราผลตอบแทนโดยเฉลี่ยห่างจากดัชนีชี้วัดมากขึ้น

Yield to Maturity อัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในตราสารหนี้โดยถือจนครบกำหนดอายุ ซึ่งคำนวณจากค่าเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักของ Yield to Maturity ของตราสารหนี้แต่ละตัวที่กองทุนรวมมีการลงทุน และเนื่องจาก Yield to Maturity มีหน่วยมาตรฐานเป็นเปอร์เซ็นต์ต่อปี จึงสามารถนำไปใช้เปรียบเทียบอัตราผลตอบแทนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีนโยบายถือครองตราสารหนี้จนครบกำหนดอายุและมีลักษณะการลงทุนที่ใกล้เคียงกันได้

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด

โทรศัพท์ : 0-2949-1500 หรือ 0-2777-7777 website: www.scbam.com

ที่อยู่ : ชั้น 7 – 8 อาคาร 1 ไทยพาณิชย์ ปาร์ค พลาซ่า เลขที่ 18 ถนนรัชดาภิเษก

แขวงจตุจักร เขตจตุจักร กรุงเทพฯ 10900

กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ หุ้นยูเอส เอ็นดีคิว

ชนิดเพื่อการออม
SCBNDQ(SSF)

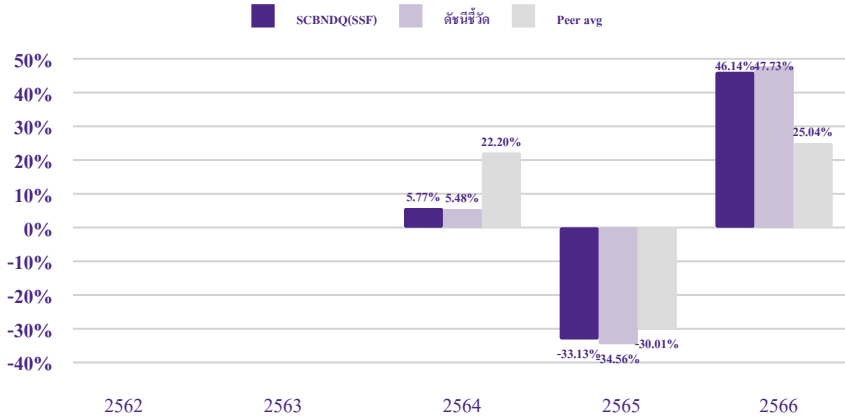
ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- ประเภทกองทุนรวม: กองทุนรวมตราสารทุน/กองทุนรวมที่มีนโยบายเปิดให้มีการลงทุนในกองทุนรวมอื่นภายใต้ บลจ. เดียวกัน/กองทุนรวมเพื่อการออม (SSF)/กองทุนรวมที่เฟเดอเรเตอร์ (Feeder Fund)/กองทุนรวมที่เน้นลงทุนแบบมีความเสี่ยงต่างประเทศ
- กลุ่มกองทุนรวม: US Equity

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- เน้นลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมต่างประเทศเพียงกองทุนเดียว (Feeder Fund) ได้แก่ Invesco NASDAQ 100 ETF (กองทุนหลัก) สกุลเงิน USD กองทุนหลักมีวัตถุประสงค์ลงทุนให้ผลการดำเนินงานของกองทุนก่อนหักค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายใกล้เคียงกับผลตอบแทนของดัชนี NASDAQ-100 Index โดยลงทุนอย่างน้อย 90% ในหลักทรัพย์ที่เป็นส่วนประกอบของดัชนีดังกล่าว ซึ่งประกอบด้วยหลักทรัพย์ของบริษัททั้งในและนอกประเทศสหรัฐอเมริกาที่ไม่ใช่สถาบันการเงิน ที่ใหญ่ที่สุด 100 บริษัท ที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ NASDAQ
- กองทุนอาจลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวม หรือกองทุนรวมอสังหาริมทรัพย์ (กอง1) หรือทรัสต์เพื่อการลงทุนในอสังหาริมทรัพย์ (REITs) หรือกองทุนรวมโครงสร้างพื้นฐาน (infra) ซึ่งอยู่ภายใต้การจัดการของบริษัทที่จัดการในสัดส่วนไม่เกิน 20% ของ NAV
- ชื่อ บลจ.ที่บริหารจัดการกองทุนหลัก: Invesco Capital Management LLC
- กองทุนอาจลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) เพื่อเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน (Efficient portfolio management) และ/หรือการบริหารความเสี่ยง โดยป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยนของหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินในสกุลเงินต่างประเทศที่กองทุนถืออยู่เทียบกับสกุลเงินบาท ณ ขณะใดขณะหนึ่งไม่น้อยกว่า 90% ของมูลค่าทรัพย์สินที่ลงทุนในต่างประเทศ
- กลยุทธ์ในการบริหารกองทุนรวม: กองทุนไทยมุ่งหวังให้ผลประกอบการเคลื่อนไหวตามกองทุนหลัก ส่วนกองทุนหลักมุ่งหวังให้ผลประกอบการเคลื่อนไหวตามดัชนีชี้วัด (Passive Management)

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (% ต่อปี)



หมายเหตุ: ในปีที่กองทุนจดทะเบียน ผลการดำเนินงานจะแสดงตั้งแต่วันที่จดทะเบียนกองทุนจนถึงสิ้นปีปฏิทิน

ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด

| | YTD | 3 เดือน | 6 เดือน | 1 ปี ¹ | 3 ปี ¹ | 5 ปี ¹ | 10 ปี ¹ | ตั้งแต่จัดตั้ง ¹ |
|---------------------------------------|------|---------|---------|-------------------|-------------------|-------------------|--------------------|-----------------------------|
| SCBNDQ(SSF) | 7.41 | 7.41 | 21.62 | 33.36 | N/A | N/A | N/A | 4.22 |
| ดัชนีชี้วัด | 7.66 | 7.66 | 21.95 | 34.07 | N/A | N/A | N/A | 3.75 |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน ² | 8.66 | 8.66 | 20.91 | 26.41 | N/A | N/A | N/A | N/A |
| ความผันผวนของกองทุน | 7.70 | 7.70 | 10.82 | 15.99 | N/A | N/A | N/A | 24.22 |
| ความผันผวนของดัชนีชี้วัด | 7.99 | 7.99 | 11.10 | 16.31 | N/A | N/A | N/A | 24.41 |

หมายเหตุ: ¹ % ต่อปี

² ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน ตามการจัดกลุ่มกองทุนรวมของ AIMC category

ระดับความเสี่ยง

| | | | | | | | | | |
|-----|---|---|---|---|---|---------------|---|---|-----|
| ต่ำ | 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | สูง |
| | | | | | | 6 : เสี่ยงสูง | | | |

ลงทุนในตราสารทุนเป็นหลัก โดยเฉลี่ยในรอบปีไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม

| | |
|----------------------------|---------------------|
| วันจดทะเบียนกองทุน | 27 สิงหาคม 2564 |
| วันเริ่มต้น Class | 17 กันยายน 2564 |
| นโยบายการจ่ายเงินปันผล | จ่าย |
| อายุกองทุน | ไม่กำหนดอายุโครงการ |
| ผู้จัดการกองทุนรวม | |
| นายวิจักขณ์ ณ เชียงใหม่ | 9 เมษายน 2566 |
| น.ส.นริศรา คินรัตน์สกุลชัย | 2 พฤศจิกายน 2564 |

ดัชนีชี้วัด

ผลการดำเนินงานของกองทุนรวมหลัก 100% ปรับด้วยต้นทุนการป้องกันความเสี่ยงอัตราแลกเปลี่ยนเพื่อคำนวณผลตอบแทนเป็นสกุลเงินบาท ณ วันที่ลงทุน (ในอัตราส่วน 95%) และปรับด้วยอัตราแลกเปลี่ยนเพื่อเทียบกับค่าสกุลเงินบาท ณ วันที่คำนวณผลตอบแทน (ในอัตราส่วน 5%)

คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวม มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต

ได้รับการรับรองจาก CAC



| การซื้อขายหน่วยลงทุน | การขายคืนหน่วยลงทุน |
|---|--|
| วันทำการซื้อ: ทุกวันทำการ | วันทำการขายคืน: ทุกวันทำการ |
| เวลาทำการ: เปิดทำการ ถึง 15.30 น. SCB EASY APP ถึง 16.00 น. | เวลาทำการ: เปิดทำการ ถึง 15.30 น. SCB EASY APP ถึง 16.00 น. |
| มูลค่าขั้นต่ำในการซื้อขายครั้งแรก: 1,000 บาท | มูลค่าขั้นต่ำในการขายคืน: ไม่กำหนด |
| มูลค่าขั้นต่ำในการซื้อขายครั้งถัดไป: 1,000 บาท | ยอดคงเหลือขั้นต่ำ: ไม่กำหนด |
| | ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน: T+3 คือ 3 วันทำการ หลังจากวันทำการขายคืน |
| | (ขอสงวนสิทธิ์เปลี่ยนแปลงระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืนจริงซึ่งอาจเร็วขึ้นหรือช้าลงกว่าเดิมได้ ทั้งนี้ ไม่เกิน 6 วันทำการนับจากวันทำการขายคืน) |

หมายเหตุ: ผู้ถือหน่วยลงทุนสามารถชำระเงินค่าซื้อหน่วยลงทุนผ่านบัตรเครดิตของธนาคารไทยพาณิชย์ จำกัด (มหาชน) และบริษัท คาร์ด เอกซ์ จำกัด หรือผู้ให้บริการบัตรเครดิตอื่นใด ซึ่งเป็นไปตามหลักเกณฑ์และเงื่อนไขที่บริษัทจัดการกำหนดได้

| ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% คอปีของ NAV รวม VAT) | | |
|--|---------------|----------|
| ค่าธรรมเนียม | สูงสุดไม่เกิน | เก็บจริง |
| การจัดการ | 2.68 | 0.50 |
| รวมค่าใช้จ่าย | 3.21 | 0.60 |

หมายเหตุ: - บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ
- เปลี่ยนค่าธรรมเนียมหมายเหตุเวียน จากเดิม 0.06955 เป็น 0.06527 โดยมีผลตั้งแต่วันที่ 1 พฤษภาคม 2567 เป็นต้นไป

| ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย รวม VAT) | | |
|---|------------------------|------------------------|
| ค่าธรรมเนียม | สูงสุดไม่เกิน | เก็บจริง |
| การขาย | 3.21 | ยกเว้นไม่เรียกเก็บ |
| การรับซื้อคืน | 3.21 | ยกเว้นไม่เรียกเก็บ |
| การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า | 3.21 | ยกเว้นไม่เรียกเก็บ |
| การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก | 3.21 | ยกเว้นไม่เรียกเก็บ |
| การโอนหน่วย | 10 บาท ต่อ 1,000 หน่วย | 10 บาท ต่อ 1,000 หน่วย |

หมายเหตุ: - บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ
- ค่าใช้จ่ายในการซื้อขายหลักทรัพย์ เมื่อสั่งซื้อ/ส่งขาย/สับเปลี่ยนหน่วยลงทุน ไม่เกินร้อยละ 0.75 ของมูลค่าหน่วยลงทุน (เก็บจริง 0.045%)
- บริษัทจัดการยังไม่เปิดให้ทำการโอนหน่วยลงทุนได้ ทั้งนี้ เพื่อให้เป็นไปตามเงื่อนไขการลงทุนในกองทุนรวมเพื่อการออม

| สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน | | ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก | |
|--------------------------------|-------|-----------------------------------|-------|
| ประเภททรัพย์สิน | % NAV | ชื่อทรัพย์สิน | % NAV |
| หน่วยลงทุน | 98.99 | หน่วยลงทุน INVESCO NASDAQ 100 ETF | 98.99 |
| เงินสด | 3.30 | | |
| อื่น ๆ | -0.28 | | |
| ตราสารอนุพันธ์ | -2.01 | | |

| ข้อมูลเชิงสถิติ | |
|----------------------------|--------------|
| Maximum Drawdown | -35.14% |
| Recovering Period | 1 ปี 1 เดือน |
| FX Hedging | 96.46% |
| อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน | 0.49 เท่า |
| Sharpe ratio | - |
| Alpha | -0.73% |
| Beta | 0.92 |
| Tracking Error | - |

| ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรกของกองทุนหลัก | |
|--|-------|
| ชื่อทรัพย์สิน | % NAV |
| Microsoft | 8.75 |
| Apple | 7.41 |
| Nvidia | 6.32 |
| Amazon | 5.25 |
| Meta Platforms 'A' | 4.76 |

| การจัดสรรการลงทุนในต่างประเทศของกองทุนหลัก | |
|--|-------|
| ประเทศ | % NAV |
| สหรัฐอเมริกา | 97.30 |
| จีน | 1.02 |
| เนเธอร์แลนด์ | 0.61 |
| บราซิล | 0.55 |
| สหราชอาณาจักร | 0.52 |

| การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรมของกองทุนหลัก | |
|---|-------|
| กลุ่มอุตสาหกรรม (Sector) | % NAV |
| ไม่มีข้อมูล | |

หมายเหตุ: ข้อมูลกองทุนหลักเป็นข้อมูล ณ วันที่ 31 มีนาคม 2567

การลงทุนในกองทุนรวมอื่นเกินกว่า 20% ของ NAV

ชื่อกองทุน: Invesco NASDAQ 100 ETF

ISIN code: US46138G6492

Bloomberg code: QQQM UQ

คำอธิบาย

Maximum Drawdown เปรอ์เซ็นต์ผลขาดทุนสูงสุดของกองทุนรวมในระยะเวลา 5 ปีย้อนหลัง (หรือตั้งแต่จัดตั้งกองทุนกรณีที่ยังไม่ครบ 5 ปี) โดยวัดจากระดับ NAV ต่อหน่วยที่จุดสูงสุด ไปจนถึงจุดต่ำสุดในช่วงที่ NAV ต่อหน่วยปรับตัวลดลง ค่า Maximum Drawdown เป็นข้อมูลที่ช่วยให้ทราบถึงความเสี่ยงที่อาจจะขาดทุนจากการลงทุนในกองทุนรวม

Recovering Period ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาดังแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลาเท่าใด

FX Hedging เปรอ์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน (Portfolio Turnover) ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตของกองทุนรวมในช่วงเวลาใดช่วงเวลานึง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์กับผลรวมของมูลค่าการขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 1 ปีหารด้วยมูลค่า NAV ของกองทุนรวมเฉลี่ยในรอบระยะเวลาเดียวกัน กองทุนรวมที่มีค่า Portfolio Turnover สูง บ่งชี้ถึงการซื้อขายหลักทรัพย์บ่อยครั้งของผู้จัดการกองทุนและทำให้มีต้นทุนการซื้อขายหลักทรัพย์ที่สูง จึงต้องพิจารณาเปรียบเทียบกับผลการดำเนินงานของกองทุนรวมเพื่อประเมินความคุ้มค่าของการซื้อขายหลักทรัพย์ดังกล่าว

Sharpe Ratio อัตราส่วนระหว่างผลตอบแทนส่วนเพิ่มของกองทุนรวมเปรียบเทียบกับความเสี่ยงจากการลงทุน โดยคำนวณจากผลต่างระหว่างอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมกับอัตราผลตอบแทนที่ปราศจากความเสี่ยง (risk-free rate) เปรียบเทียบกับค่าเบี่ยงเบนมาตรฐาน (standard deviation) ของกองทุนรวม ค่า Sharpe Ratio สะท้อนถึงอัตราผลตอบแทนที่กองทุนรวมควรได้รับเพิ่มขึ้นเพื่อชดเชยกับความเสี่ยงที่กองทุนรวมรับมา โดยกองทุนรวมที่มีค่า Sharpe Ratio สูงกว่าจะเป็นกองทุนรวมที่มีประสิทธิภาพในการบริหารจัดการลงทุนที่ดีกว่า เนื่องจากได้รับผลตอบแทนส่วนเพิ่มที่สูงกว่าภายใต้ระดับความเสี่ยงเดียวกัน

Alpha ผลตอบแทนส่วนเกินของกองทุนรวมเมื่อเปรียบเทียบกับดัชนีชี้วัด (benchmark) โดยค่า Alpha ที่สูง หมายถึง กองทุนรวมสามารถสร้างผลตอบแทนได้สูงกว่าดัชนีชี้วัด ซึ่งเป็นผลจากประสิทธิภาพของผู้จัดการกองทุนรวมในการคัดเลือกหรือหาจังหวะเข้าลงทุนในหลักทรัพย์ได้อย่างเหมาะสม

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

Tracking Error อัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมมีประสิทธิภาพในการเลียนแบบดัชนีชี้วัด โดยหาก Tracking Error ต่ำ หมายถึงกองทุนรวมมีประสิทธิภาพในการสร้างผลตอบแทนให้ใกล้เคียงกับดัชนีชี้วัด กองทุนรวมที่มีค่า Tracking Error สูง จะมีอัตราผลตอบแทนโดยเฉลี่ยห่างจากดัชนีชี้วัดมากขึ้น

Yield to Maturity อัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในตราสารหนี้โดยถือจนครบกำหนดอายุ ซึ่งคำนวณจากดอกเบี้ยที่จะได้รับในอนาคตตลอดอายุตราสารและเงินต้นที่จะได้รับคืนนำมาคิดลดเป็นมูลค่าปัจจุบัน โดยใช้ตัวอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมตราสารหนี้ คำนวณจากค่าเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักของ Yield to Maturity ของตราสารหนี้แต่ละตัวที่กองทุนรวมมีการลงทุน และเนื่องจาก Yield to Maturity มีหน่วยมาตรฐานเป็นเปอร์เซ็นต์ต่อปี จึงสามารถนำไปใช้เปรียบเทียบอัตราผลตอบแทนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีนโยบายถือครองตราสารหนี้จนครบกำหนดอายุและมีลักษณะการลงทุนที่ใกล้เคียงกันได้

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด

โทรศัพท์ : 0-2949-1500 หรือ 0-2777-7777 website: www.scbam.com

ที่อยู่ : ชั้น 7 – 8 อาคาร 1 ไทยพาณิชย์ ปาร์ค พลาซ่า เลขที่ 18 ถนนรัชดาภิเษก

แขวงจตุจักร เขตจตุจักร กรุงเทพฯ 10900

กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ หุ้นยูเอส เอ็นดีคิว

ชนิดเพื่อการออมผ่านช่องทางอิเล็กทรอนิกส์ SCBNDQ(SSFE)

ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- ประเภทกองทุนรวม: กองทุนรวมตราสารทุน/กองทุนรวมที่มีนโยบายเปิดให้มีการลงทุนในกองทุนรวมอื่นภายใต้ บลจ. เดียวกัน/กองทุนรวมเพื่อการออม (SSF)/กองทุนรวมที่เฟเดอร์ (Feeder Fund)/กองทุนรวมที่เน้นลงทุนแบบมีความเสี่ยงต่างประเทศ
- กลุ่มกองทุนรวม: US Equity

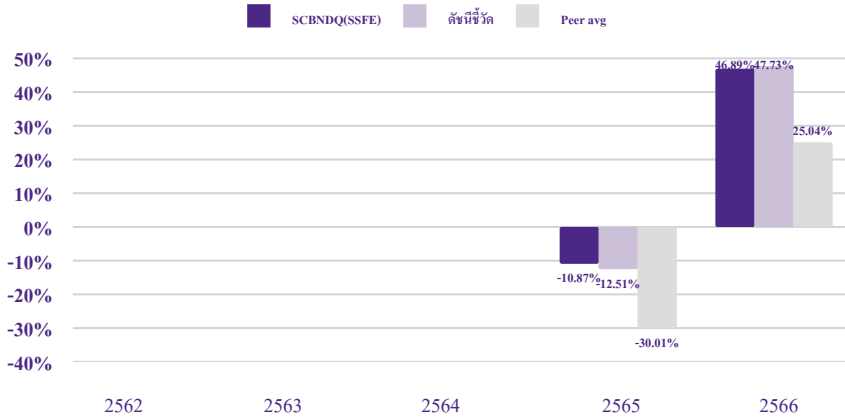
นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

• เน้นลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมต่างประเทศเพียงกองทุนเดียว (Feeder Fund) ได้แก่ Invesco NASDAQ 100 ETF (กองทุนหลัก) สกุลเงิน USD กองทุนหลักมีวัตถุประสงค์ลงทุนให้ผลการดำเนินงานของกองทุนก่อนหักค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายใกล้เคียงกับผลตอบแทนของดัชนี NASDAQ-100 Index โดยลงทุนอย่างน้อย 90% ในหลักทรัพย์ที่เป็นส่วนประกอบของดัชนีดังกล่าว ซึ่งประกอบด้วยหลักทรัพย์ของบริษัททั้งในและนอกประเทศสหรัฐอเมริกาที่ไม่ใช่สถาบันการเงิน ที่ใหญ่ที่สุด 100 บริษัท ที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ NASDAQ

กองทุนอาจลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวม หรือกองทุนรวมอสังหาริมทรัพย์ (กอง1) หรือทรัสต์เพื่อการลงทุนในอสังหาริมทรัพย์ (REITs) หรือกองทุนรวมโครงสร้างพื้นฐาน (infra) ซึ่งอยู่ภายใต้การจัดการของบริษัทจัดการในสัดส่วนไม่เกิน 20% ของ NAV

- ชื่อ บลจ.ที่บริหารจัดการกองทุนหลัก: Invesco Capital Management LLC
- กองทุนอาจลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) เพื่อเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน (Efficient portfolio management) และ/หรือการบริหารความเสี่ยง โดยป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยนของหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินในสกุลเงินต่างประเทศที่กองทุนถืออยู่เทียบกับสกุลเงินบาท ณ ขณะใดขณะหนึ่งไม่น้อยกว่า 90% ของมูลค่าทรัพย์สินที่ลงทุนในต่างประเทศ
- กลยุทธ์ในการบริหารกองทุนรวม: กองทุนไทยมุ่งหวังให้ผลประกอบการเคลื่อนไหวตามกองทุนหลัก ส่วนกองทุนหลักมุ่งหวังให้ผลประกอบการเคลื่อนไหวตามดัชนีชี้วัด (Passive Management)

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (% ต่อปี)



หมายเหตุ: ในปีที่กองทุนจดทะเบียน ผลการดำเนินงานจะแสดงตั้งแต่วันที่จดทะเบียนกองทุนจนถึงสิ้นปีปฏิทิน

ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปีกลมุด

| | YTD | 3 เดือน | 6 เดือน | 1 ปี ¹ | 3 ปี ¹ | 5 ปี ¹ | 10 ปี ¹ | ตั้งแต่จัดตั้ง ¹ |
|---------------------------------------|------|---------|---------|-------------------|-------------------|-------------------|--------------------|-----------------------------|
| SCBNDQ(SSFE) | 7.55 | 7.55 | 21.93 | 34.04 | N/A | N/A | N/A | 20.87 |
| ดัชนีชี้วัด | 7.66 | 7.66 | 21.95 | 34.07 | N/A | N/A | N/A | 20.08 |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน ² | 8.66 | 8.66 | 20.91 | 26.41 | N/A | N/A | N/A | N/A |
| ความผันผวนของกองทุน | 7.69 | 7.69 | 10.82 | 15.99 | N/A | N/A | N/A | 22.60 |
| ความผันผวนของดัชนีชี้วัด | 7.99 | 7.99 | 11.10 | 16.31 | N/A | N/A | N/A | 22.73 |

หมายเหตุ: ¹ % ต่อปี

² ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน ตามการจัดกลุ่มกองทุนรวมของ AIMC category

ระดับความเสี่ยง

| | | | | | | | | | |
|-----|---|---|---|---|---|---|---|---|-----|
| ต่ำ | 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | สูง |
|-----|---|---|---|---|---|---|---|---|-----|

6 : เสี่ยงสูง

ลงทุนในตราสารทุนเป็นหลัก โดยเฉลี่ยในรอบปีไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม

| | |
|----------------------------|---------------------|
| วันจดทะเบียนกองทุน | 27 สิงหาคม 2564 |
| วันเริ่มต้น Class | 10 มิถุนายน 2565 |
| นโยบายการจ่ายเงินปันผล | จ่าย |
| อายุกองทุน | ไม่กำหนดอายุโครงการ |
| ผู้จัดการกองทุนรวม | |
| นายวิจักขณ์ ณ เชียงใหม่ | 9 เมษายน 2566 |
| น.ส.นริศรา ดิณรัตน์สกุลชัย | 2 พฤศจิกายน 2564 |

ดัชนีชี้วัด

ผลการดำเนินงานของกองทุนรวมหลัก 100% ปรับด้วยต้นทุนการป้องกันความเสี่ยงอัตราแลกเปลี่ยนเพื่อคำนวณผลตอบแทนเป็นสกุลเงินบาท ณ วันที่ลงทุน (ในอัตราส่วน 95%) และปรับด้วยอัตราแลกเปลี่ยนเพื่อเทียบกับค่าสกุลเงินบาท ณ วันที่คำนวณผลตอบแทน (ในอัตราส่วน 5%)

คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวม มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต

ได้รับการรับรองจาก CAC



| การซื้อขายหน่วยลงทุน | การขายคืนหน่วยลงทุน |
|--|---|
| วันทำการซื้อ: ทุกวันทำการ | วันทำการขายคืน: ทุกวันทำการ |
| เวลาทำการ: เปิดทำการ ถึง 15.30 น. | เวลาทำการ: เปิดทำการ ถึง 15.30 น. |
| มูลค่าขั้นต่ำในการซื้อขายครั้งแรก: 1 บาท | มูลค่าขั้นต่ำในการขายคืน: ไม่กำหนด |
| มูลค่าขั้นต่ำในการซื้อขายครั้งถัดไป: 1 บาท | ยอดคงเหลือขั้นต่ำ: ไม่กำหนด |
| | ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน: T+3 คือ 3 วันทำการ หลังจากวันทำรายการขายคืน |
| | (ขอสงวนสิทธิ์เปลี่ยนแปลงระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืนจริงซึ่งอาจเร็วขึ้นหรือช้าลงกว่าเดิมได้ ทั้งนี้ ไม่เกิน 6 วันทำการนับจากวันทำรายการขายคืน) |

หมายเหตุ: ซื้อขายหน่วยลงทุนผ่าน SCBAM Fund Click Application บริษัทจัดการอาจปฏิเสธคำสั่งซื้อและ/หรือคำสั่งสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า หากมูลค่าหน่วยลงทุนคงเหลือ มูลค่าการสั่งซื้อหน่วยลงทุนสุทธิ และมูลค่าการสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้าสู่สุทธิของแต่ละบัญชีผู้ถือหน่วยลงทุนและ/หรือผู้ถือหน่วยลงทุนแต่ละราย ในทุกหน่วยลงทุนชนิดช่องทางอิเล็กทรอนิกส์ และทุกหน่วยลงทุนชนิดเพื่อสิทธิประโยชน์ทางภาษีผ่านช่องทางอิเล็กทรอนิกส์* เมื่อรวมกันทุกกองทุนภายใต้การบริหารจัดการของบริษัทจัดการแล้ว มีมูลค่ารวมกันมากกว่าหนึ่งล้านบาท (มูลค่ารวมทั้งหนึ่ง) ทั้งนี้ สำหรับหน่วยลงทุนชนิดช่องทางอิเล็กทรอนิกส์ของกองทุนรวมเพื่อสิทธิประโยชน์ทางภาษี** และหน่วยลงทุนชนิดเพื่อสิทธิประโยชน์ทางภาษีผ่านช่องทางอิเล็กทรอนิกส์* จะกำหนดมูลค่ารวมกันไม่เกินสองแสนบาท (มูลค่ารวมทั้งสอง) โดยมูลค่ารวมทั้งสองนับรวมอยู่ในมูลค่ารวมทั้งหนึ่ง* หมายถึง ชนิดเพื่อการออมผ่านช่องทางอิเล็กทรอนิกส์ และชนิดเพื่อสิทธิประโยชน์ทางภาษีผ่านช่องทางอิเล็กทรอนิกส์อื่นๆที่มีขึ้นในอนาคต
**หมายถึง กองทุนรวมเพื่อการเลี้ยงชีพ และกองทุนรวมเพื่อสิทธิประโยชน์ทางภาษีอื่นๆที่มีขึ้นในอนาคต

| ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV รวม VAT) | | |
|---|---------------|--------------------|
| ค่าธรรมเนียม | สูงสุดไม่เกิน | เก็บจริง |
| การจัดการ | 1.61 | ยกเว้นไม่เรียกเก็บ |
| รวมค่าใช้จ่าย | 2.14 | 0.10 |

หมายเหตุ: - บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ
- เปลี่ยนค่าธรรมเนียมหมายเหตุเขียน จากเดิม 0.06955 เป็น 0.06527 โดยมีผลตั้งแต่วันที่ 1 พฤษภาคม 2567 เป็นต้นไป

| ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย รวม VAT) | | |
|---|------------------------|------------------------|
| ค่าธรรมเนียม | สูงสุดไม่เกิน | เก็บจริง |
| การขาย | 3.21 | ยกเว้นไม่เรียกเก็บ |
| การรับซื้อคืน | 3.21 | ยกเว้นไม่เรียกเก็บ |
| การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า | 3.21 | ยกเว้นไม่เรียกเก็บ |
| การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก | 3.21 | ยกเว้นไม่เรียกเก็บ |
| การโอนหน่วย | 10 บาท ต่อ 1,000 หน่วย | 10 บาท ต่อ 1,000 หน่วย |

หมายเหตุ: - บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ
- ค่าใช้จ่ายในการซื้อขายหลักทรัพย์ เมื่อสั่งซื้อ/สั่งขาย/สับเปลี่ยนหน่วยลงทุน ไม่เกินร้อยละ 0.75 ของมูลค่าหน่วยลงทุน (เก็บจริง 0.045%)
- บริษัทจัดการยังไม่เปิดให้ทำรายการโอนหน่วยลงทุนได้ ทั้งนี้ เพื่อให้เป็นไปตามเงื่อนไขการลงทุนในกองทุนรวมเพื่อการออม

| สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน | | ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก | |
|--------------------------------|-------|-------------------------------|-------|
| ประเภททรัพย์สิน | % NAV | ชื่อทรัพย์สิน | % NAV |
| หน่วยลงทุน | 98.99 | หน่วยลงทุน INVESCO NASDAQ 100 | 98.99 |
| เงินฝาก | 3.30 | ETF | |
| อื่น ๆ | -0.28 | | |
| ตราสารอนุพันธ์ | -2.01 | | |

| ข้อมูลเชิงสถิติ | |
|----------------------------|-----------|
| Maximum Drawdown | -22.07% |
| Recovering Period | 5 เดือน |
| FX Hedging | 96.46% |
| อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน | 0.49 เท่า |
| Sharpe ratio | - |
| Alpha | -0.10% |
| Beta | 0.92 |
| Tracking Error | - |

| ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรกของกองทุนหลัก | |
|--|-------|
| ชื่อทรัพย์สิน | % NAV |
| Microsoft | 8.75 |
| Apple | 7.41 |
| Nvidia | 6.32 |
| Amazon | 5.25 |
| Meta Platforms 'A' | 4.76 |

| การจัดสรรการลงทุนในต่างประเทศของกองทุนหลัก | |
|--|-------|
| ประเทศ | % NAV |
| สหรัฐอเมริกา | 97.30 |
| จีน | 1.02 |
| เนเธอร์แลนด์ | 0.61 |
| บราซิล | 0.55 |
| สหราชอาณาจักร | 0.52 |

| การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรมของกองทุนหลัก | |
|---|-------|
| กลุ่มอุตสาหกรรม (Sector) | % NAV |
| ไม่มีข้อมูล | |

หมายเหตุ: ข้อมูลกองทุนหลักเป็นข้อมูล ณ วันที่ 31 มีนาคม 2567

การลงทุนในกองทุนรวมอื่นเกินกว่า 20% ของ NAV

ชื่อกองทุน: Invesco NASDAQ 100 ETF

ISIN code: US46138G6492

Bloomberg code: QQQM UQ

คำอธิบาย

Maximum Drawdown เปรอ์เซ็นต์ผลขาดทุนสูงสุดของกองทุนรวมในระยะเวลา 5 ปีย้อนหลัง (หรือตั้งแต่จัดตั้งกองทุนกรณีที่ยังไม่ครบ 5 ปี) โดยวัดจากระดับ NAV ต่อหน่วยที่จุดสูงสุด ไปจนถึงจุดต่ำสุดในช่วงที่ NAV ต่อหน่วยปรับตัวลดลง ค่า Maximum Drawdown เป็นข้อมูลที่ช่วยให้ทราบถึงความเสี่ยงที่อาจจะขาดทุนจากการลงทุนในกองทุนรวม

Recovering Period ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาดังแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลาสั้นเท่าใด

FX Hedging เปรอ์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน (Portfolio Turnover) ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตของกองทุนรวมในช่วงเวลาใดช่วงเวลานึง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์กับผลรวมของมูลค่าการขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 1 ปีหารด้วยมูลค่า NAV ของกองทุนรวมเฉลี่ยในรอบระยะเวลาเดียวกัน กองทุนรวมที่มีค่า Portfolio Turnover สูง บ่งชี้ถึงการซื้อขายหลักทรัพย์บ่อยครั้งของผู้จัดการกองทุนและทำให้มีต้นทุนการซื้อขายหลักทรัพย์ที่สูง จึงต้องพิจารณาเปรียบเทียบกับผลการดำเนินงานของกองทุนรวมเพื่อประเมินความคุ้มค่าของการซื้อขายหลักทรัพย์ดังกล่าว

Sharpe Ratio อัตราส่วนระหว่างผลตอบแทนส่วนเพิ่มของกองทุนรวมเปรียบเทียบกับความเสี่ยงจากการลงทุน โดยคำนวณจากผลต่างระหว่างอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมกับอัตราผลตอบแทนที่ปราศจากความเสี่ยง (risk-free rate) เปรียบเทียบกับค่าเบี่ยงเบนมาตรฐาน (standard deviation) ของกองทุนรวม ค่า Sharpe Ratio สะท้อนถึงอัตราผลตอบแทนที่กองทุนรวมควรได้รับเพิ่มขึ้นเพื่อชดเชยกับความเสี่ยงที่กองทุนรวมรับมา โดยกองทุนรวมที่มีค่า Sharpe Ratio สูงกว่าจะเป็นกองทุนรวมที่มีประสิทธิภาพในการบริหารจัดการลงทุนที่ดีกว่า เนื่องจากได้รับผลตอบแทนส่วนเพิ่มที่สูงกว่าภายใต้ระดับความเสี่ยงเดียวกัน

Alpha ผลตอบแทนส่วนเกินของกองทุนรวมเมื่อเปรียบเทียบกับดัชนีชี้วัด (benchmark) โดยค่า Alpha ที่สูง หมายถึง กองทุนรวมสามารถสร้างผลตอบแทนได้สูงกว่าดัชนีชี้วัด ซึ่งเป็นผลจากประสิทธิภาพของผู้จัดการกองทุนรวมในการคัดเลือกหรือหาจังหวะเข้าลงทุนในหลักทรัพย์ได้อย่างเหมาะสม

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

Tracking Error อัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมมีประสิทธิภาพในการเลียนแบบดัชนีชี้วัด โดยหาก Tracking Error ต่ำ หมายถึงกองทุนรวมมีประสิทธิภาพในการสร้างผลตอบแทนให้ใกล้เคียงกับดัชนีชี้วัด กองทุนรวมที่มีค่า Tracking Error สูง จะมีอัตราผลตอบแทนโดยเฉลี่ยห่างจากดัชนีชี้วัดมากขึ้น

Yield to Maturity อัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในตราสารหนี้โดยถือจนครบกำหนดอายุ ซึ่งคำนวณจากค่าเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักของ Yield to Maturity ของตราสารหนี้แต่ละตัวที่กองทุนรวมมีการลงทุน และเนื่องจาก Yield to Maturity มีหน่วยมาตรฐานเป็นเปอร์เซ็นต์ต่อปี จึงสามารถนำไปใช้เปรียบเทียบอัตราผลตอบแทนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีนโยบายถือครองตราสารหนี้จนครบกำหนดอายุและมีลักษณะการลงทุนที่ใกล้เคียงกันได้

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด

โทรศัพท์ : 0-2949-1500 หรือ 0-2777-7777 website: www.scbam.com

ที่อยู่ : ชั้น 7 – 8 อาคาร 1 ไทยพาณิชย์ ปาร์ค พลาซ่า เลขที่ 18 ถนนรัชดาภิเษก

แขวงจตุจักร เขตจตุจักร กรุงเทพฯ 10900