

กองทุนเปิด ยูโอบี สมาร์ท แอคทีฟ เซท 100 (UOBSAS100)

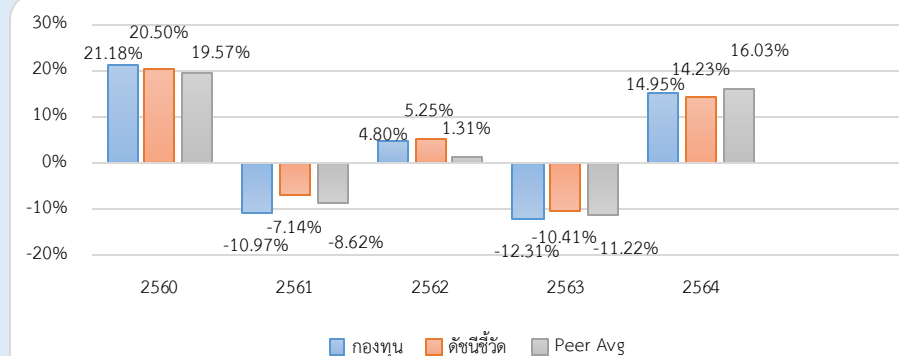
ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมตราสารทุน
- Equity Large Cap

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- เน้นลงทุนในตราสารทุนของบริษัทที่มีรายชื่ออยู่ในดัชนี SET100 เป็นหลัก
- มุ่งหวังให้ผลประกอบการสูงกว่าดัชนีชี้วัด แต่ยังคงควบคุมความคลาดเคลื่อนจากดัชนีชี้วัด (Enhancing Index)

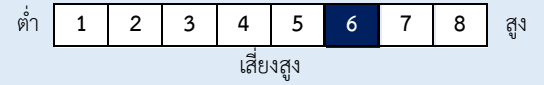
ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน



ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปีกลมุด (% ต่อปี)

	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี
กองทุน	-3.84	-5.47	-3.65	4.45
ดัชนีชี้วัด	-2.73	-3.46	-2.51	7.15
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	-3.62	-4.16	-3.55	7.91
ความผันผวนกองทุน	8.88	6.24	8.48	11.74
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	8.98	6.38	8.61	11.98
	3 ปี	5 ปี	10 ปี	ตั้งแต่จัดตั้ง
กองทุน	-2.44	1.32	4.21	7.54
ดัชนีชี้วัด	-2.00	2.14	5.01	8.08
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	-2.08	1.54	4.15	-
ความผันผวนกองทุน	19.69	17.36	15.88	19.04
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	22.30	19.21	16.28	20.56

ระดับความเสี่ยง



ลงทุนในตราสารทุนเป็นหลักโดยเฉลี่ยในรอบปีไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน	12 พ.ค. 2548
วันเริ่มต้น class	ไม่มีการแบ่ง Class
นโยบายการจ่ายเงินปันผล	ไม่จ่าย
อายุกองทุน	ไม่กำหนด

ผู้จัดการกองทุนรวม

วันเริ่มบริหารกองทุน	
น.ส. ปราณี ศรีมหาลาภ	01 ม.ค. 64
น.ส. ศรสวรรค์ เต็มวุฒิกุล	14 มิ.ย. 64

ดัชนีชี้วัด

ดัชนีผลตอบแทนรวม SET100

คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน

- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวม

มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต: ได้รับการรับรองจาก CAC

“ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือบริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่องได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม”

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



www.uobam.co.th

การซื้อขายหน่วยลงทุน

วันทำการซื้อ: ทุกวันทำการ

เวลาทำการ: 08:30 - 15:30 น.

การซื้อขายครั้งแรกขั้นต่ำ: ไม่กำหนด

การซื้อขายครั้งถัดไปขั้นต่ำ: ไม่กำหนด

หมายเหตุ :

การขายคืนหน่วยลงทุน

วันทำการขายคืน: ทุกวันทำการ

เวลาทำการ: 08:30 - 15:30 น.

การขายคืนขั้นต่ำ: ไม่กำหนด

ยอดคงเหลือขั้นต่ำ: ไม่กำหนด

ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน: T+3

วันทำการหลังจากวันทำการขายคืน

ข้อมูลเชิงสถิติ

Maximum Drawdown	-42.12 %
Recovering Period	1 ปี 9 เดือน
Sharpe Ratio	-12.41
Alpha	-0.44
Beta	0.90
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน	0.90 เท่า

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	1.8190	1.8190
รวมค่าใช้จ่าย	2.56586	1.9893

หมายเหตุ :

บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ

การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม

sector	% NAV
1. พลังงานและสาธารณูปโภค	22.33
2. ธนาคาร	11.83
3. ขนส่ง	10.76
4. เทคโนโลยีสารสนเทศและการสื่อสาร	8.60
5. พาณิชยกรรม	8.32

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การขาย	0.50	0.50
การรับซื้อคืน	0.50	0.50
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า	0.50	0.50
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก	0.50	0.50
การโอนหน่วย	10 บาท/500 หน่วย หรือเศษของ 500 หน่วย	10 บาท/500 หน่วย หรือเศษของ 500 หน่วย

หมายเหตุ :

- กรณีสับเปลี่ยนเข้า บลจ.จะไม่คิดค่าธรรมเนียมการขาย
- กรณีสับเปลี่ยนออก บลจ.จะไม่คิดค่าธรรมเนียมการรับซื้อคืน
- บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน

breakdown	% NAV
1. ตราสารทุน	93.18
2. เงินสด	6.11
3. อื่นๆ	0.71

ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก

holding	% NAV
1. บริษัท ท่าอากาศยานไทย จำกัด (มหาชน)	7.89
2. บริษัท ปตท. จำกัด (มหาชน)	5.69
3. บริษัท ปตท.สำรวจและผลิตปิโตรเลียม จำกัด (มหาชน)	5.07
4. บริษัท แอควานซ์ อินโฟร เซอร์วิส จำกัด (มหาชน)	4.94
5. บริษัท กัลฟ์ เอ็นเนอร์จี ดีเวลลอปเมนท์ จำกัด (มหาชน)	4.90

คำอธิบาย

Maximum Drawdown : เปอร์เซนต์ผลขาดทุนสูงสุดของกองทุนรวมในระยะเวลา 5 ปี ย้อนหลัง (หรือตั้งแต่จัดตั้งกองทุนกรณีที่ยังไม่ครบ 5 ปี) โดยวัดจากระดับ NAV ต่อหน่วยที่จุดสูงสุด ไปจนถึงจุดต่ำสุดในช่วงที่ NAV ต่อหน่วยปรับตัวลดลง ค่า Maximum Drawdown เป็นข้อมูลที่ช่วยให้ทราบถึงความเสี่ยงที่อาจจะขาดทุนจากการลงทุนในกองทุนรวม

Recovering Period : ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาดังแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินเริ่มต้นใช้ระยะเวลาตามเท่าใด

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน : ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตกองทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลาหนึ่ง 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 สูงกว่าจะเป็นกองทุนที่มีประสิทธิภาพในการบริหารจัดการลงทุนที่ดีกว่า เนื่องจากได้รับผลตอบแทนส่วนเพิ่มที่สูงกว่าภายใต้ระดับความเสี่ยงเดียวกัน

Alpha : ผลตอบแทนส่วนเกินของกองทุนรวมเมื่อเปรียบเทียบกับดัชนีชี้วัด (benchmark) โดยค่า Alpha ที่สูง หมายถึง กองทุนสามารถสร้างผลตอบแทนได้สูงกว่าดัชนีชี้วัด

ซึ่งเป็นผลจากประสิทธิภาพของผู้จัดการกองทุนในการคัดเลือกหรือจัดพอร์ตการลงทุนในหลักทรัพย์ได้อย่างเหมาะสม

Beta : ระดับและทิศทางการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุน โดยเปรียบเทียบกับอัตราเปลี่ยนแปลงของตลาด Beta น้อยกว่า 1

แสดงว่าหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนน้อยกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด Beta มากกว่า 1 แสดงว่า

หลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนมากกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด

Tracking Error : เพื่อให้พิจารณาความผันผวนของส่วนต่างของผลตอบแทนเฉลี่ยของกองทุนรวมและผลตอบแทนของดัชนีชี้วัด ซึ่งสะท้อนให้เห็นถึงประสิทธิภาพในการเลียนแบบดัชนีชี้วัดของกองทุนรวมที่มีการเบี่ยงเบนออกไปจากดัชนีชี้วัด มากน้อยเพียงใด เช่น หากกองทุนรวมมีค่า TE ต่ำ แสดงว่า อัตราผลตอบแทนของกองทุนมีการเบี่ยงเบนออกไปจากดัชนีชี้วัดในอัตราที่ต่ำ ดังนั้น กองทุนรวมนี้จึงมีประสิทธิภาพในการเลียนแบบดัชนีชี้วัด ในขณะที่กองทุนที่มีค่า TE สูง

แสดงว่าอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมมีการเบี่ยงเบนออกจากดัชนีชี้วัดในอัตราที่สูง ดังนั้น โอกาสที่ผลตอบแทนการลงทุนจะเป็นไปตามผลตอบแทนของ benchmark ก็จะลดน้อยลง เป็นต้น

Yield to Maturity : อัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในตราสารหนี้โดยถือจนครบกำหนดอายุ ซึ่งคำนวณจากดอกเบี้ยที่จะได้รับในอนาคตตลอดอายุตราสารและเงินต้นที่จะได้รับคืนนำมาคิดลดเป็นมูลค่าปัจจุบัน

โดยใช้วิธีอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมตราสารหนี้คำนวณจากค่าเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักของ Yield to Maturity ของตราสารหนี้แต่ละตัวที่กองทุนมีการลงทุน และเนื่องจาก Yield to Maturity มีหน่วยมาตรฐานเป็นเปอร์เซ็นต์ต่อปี

จึงสามารถนำไปใช้เปรียบเทียบอัตราผลตอบแทนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีนโยบายถือครองตราสารหนี้จนครบกำหนดอายุและมีลักษณะการลงทุนที่ใกล้เคียงกันได้