



กองทุนเปิด ยูโนเต็ด ทรานซาร์หนีไทย ชัสเทนเนเบิล (UTSB)

หน่วยลงทุนชนิดไทยเพื่อความยั่งยืนที่ได้รับสิทธิประโยชน์ทางภาษีและไม่จ่ายเงินปันผล

UTSB-THAIESG

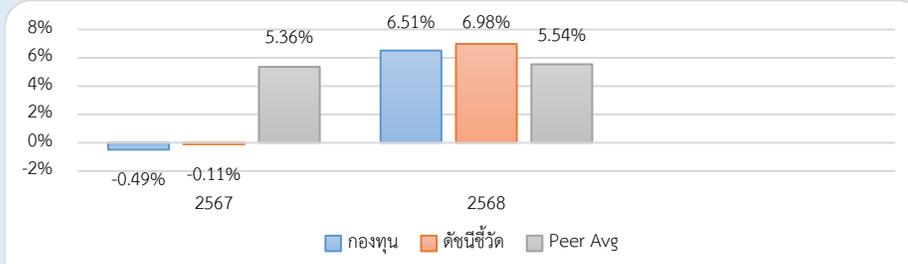
ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมตราสารหนี้/ กองทุนรวมไทยเพื่อความยั่งยืน (Thailand ESG Fund)
- Cross Investing Fund/ กองทุนรวมเพื่อความยั่งยืน (SRI Fund)
- กองทุนที่ลงทุนแบบมีความเสี่ยงทั้งในและต่างประเทศ
- กลุ่ม Long Term General Bond

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- ลงทุนในตราสารหนี้ เงินฝาก หรือตราสารเทียบเท่าเงินฝาก หน่วย CYS จุฬารัตนการให้ยืมหลักทรัพย์ โดยหลักทรัพย์ที่ให้ยืมเป็นตราสารหนี้และธุรกรรมการซื้อโดยมีสัญญาขายคืน ทั้งในและต่างประเทศรวมกันทุกขณะไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของ NAV โดยกองทุนจะเน้นลงทุนในตราสารหนี้ที่เป็นตราสารภาครัฐไทยโดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของ NAV
- กองทุนจะลงทุนในพันธบัตรรัฐบาล พันธบัตรที่กระทรวงการคลังกำกับต้นเงินและดอกเบี้ย หรือหุ้นกู้ที่กระทรวงการคลังกำกับต้นเงินและดอกเบี้ยแต่ไม่รวมถึงหุ้นกู้แปลงสภาพ ซึ่งเป็นพันธบัตรหรือหุ้นกู้เพื่ออนุรักษ์สิ่งแวดล้อม พันธบัตรหรือหุ้นกู้เพื่อความยั่งยืน หรือพันธบัตรหรือหุ้นกู้ส่งเสริมความยั่งยืน และกองทุนจะลงทุนในตราสารเพื่ออนุรักษ์สิ่งแวดล้อมตราสารเพื่อความยั่งยืน หรือตราสารส่งเสริมความยั่งยืน ที่มีการเปิดเผยข้อมูลตามที่สำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ต. กำหนด โดยมี net exposure โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของ NAV ทั้งนี้ ผู้ลงทุนสามารถศึกษาข้อมูลเพิ่มเติมได้ในหนังสือชี้ชวนส่วนข้อมูลกองทุนรวม
- กองทุนอาจลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมตราสารหนี้อื่นซึ่งอยู่ภายใต้การจัดการของบริษัทจัดการ โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่เกินร้อยละ 20 ของ NAV
- กองทุนอาจพิจารณาลงทุนใน Derivatives เพื่อเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน
- มุ่งหวังให้ผลประกอบการสูงกว่าดัชนีชี้วัด (active management)

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน



ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปีกลุ่ม (%)

	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี*
กองทุน	-0.72	-0.13	-4.29	4.35
ดัชนีชี้วัด	-0.31	0.46	-2.68	5.28
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	-0.35	0.20	-2.40	4.14
ความผันผวนกองทุน	2.34	2.50	3.98	4.84
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	1.86	1.99	3.29	4.06

	3 ปี*	5 ปี*	10 ปี*	ตั้งแต่จัดตั้ง*
กองทุน	-	-	-	4.34
ดัชนีชี้วัด	-	-	-	5.43
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	-	-	-	-
ความผันผวนกองทุน	-	-	-	4.58
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	-	-	-	3.87

หมายเหตุ : * % ต่อปี

ระดับความเสี่ยง

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

เสี่ยงปานกลางค่อนข้างต่ำ

ลงทุนในพันธบัตรรัฐบาลเป็นหลัก โดยเฉลี่ยในรอบปี

ไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน	17 ธ.ค. 2567
วันเริ่มต้น class	17 ธ.ค. 2567
นโยบายการจ่ายเงินปันผล	ไม่จ่าย
อายุกองทุน	ไม่กำหนด
การป้องกันความเสี่ยง FX	ตามดุลพินิจของผู้จัดการกองทุน (dynamic hedging)
การเรียกเก็บค่าธรรมเนียมตามผลการดำเนินงาน	ไม่มี
ผู้จัดการกองทุนรวม	วันเริ่มบริหารกองทุน
น.ส. ศศิณัฐ ลัทธิกุลธรรม	19 พ.ย. 2568
นาย จารุวัตร ปรีดีเปรมกุล	17 ธ.ค. 2567

ดัชนีชี้วัด

1. ผลตอบแทนรวมของดัชนีพันธบัตรรัฐบาล ESG ของสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย (ThaiBMA Government Bond ESG Index – Total Return) ในสัดส่วนร้อยละ 75.00
2. ผลตอบแทนรวมของดัชนีพันธบัตรรัฐบาลระยะสั้น ของสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย (ThaiBMA Short-Term Government Bond Index – Total Return) ในสัดส่วนร้อยละ 5.00
3. ผลตอบแทนรวมของดัชนีหุ้นยั่งยืน กลุ่ม 1 (1<TTM<=3) ของสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย (ThaiBMA Corporate Bond ESG Index – Total Return, Group 1 (1<TTM<=3)) ในสัดส่วนร้อยละ 5.00
4. อัตราดอกเบี้ยเงินฝากประจำ 1 ปี วงเงินน้อยกว่า 5 ล้านบาท เฉลี่ยของ 3 ธนาคารพาณิชย์ขนาดใหญ่ ได้แก่ ธนาคารกรุงเทพ ธนาคารกสิกรไทย ธนาคารไทยพาณิชย์ หลังหักภาษี ในสัดส่วนร้อยละ 15.00 (รายละเอียดเพิ่มเติม หน้า 3)

คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
 - ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวม มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต
- การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต: ได้ประกาศเจตนารมณ์เข้าร่วม CAC

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



“ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือบริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่องได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม”

www.uobam.co.th

การซื้อหน่วยลงทุน

วันทำการซื้อ: ทุกวันทำการ

เวลาทำการ: 08:30 - 15:30 น.

การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ: ไม่กำหนด

การซื้อครั้งถัดไปขั้นต่ำ: ไม่กำหนด

การขายคืนหน่วยลงทุน

วันทำการขายคืน: ทุกวันทำการ

เวลาทำการ: 08:30 - 15:00 น.

การขายคืนขั้นต่ำ: ไม่กำหนด

ยอดคงเหลือขั้นต่ำ: ไม่กำหนด

ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน: ภายใน T+5 วันทำการ

หลังจากวันที่ทำรายการขายคืน

โดยทั่วไปจะได้รับเงินภายใน T+2 วันทำการ

หลังจากวันที่ทำรายการขายคืน

ข้อมูลเชิงสถิติ

Maximum Drawdown	-7.72 %
Recovering Period	-
FX Hedging	0.00 %
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน	0.55 เท่า
อายุเฉลี่ยของตราสารหนี้	9 ปี 9 เดือน 4 วัน
Yield to Maturity	2.03

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV รวม VAT)

ค่าธรรมเนียมต่อไปนี้จะส่งผลกระทบต่อผู้ลงทุน เนื่องจากจะทำให้ผลตอบแทนจากการลงทุนลดลง ดังนั้นผู้ลงทุนควรตรวจสอบทุกครั้งก่อนตัดสินใจลงทุน

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	2.1400	0.2568
ค่าตอบแทนแก่ผู้สนับสนุนการขายหรือรับซื้อคืนหน่วยลงทุนของกองทุนรวม (trailer fee) :	มี	
รวมค่าใช้จ่าย	4.78825	0.4947

หมายเหตุ :

- บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริง เพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ
- หากกองทุนลงทุนในกองทุนภายใต้การจัดการเดียวกัน บลจ.จะไม่เรียกเก็บค่าธรรมเนียมการจัดการซ้ำซ้อนกับกองทุนปลายทาง

การจัดสรรการลงทุนในต่างประเทศ

country	% NAV
---------	-------

ผู้ออกตราสาร 5 อันดับแรก

ผู้ออกตราสาร	% NAV
1. กระทรวงการคลัง	80.15
2. บริษัท โรงแรมเซ็นทรัลพลาซา จำกัด (มหาชน)	5.92
3. บริษัท ไมเนอร์ อินเตอร์เนชั่นแนล จำกัด (มหาชน)	4.94
4. บริษัท ไทยยูเนี่ยน กรุ๊ป จำกัด (มหาชน)	4.13
5. บริษัท ทางด่วนและรถไฟฟ้ากรุงเทพ จำกัด (มหาชน)	1.77

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าหน่วยลงทุน รวม VAT)

ผู้ลงทุนจะถูกเรียกเก็บค่าธรรมเนียมต่อไปนี้โดยตรงทุกครั้งเมื่อทำรายการซื้อขายหรือสับเปลี่ยนหน่วยลงทุน

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การขาย	1.00	ยกเว้น
การรับซื้อคืน	1.00	ยกเว้น
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า	1.00	ยกเว้น
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก	1.00	1.00

การโอนหน่วยไม่สามารถโอนหน่วยลงทุนได้ ไม่สามารถโอนหน่วยลงทุนได้ ไม่สามารถโอนหน่วยลงทุนได้

หมายเหตุ :

- กรณีสับเปลี่ยนเข้า บลจ.จะไม่คิดค่าธรรมเนียมการขาย
- ค่าธรรมเนียมการสับเปลี่ยนออกไป บลจ.อื่นจะเรียกเก็บไม่ต่ำกว่า 200 บาท ต่อ 1 รายการ กรณีที่เป็นการสับเปลี่ยนระหว่างกองทุน Thai ESG ภายใต้การจัดการของ บลจ. จะยกเว้นค่าธรรมเนียมดังกล่าว
- หากกองทุนลงทุนในกองทุนภายใต้การจัดการเดียวกัน บลจ.จะไม่เรียกเก็บค่าธรรมเนียมการขาย และ/หรือค่าธรรมเนียมการรับซื้อคืนซ้ำซ้อนกับกองทุนปลายทาง
- บริษัทจัดการอาจคิดค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วยกับผู้สั่งซื้อหรือผู้ถือหน่วยลงทุน แต่ละกลุ่มหรือแต่ละคนไม่เท่ากันได้
- บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ

การจัดสรรการลงทุนตามอันดับความน่าเชื่อถือ (%)

	ในประเทศ	national	international
1. Gov bond/AAA	81.38	-	-
2. A	18.41	-	-

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน

breakdown	% NAV
1. พันธบัตรรัฐบาลและที่มีรัฐบาลค้ำประกัน	81.38
2. หุ้นกู้	18.41
3. เงินฝาก บัตรเงินฝาก ตั๋วสัญญาใช้เงิน ตั๋วแลกเงิน	0.63
ที่ออกโดยสถาบันการเงิน	
4. สินทรัพย์อื่น (รายการค้างรับ/ค้างจ่าย)	-0.42

ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก

holding	% NAV
1. พันธบัตร : กระทรวงการคลัง SLB406A 17/06/2040 2.700	55.66
2. พันธบัตร : กระทรวงการคลัง ESGLB376A 17/06/2037 3.390	23.68
3. หุ้นกู้ : บริษัท ไมเนอร์ อินเตอร์เนชั่นแนล จำกัด(มหาชน) MINT325A 19/05/2032 2.850	4.35
4. หุ้นกู้ : บริษัท โรงแรมเซ็นทรัลพลาซา จำกัด (มหาชน) CENTEL30NA 20/11/2030 2.350	4.19

วัตถุประสงค์การลงทุนที่เกี่ยวข้องกับความยั่งยืน

กองทุนมีวัตถุประสงค์ในการช่วยส่งเสริมการลงทุนเพื่อความยั่งยืนผ่านการลงทุนในพันธบัตรรัฐบาล พันธบัตรที่กระทรวงการคลังค้ำประกันต้นเงินและดอกเบี้ย หรือหุ้นที่กระทรวงการคลังค้ำประกันต้นเงินและดอกเบี้ยแต่ไม่รวมถึงหุ้นที่แปลงสภาพ หรือลงทุนในตราสารภาครัฐอื่นใด ซึ่งเป็นพันธบัตรหรือหุ้นที่เออนูรักษ์สิ่งแวดล้อม (green bond) พันธบัตรหรือหุ้นเพื่อความยั่งยืน (sustainability bond) หรือพันธบัตรหรือหุ้นที่ส่งเสริมความยั่งยืน (sustainability – linked bond) และผ่านการลงทุนในตราสารเพื่อเออนูรักษ์สิ่งแวดล้อม (green bond) ตราสารเพื่อความยั่งยืน (sustainability bond) หรือตราสารส่งเสริมความยั่งยืน (sustainability - linked bond) ที่มีการเปิดเผยข้อมูลตามที่สำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ต. กำหนด

เป้าหมายด้านความยั่งยืน

เพื่อแสวงหาผลตอบแทนระยะยาวโดยการลงทุนในตราสารที่เกี่ยวข้องกับความยั่งยืนและเป็นการส่งเสริมการลงทุนและสนับสนุนผู้ออกตราสารหนี้ในกลุ่มความยั่งยืนที่คำนึงถึงปัจจัยด้านESG รวมถึงเป็นการกระตุ้นหรือส่งเสริมระบบและกลไกการลงทุนในการพัฒนาสังคมสิ่งแวดล้อมและความยั่งยืนด้านการลงทุนของประเทศไทย

กรอบการลงทุน (investment universe)

กองทุนกำหนดกรอบนโยบายการลงทุนของกองทุนเพื่อให้บรรลุวัตถุประสงค์การลงทุนที่เกี่ยวข้องกับความยั่งยืนซึ่งจะมี net exposure โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน ในตราสารหนี้กลุ่มความยั่งยืน (Sustainable Bond) ดังนี้

1. พันธบัตรรัฐบาล พันธบัตรที่กระทรวงการคลังค้ำประกันต้นเงินและดอกเบี้ย หรือหุ้นที่กระทรวงการคลังค้ำประกันต้นเงินและดอกเบี้ยแต่ไม่รวมถึงหุ้นที่แปลงสภาพ ซึ่งเป็นพันธบัตรหรือหุ้นที่เออนูรักษ์สิ่งแวดล้อม (green bond) พันธบัตรหรือหุ้นเพื่อความยั่งยืน (sustainability bond) หรือพันธบัตร หรือหุ้นที่ส่งเสริมความยั่งยืน (sustainability - linked bond)
2. ตราสารเพื่อเออนูรักษ์สิ่งแวดล้อม (green bond) ตราสารเพื่อความยั่งยืน (sustainability bond) หรือตราสารส่งเสริมความยั่งยืน (sustainability - linked bond) ที่ออกตามประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุนว่าด้วยการขออนุญาตและการอนุญาตให้เสนอขายตราสารหนี้ที่ออกใหม่ต่อประชาชนเป็นการทั่วไป ประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุนว่าด้วยการขออนุญาตและการอนุญาตให้เสนอขายตราสารหนี้ที่ออกใหม่ต่อบุคคลในวงจำกัด และการเสนอขายหุ้นที่แปลงสภาพต่อบุคคลที่มีลักษณะเฉพาะ หรือประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุนว่าด้วยการขอกำหนดที่เกี่ยวกับการออกและเสนอขายคูปอง และการเปิดเผยข้อมูล แล้วแต่กรณี ซึ่งมีการเปิดเผยข้อมูลในแบบแสดงรายการข้อมูลการเสนอขายตราสารหรือเอกสารที่นำเสนอต่อผู้ลงทุนในการเสนอขายตราสารดังกล่าวในเรื่องดังนี้

1) กรณีเป็นตราสารเพื่อเออนูรักษ์สิ่งแวดล้อมหรือตราสารเพื่อความยั่งยืน ต้องมีการเปิดเผยวัตถุประสงค์การใช้เงินที่ได้จากการระดมทุน (use of proceeds) ว่าเป็นไปเพื่อโครงการที่เกี่ยวข้องกับการเออนูรักษ์สิ่งแวดล้อมหรือเพื่อโครงการที่เกี่ยวข้องกับความยั่งยืนของประเทศไทย แล้วแต่กรณี

2) กรณีเป็นตราสารส่งเสริมความยั่งยืนต้องมีการเปิดเผยข้อมูลเกี่ยวกับการกำหนดตัวชี้วัดและเป้าหมายด้านความยั่งยืนเพื่อส่งเสริมความยั่งยืนของผู้ออกตราสารดังกล่าวในประเทศไทย

เหตุผลในการเลือกใช้ดัชนีชี้วัด

1. ThaiBMA Government Bond ESG Index – Total Return ในสัดส่วนร้อยละ 75

เนื่องจากเป็นดัชนีที่รวมตราสารหนี้หรือพันธบัตรรัฐบาล ESG ของภาครัฐที่ขึ้นทะเบียนกับสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย หรือ ThaiBMA โดยเป็นดัชนีที่สะท้อนการลงทุนของกองทุนที่ลงทุนในตราสารภาครัฐ และ/หรือตราสารหนี้ หรือพันธบัตรรัฐบาลรวมกันไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน อีกทั้งยังเป็นการสะท้อนการลงทุนในทรัพย์สิน และ/หรือตราสารหนี้ในกลุ่ม ESG โดยมี net exposure ในทรัพย์สินดังกล่าวโดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน

2. ThaiBMA Short-Term Government Bond Index – Total Return ในสัดส่วนร้อยละ 5

เนื่องจากเป็นดัชนีที่รวมตราสารหนี้ภาครัฐระยะสั้นที่ขึ้นทะเบียนกับ ThaiBMA ที่มีพันธบัตรรัฐบาลระยะสั้นออกโดยภาครัฐเป็นองค์ประกอบของดัชนี สะท้อนการลงทุนในตราสารภาครัฐ และ/หรือตราสารหนี้ หรือพันธบัตรรัฐบาลรวมกัน ไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน จึงถือเป็นดัชนีที่สะท้อนการลงทุน เพื่อเพิ่มโอกาสในการสร้างผลตอบแทนของกองทุนได้ ตามกรอบนโยบายการลงทุนของกองทุน

3. ThaiBMA Corporate Bond ESG Index – Total Return , Group 1 (1<TTM<= 3)) ในสัดส่วนร้อยละ 5

เนื่องจากเป็นดัชนีที่รวมตราสารหนี้หรือหุ้นกู้กลุ่มยั่งยืนหรือ ESG (ที่มีอายุ 1-3 ปี) ที่ขึ้นทะเบียนกับ ThaiBMA โดยเป็นดัชนีที่สะท้อนการลงทุนในทรัพย์สิน และ/หรือตราสารหนี้ในกลุ่ม ESG โดยมี net exposure ในทรัพย์สินดังกล่าวโดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน

4. อัตราดอกเบี้ยเงินฝากประจำ 1 ปี วงเงินน้อยกว่า 5 ล้านบาท เฉลี่ยของ 3 ธนาคารพาณิชย์ขนาดใหญ่ ได้แก่ ธนาคารกรุงเทพ ธนาคารกสิกรไทย ธนาคารไทยพาณิชย์ หลังหักภาษี ในสัดส่วนร้อยละ 15

เนื่องจากเป็นค่าเฉลี่ยของอัตราดอกเบี้ยเงินฝากประจำระยะเวลา 1 ปี ของธนาคารพาณิชย์ขนาดใหญ่ 3 ธนาคาร จึงถือเป็นดัชนีที่สะท้อนการลงทุนเพื่อเพิ่มโอกาสในการสร้างผลตอบแทนของกองทุนได้ตามกรอบนโยบายการลงทุนของกองทุน

รายละเอียดเพิ่มเติม

หมายเหตุ :

กองทุนใช้ตัวชี้วัดดังกล่าว โดยมีวัตถุประสงค์เพื่อเปรียบเทียบระหว่างดัชนีชี้วัดและผลการดำเนินงานของกองทุนรวม

ผู้ถือหน่วยลงทุนสามารถศึกษาวิธีการจัดทำดัชนี(index methodologies) ได้ที่

<https://www.thaibma.or.th/EN/Market/Index/ESGIndex.aspx>

<https://www.thaibma.or.th/EN/Market/Index/ShortTermIndex.aspx>

<https://www.thaibma.or.th/EN/Market/Index/ESGIndex.aspx>

<https://www.kasikornbank.com/TH/Rate>

<https://www.bangkokbank.com/th-TH/Personal/Other-Services/View-Rates/Deposit-Interest-Rates>

<https://www.scb.co.th/th/personal-banking/rates-fees.html>

คำอธิบาย

Maximum Drawdown : เปรอ์เซ็นต์ผลขาดทุนสูงสุดของกองทุนรวมในระยะเวลา 5 ปี ย้อนหลัง (หรือตั้งแต่จัดตั้งกองทุนกรณีที่ยังไม่ครบ 5 ปี) โดยวัดจากระดับ NAV ต่อหน่วยที่จุดสูงสุดไปจนถึงจุดต่ำสุดในช่วงที่ NAV ต่อหน่วยปรับตัวลดลง ค่า Maximum Drawdown เป็นข้อมูลที่ช่วยให้ทราบถึงความเสี่ยงที่อาจจะขาดทุนจากการลงทุนในกองทุนรวม

Recovering Period : ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาตั้งแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลาสั้นเท่าใด

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน : ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตกองทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลานึง

โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อหลักทรัพย์กับผลรวมของมูลค่าการขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 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 สูงกว่าจะเป็นกองทุนที่มีประสิทธิภาพในการบริหารจัดการการลงทุนที่ดีกว่า เนื่องจากได้รับผลตอบแทนส่วนเพิ่มที่สูงกว่าภายใต้ระดับความเสี่ยงเดียวกัน

Alpha : ผลตอบแทนส่วนเกินของกองทุนรวมเมื่อเปรียบเทียบกับดัชนีชี้วัด (benchmark) โดยค่า Alpha ที่สูง หมายถึง กองทุนสามารถสร้างผลตอบแทนได้สูงกว่าดัชนีชี้วัด ซึ่งเป็นผลจากประสิทธิภาพของผู้จัดการกองทุนในการคัดเลือกหรือหาจังหวะเข้าลงทุนในหลักทรัพย์ได้อย่างเหมาะสม

Beta : ระดับและทิศทางการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุน โดยเปรียบเทียบกับอัตราการเปลี่ยนแปลงของตลาด Beta น้อยกว่า 1 แสดงว่าหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนน้อยกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด Beta มากกว่า 1 แสดงว่าหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนมากกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด

Tracking Error : เพื่อให้พิจารณาความผันผวนของส่วนต่างของผลตอบแทนเฉลี่ยของกองทุนรวมและผลตอบแทนของดัชนีชี้วัด

ซึ่งสะท้อนให้เห็นถึงประสิทธิภาพในการเลียนแบบดัชนีชี้วัดของกองทุนรวมว่ามีการเบี่ยงเบนออกไปจากดัชนีชี้วัด มากน้อยเพียงใด เช่น หากกองทุนรวมมีค่า TE ต่ำ แสดงว่าอัตราผลตอบแทนของกองทุนมีการเบี่ยงเบนออกไปจากดัชนีชี้วัดในอัตราที่ต่ำ ดังนั้น กองทุนรวมนี้จึงมีประสิทธิภาพในการเลียนแบบดัชนีอ้างอิง ในขณะที่กองทุนรวมที่มีค่า TE สูง แสดงว่าอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมมีการเบี่ยงเบนออกจากดัชนีชี้วัดในอัตราที่สูง ดังนั้น โอกาสที่ผลตอบแทนการลงทุนจะเป็นไปตามผลตอบแทนของ benchmark ก็จะมีลดน้อยลง เป็นต้น

Yield to Maturity : อัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในตราสารหนี้โดยถือจนครบกำหนดอายุ

ซึ่งคำนวณจากดอกเบี้ยที่จะได้รับในอนาคตตลอดอายุตราสารและเงินต้นที่จะได้รับคืนนำมาคิดลดเป็นมูลค่าปัจจุบัน โดยใช้วัดอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมตราสารหนี้ คำนวณจากค่าเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักของ Yield to Maturity ของตราสารหนี้แต่ละตัวที่กองทุนมีการลงทุน และเนื่องจาก Yield to Maturity มีหน่วยมาตรฐานเป็นเปอร์เซ็นต์ต่อปี จึงสามารถนำไปใช้เปรียบเทียบอัตราผลตอบแทนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีนโยบายถือครองตราสารหนี้จนครบกำหนดอายุและมีลักษณะการลงทุนที่ใกล้เคียงกันได้

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ยูโอบี (ประเทศไทย) จำกัด
ชั้น 23A, 25 อาคารเอเชียเซ็นเตอร์ เลขที่ 173/27-30, 31-33
ถนนสาทรใต้ แขวงทุ่งมหาเมฆ เขตสาทร กรุงเทพมหานคร 10120
โทรศัพท์ : 0-2786-2000

www.uobam.co.th