



กองทุนเปิดพรินซิเพิล ซีเล็คต์ หุ้นปันผลไทยเพื่อความยั่งยืนแบบพิเศษ

Principal Selected Dividend Equity Thailand ESG Extra Fund ชนิดเงินลงทุนเดิม PRINCIPAL SEQTESGX-O

ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

ประเภทกองทุน : กองทุนรวมตราสารแห่งทุน, กองทุนรวมเพื่อความยั่งยืน (SRI Fund),
กองทุนรวมไทยเพื่อความยั่งยืนแบบพิเศษ (Thailand ESG Extra Fund),
กองทุนที่เน้นลงทุนแบบมีความเสี่ยงทั้งในและต่างประเทศ
กลุ่มกองทุนรวม : กลุ่ม Equity General

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- กองทุนจะลงทุนในหรือมีไว้ในตราสารทุนหรือหุ้นสามัญของบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET) บนกระดานหลัก หรือกระดาน เอ็มเอไอ (mai) ที่ได้รับการคัดเลือกจาก SET หรือองค์กรหรือสถาบันอื่นที่สำนักงาน ก.ล.ด. ยอมรับว่ามีความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน (Environmental Social and Governance: ESG) และ/หรือหุ้นที่เป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนใน SET บนกระดานหลัก หรือกระดานเอ็มเอไอ (mai) ที่มีการเปิดเผยข้อมูลเกี่ยวกับการปล่อยก๊าซเรือนกระจก แผนการจัดการ และการตั้งเป้าหมายเพื่อให้บรรลุเป้าหมายในการลดปริมาณการปล่อยก๊าซเรือนกระจกของประเทศ ไทย รวมทั้งจัดให้มีการทวนสอบการจัดทำคาร์บอนฟุตพริ้นท์โดยผู้ทวนสอบที่สำนักงาน ก.ล.ด. ยอมรับ โดยหุ้นดังกล่าวจะต้องมีนโยบายหรือมีประวัติการจ่ายเงินปันผลสม่ำเสมอ โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน
- กองทุนอาจลงทุนในต่างประเทศโดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่เกินกว่าร้อยละ 20 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน
- กองทุนอาจลงทุนในตราสารที่มีสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Structured Notes) และอาจลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) เพื่อเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน (Efficient Portfolio Management) และเพื่อป้องกันความเสี่ยง (Hedging) โดยขึ้นอยู่กับดุลยพินิจของผู้จัดการกองทุน
- กลยุทธ์ในการบริหารจัดการลงทุน
กองทุนมุ่งเน้นบริหารกองทุนเชิงรุก (Active Management) โดยเน้นการบริหารจัดการให้ได้รับอัตราผลตอบแทนสูงกว่าเกณฑ์มาตรฐาน (Benchmark) โดยบริษัทมีแนวทางให้การสร้างผลตอบแทนดังกล่าวโดยเน้นการทวนวิเคราะห์หลักทรัพย์รายตัว (Bottom Up Approach)ควบคู่ไปกับการวิเคราะห์ภาพตลาด (Top Down Approach) ผ่านกระบวนการที่เรียกว่า FMV Model (Fundamental, Momentum, Valuation) และ กรอบการผนวกปัจจัยด้าน ESG (ESG Integration Framework)
(ศึกษารายละเอียดเพิ่มเติมในหนังสือชี้ชวนส่วนข้อมูลกองทุนรวม)

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (%ต่อปี)

ยังไม่มีข้อมูลผลการดำเนินงานย้อนหลัง

ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด (%ต่อปี)

ยังไม่มีข้อมูลผลการดำเนินงานย้อนหลัง

ระดับความเสี่ยง



ลงทุนในตราสารทุนเป็นหลักโดยเฉลี่ย ในรอบปีไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV

ข้อมูลกองทุน

วันจดทะเบียนกองทุน	วันที่ 9 พฤษภาคม 2568
วันเริ่มต้น class	วันที่ 13 พฤษภาคม 2568
นโยบายการจ่ายเงินปันผล	จ่าย
อายุกองทุน	ไม่กำหนด
ผู้จัดการกองทุน	
คุณชาติรี มีชัยเจริญยิ่ง	วันที่จดทะเบียนกองทุน
คุณปฐมพงษ์ เรืองคณารักษ์	วันที่จดทะเบียนกองทุน

ดัชนีชี้วัด

SET High Dividend 30 Total Return Index สัดส่วน 100%

คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวมไม่ได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต : ได้รับการรับรอง CAC

จัดอันดับกองทุน Morningstar

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเรื่องมี
บริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่องได้
ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

www.principal.th

การซื้อขายหน่วยลงทุน*

วันทำการซื้อ : ช่วง IPO ไม่มี,
หลัง IPO ระหว่างวันที่ 13 พฤษภาคม – 30 มิถุนายน 2568 เปิดรับคำสั่งสับเปลี่ยนหน่วยลงทุน
ล่วงหน้าจากกองทุน LTF ภายใต้การบริหารของบริษัทจัดการเท่านั้น*
เวลาทำการ : ตั้งแต่เวลาเริ่มทำการถึงเวลา 15.30 น.
การซื้อขายครั้งแรกขั้นต่ำ : ไม่กำหนด
การซื้อขายครั้งถัดไปขั้นต่ำ : ไม่กำหนด
หมายเหตุ : *รายละเอียดเป็นไปตามตารางการสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนที่บริษัทจัดการกำหนด ทั้งนี้
หากมีการเปลี่ยนแปลงบริษัทจัดการจะแจ้งให้ทราบล่วงหน้าผ่านเว็บไซต์บริษัทจัดการ หรือปรับปรุง
ในหนังสือชี้ชวนส่วนสรุปข้อมูลสำคัญ

การขายคืนหน่วยลงทุน*

วันทำการขายคืน : ทุกวันทำการ*
เวลาทำการ : ตั้งแต่เวลาเริ่มทำการถึงเวลา 15.00 น.
การขายคืนขั้นต่ำ : ไม่กำหนด
ยอดคงเหลือขั้นต่ำ : ไม่กำหนด
ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน :
ประกาศ NAV T+1, คืนเงิน T+3 คือ 3 วันทำการหลังจากวันทำรายการขายคืน
หมายเหตุ : *ระหว่างวันที่ 2 พฤษภาคม – 16 พฤษภาคม 2568 ไม่เปิดให้ผู้ลงทุนส่งคำสั่งขายคืน
และตั้งแต่วันที่ 19 พฤษภาคม 2568 เป็นต้นไป ผู้ลงทุนสามารถส่งคำสั่งขายคืนทุกวันทำการ
ทั้งนี้ หากมีการเปลี่ยนแปลงบริษัทจัดการจะแจ้งให้ทราบล่วงหน้าผ่านเว็บไซต์บริษัทจัดการ หรือ
ปรับปรุงในหนังสือชี้ชวนส่วนสรุปข้อมูลสำคัญ

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การขาย	2.14%	ยกเว้น
การรับซื้อคืน	1.07%	ยกเว้น
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า	2.14%	ยกเว้น
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก	1.07%	ยกเว้น
การโอนหน่วย	ตามที่นายทะเบียนเรียกเก็บ	จ่ายตามจริง

หมายเหตุ : ค่าธรรมเนียมเป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะ หรือภาษีอื่นใดใน
ทำนองเดียวกันไว้แล้ว
บริษัทจัดการขอสงวนสิทธิในการเรียกเก็บค่าธรรมเนียมการขายหน่วยลงทุน/ การรับซื้อคืนหน่วย
ลงทุน/ การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนกับผู้ลงทุนแต่ละกลุ่มไม่เท่ากัน ตามประเภทของผู้ลงทุน ตาม
มูลค่าการซื้อขายหน่วยลงทุน ตามระยะเวลาการถือครองหน่วยลงทุน ตามช่องทางการซื้อขายหน่วย
ลงทุน หรือตามเงื่อนไขที่บริษัทจัดการอาจกำหนดขึ้นในอนาคต โดยจะประกาศให้ผู้ลงทุนทราบ
ล่วงหน้าไม่น้อยกว่า 7 วันก่อนมีการเปลี่ยนแปลงผ่านช่องทางที่บริษัทจัดการกำหนด

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน

การกระจายการลงทุน	% ของ NAV
หุ้นสามัญ	80 - 100
Cash and Other	0 -20

ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก

ชื่อทรัพย์สิน	% ของ NAV
ยังไม่มีข้อมูล	

ข้อมูลเชิงสถิติ

Maximum Drawdown :	N/A
Recovering Period :	N/A
FX Hedging :	N/A
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน :	N/A
Sharpe Ratio :	N/A
Alpha :	N/A
Beta :	N/A
Tracking Error :	N/A
อายุเฉลี่ยของตราสารหนี้ :	N/A
Yield to Maturity :	N/A

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปี ของ NAV)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	2.14%	1.8725%*
รวมค่าใช้จ่าย	6.22%	ไม่เกินอัตราสูงสุด

หมายเหตุ : ค่าธรรมเนียมเป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะ หรือภาษี
อื่นใดในทำนองเดียวกันไว้แล้ว
บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้อง
กับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ

*โปรดศึกษารายละเอียดเพิ่มเติมในหนังสือชี้ชวนส่วนข้อมูลกองทุนรวม

การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม 5 อันดับแรก

หลักทรัพย์แยกตามกลุ่มอุตสาหกรรม	% ของ NAV
ยังไม่มีข้อมูล	

รายละเอียดตามตารางการสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนจากกองทุนรวมหุ้นระยะยาว (LTF) ดังนี้

วันส่งคำสั่งสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนล่วงหน้าจากกอง LTF (กองทุนต้นทาง)	วันทำการรายการซื้อหน่วยลงทุน (กองทุนปลายทาง)
13 – 16 พฤษภาคม 2568	16 พฤษภาคม 2568
19 – 23 พฤษภาคม 2568	23 พฤษภาคม 2568
26 – 30 พฤษภาคม 2568	30 พฤษภาคม 2568
4 – 6 มิถุนายน 2568	6 มิถุนายน 2568
9 - 13 มิถุนายน 2568	13 มิถุนายน 2568
16 - 20 มิถุนายน 2568	20 มิถุนายน 2568
23 - 30 มิถุนายน 2568	30 มิถุนายน 2568

บริษัทจัดการของสวสลิทริบ์คำสั่งสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนจากกองทุนรวมหุ้นระยะยาว (LTF) ภายใต้การบริหารของบริษัทจัดการเท่านั้น
ผู้ลงทุนสามารถสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนจากกองทุนรวมหุ้นระยะยาว (LTF) (“กองทุนต้นทาง”) เพื่อซื้อหน่วยลงทุนกองทุนรวมไทยเพื่อความยั่งยืนแบบพิเศษ (Thai ESGX) (“กองทุนปลายทาง”) ได้ในช่วงระหว่างวันที่ 13 พฤษภาคม ถึงวันที่ 30 มิถุนายน 2568 เท่านั้น
กรณีผู้ลงทุนประสงค์จะยกเลิกคำสั่งสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนจากกองทุนรวมหุ้นระยะยาว (LTF) (“กองทุนต้นทาง”) เพื่อซื้อหน่วยลงทุนกองทุนรวมไทยเพื่อความยั่งยืนแบบพิเศษ (Thai ESGX) (“กองทุนปลายทาง”) ที่ได้ส่งคำสั่งไว้แล้ว ผู้ลงทุนต้องยกเลิกคำสั่งสับเปลี่ยนดังกล่าวก่อนวันที่บริษัทจัดการจะดำเนินการส่งซื้อหน่วยลงทุนให้ผู้ลงทุนในแต่ละสัปดาห์หรือตามที่บริษัทจัดการกำหนดเท่านั้น

ข้อมูลเกี่ยวกับกองทุนรวมเพื่อความยั่งยืน (SRI Fund)

วัตถุประสงค์การลงทุนที่เกี่ยวกับความยั่งยืน

กองทุนมีนโยบายลงทุนในหุ้นที่เป็นหลักทรัพ์จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (“SET”) บนกระดานหลัก หรือกระดาน เอ็มเอไอ (mai) ที่ได้รับการคัดเลือกจาก SET ว่ามีความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน (Environmental Social and Governance: ESG) และ/หรือหุ้นที่เป็นหลักทรัพ์จดทะเบียนใน SET บนกระดานหลัก หรือกระดาน เอ็มเอไอ (mai) ที่มีการเปิดเผยข้อมูลเกี่ยวกับการปล่อยก๊าซเรือนกระจก แผนการจัดการ และการตั้งเป้าหมายเพื่อให้บรรลุเป้าหมายในการลดปริมาณการปล่อยก๊าซเรือนกระจกของประเทศไทย รวมทั้งจัดให้มีการทวนสอบการจัดทำคาร์บอนฟุตพริ้นท์โดยผู้ทวนสอบที่ สำนักงาน ก.ล.ด. ยอมรับ และ/หรือ หุ้นของ บจ.ที่มีการยกระดับด้าน Governance ที่มีลักษณะ “รายละเอียดเพิ่มเติมเกี่ยวกับนโยบายเพิ่มเติมเกี่ยวกับนโยบายการลงทุนและลักษณะพิเศษ” ข้อ (3) โดยมี net exposure ในทรัพย์สินที่ลงทุนดังกล่าว โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน ซึ่งจะช่วยสนับสนุนการพัฒนาเศรษฐกิจและสังคมไทยอย่างยั่งยืนตามเป้าหมายการพัฒนาที่ยั่งยืน Sustainable Development Goals (SDGs) ขององค์การสหประชาชาติ

เป้าหมายที่กองทุนรวมต้องการบรรลุ

กองทุนจะลงทุนตามกรอบนโยบายการลงทุน โดยเป็นแรงขับเคลื่อนกิจการไทยให้มีการดำเนินธุรกิจอย่างยั่งยืน เพื่อสนับสนุนเป้าหมายด้านความยั่งยืนตามหลักสากลตามที่กำหนด และมีส่วนช่วยผลักดันตลาดทุนและประเทศไทยสู่การเติบโตอย่างยั่งยืน

กรอบการลงทุน (Investment Universe)

- หุ้นของบริษัทที่ได้รับการคัดเลือกว่ามีความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน (Environmental Social and Governance: ESG) จากองค์กรหรือสถาบันที่มีความน่าเชื่อถือ เช่น ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย หรือองค์กรหรือสถาบันอื่นที่สำนักงาน ก.ล.ด. ยอมรับว่ามีความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน (Environmental Social and Governance: ESG) และ/หรือ หุ้นของ บจ.ที่มีการยกระดับด้าน Governance ที่มีลักษณะ “รายละเอียดเพิ่มเติมเกี่ยวกับนโยบายเพิ่มเติมเกี่ยวกับนโยบายการลงทุนและลักษณะพิเศษ” ข้อ (3) รวมถึงหุ้นของบริษัทที่มีเป้าหมายในการลดปริมาณการปล่อยก๊าซเรือนกระจก โดยคำนึงถึงระดับการยอมรับหรือมาตรฐานที่เป็นที่ยอมรับ ซึ่งผู้จัดการกองทุนจะมีการประเมิน Internal ESG Score ควบคู่ไปด้วย โดยมี net exposure ในทรัพย์สินที่ลงทุนดังกล่าวโดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน
- ส่วนที่เหลือจากการลงทุนข้างต้น กองทุนจะลงทุนในหุ้นที่ผ่านการประเมิน Internal ESG Score รวมทั้งทรัพย์สินอื่นๆ ตามที่ได้กำหนดในนโยบายการลงทุน

ตัวชี้วัดผลการดำเนินงานของกองทุน

- ดัชนีชี้วัด (Benchmark) ของกองทุน คือ ดัชนี SET High Dividend 30 Total Return Index (SETHD) ในสัดส่วนร้อยละ 100 โดยดัชนี SETHD มีหลักเกณฑ์การคัดเลือกหุ้นเป็นองค์ประกอบของดัชนี ดังนี้
- เป็นดัชนีที่สะท้อนความเคลื่อนไหวราคาของกลุ่มหลักทรัพ์ที่มีมูลค่าตามราคาตลาดสูง (Market Capitalization) มีสภาพคล่องสูงอย่างสม่ำเสมอ และมีอัตราผลตอบแทนจากเงินปันผลสูงและต่อเนื่อง
 - คัดเลือกจากหลักทรัพ์ที่เป็นองค์ประกอบของดัชนี SET100 ในรอบทบทวนเดียวกัน
 - มีการจ่ายปันผลต่อเนื่อง 3 ปี และมี Dividend payout ratio ไม่เกินร้อยละ 100
 - เป็นหลักทรัพ์ที่มีอัตราการจ่ายเงินปันผลสูงสุดจำนวน 30 หลักทรัพ์ คัดเลือกตามเกณฑ์ buffer rule
 - ไม่รวมหลักทรัพ์ที่ถูกขึ้นเครื่องหมาย SP

- คำนวณแบบถ่วงน้ำหนักด้วยมูลค่าหลักทรัพย์ตามราคาตลาด (Market Capitalization Weight) และอัตราผลตอบแทนจากเงินปันผล (Dividend Yield) มารวมถ่วงน้ำหนักในการคำนวณด้วย โดยจะกำหนดอัตราผลตอบแทนจากเงินปันผลสูงสุดที่ใช้ในการคำนวณที่ร้อยละ 15 ของแต่ละหลักทรัพย์
- จำกัดน้ำหนักของแต่ละหลักทรัพย์ที่เป็นองค์ประกอบในดัชนีไม่เกินร้อยละ 10 ทุกไตรมาส

ข้อมูลจาก: <https://www.set.or.th/th/market/index/sethd/profile>

ทั้งนี้ บริษัทจัดการจะเปลี่ยนแปลง Benchmark ของกองทุนข้างต้น ที่จัดทำโดยตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เมื่อตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยมีการจัดทำดัชนี TRI ที่นำสัดส่วนผู้ถือหลักทรัพย์รายย่อยของแต่ละหลักทรัพย์ (free float) มาถ่วงน้ำหนักในการคำนวณดัชนี (ดัชนี free float TRI) เพื่อให้เป็นไปตามหลักเกณฑ์ที่คณะกรรมการกำกับตลาดทุนประกาศกำหนด

อย่างไรก็ตาม บริษัทจัดการมิได้ใช้ ดัชนี SET ESG TRI หรือดัชนีที่เกี่ยวข้องกับความยั่งยืนอื่น เนื่องจากอาจมีบริษัทที่มีได้เป็นองค์ประกอบของดัชนีดังกล่าว แต่มีคุณสมบัติเป็นไปตามกรอบนโยบายที่กองทุนกำหนดในการจ่ายเงินปันผล

คำอธิบาย

Maximum Drawdown เพอร์เซ็นต์ผลขาดทุนสูงสุดของกองทุนรวมในระยะเวลา 5 ปีย้อนหลัง (หรือตั้งแต่จัดตั้งกองทุนกรณีที่ยังไม่ครบ 5 ปี) โดยวัดจากระดับ NAV ต่อหน่วยที่จุดสูงสุดไปจนถึงจุดต่ำสุดในช่วงที่ NAV ต่อหน่วยปรับตัวลดลง ค่า Maximum Drawdown เป็นข้อมูลที่ช่วยให้ทราบถึงความเสี่ยงที่อาจจะขาดทุนจากการลงทุนในกองทุนรวม

Recovering Period ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาดังแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลานานเท่าใด

FX Hedging เพอร์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตกองทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลานึง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์กับผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 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 ซึ่งเป็นผลจากประสิทธิภาพของผู้จัดการกองทุนในการคัดเลือกหรือหาจังหวะเข้าลงทุนในหลักทรัพย์ได้อย่างเหมาะสม

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

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

Yield to Maturity อัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในตราสารหนี้โดยถือจนครบกำหนดอายุ ซึ่งคำนวณจากดอกเบี้ยที่จะได้รับในอนาคตตลอดอายุตราสารและเงินต้นที่จะได้รับคืน นำมาคิดลดเป็นมูลค่าปัจจุบันโดยใช้วัดอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมตราสารหนี้ คำนวณจากค่าเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักของ Yield to Maturity ของตราสารหนี้แต่ละตัวที่กองทุนมีการลงทุน และเนื่องจาก Yield to Maturity มีหน่วยมาตรฐานเป็นเพอร์เซ็นต์ต่อปี จึงสามารถนำไปใช้เปรียบเทียบอัตราผลตอบแทนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีนโยบายถือครองตราสารหนี้จนครบกำหนดอายุและมีลักษณะการลงทุนที่ใกล้เคียงกันได้

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน พรินซิเพิล จำกัด

44 อาคาร ซีไอเอมบี ไทย ชั้น 16 ถนนหลังสวน แขวง ลุมพินี เขตปทุมวัน กรุงเทพฯ 10330 โทร 0-2686-9500 เว็บไซต์: www.principal.th