



นโยบายการลงทุน

พอร์ตการลงทุน **Global Market Allocation** เน้นลงทุนในตราสารทุนในภูมิภาคต่างๆ ทั่วโลกได้แก่ เกาหลีใต้ อินเดีย อเมริกา ยุโรป ญี่ปุ่น และประเทศจีน โดยจะกระจายลงทุนในสัดส่วนที่ก่อให้เกิดผลตอบแทนและความเสี่ยง ที่คุ้มค่ากับการลงทุนมากที่สุด

พอร์ตการลงทุนนี้เหมาะกับนักลงทุนประเภทใด

พอร์ตการลงทุนนี้เหมาะกับลูกค้าที่ต้องการกระจายความเสี่ยงจากการลงทุนในหุ้นไทย ไปยังต่างประเทศ และสามารถรับความเสี่ยงจากการลงทุนในหุ้นได้

ผลทดสอบผลการดำเนินงาน

จากการทดสอบผลการดำเนินงานย้อนหลัง พอร์ตการลงทุนแบบ **Global Market Allocation** ให้ผลตอบแทนเฉลี่ยใกล้เคียงกับการลงทุนใน **SET Index** แต่มีความเสี่ยงน้อยกว่า ทำให้เกิดความคุ้มค่าในการลงทุนมากกว่า

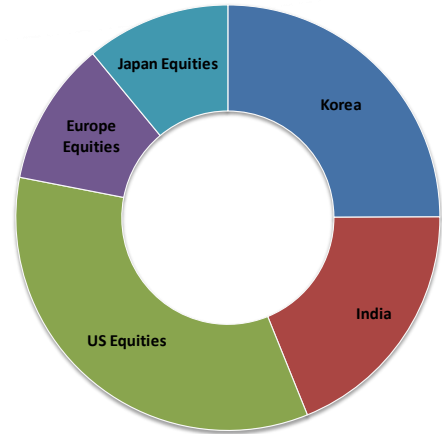
ผลการดำเนินงาน ณ วันที่ 26 พฤศจิกายน 2558

Statistic	Global Market Allocation			
	3 Month	6 Month	1 Year	2 Years
Portfolio's Return	3.15%	-0.37%	11.01%	34.45%
SET's Return	0.25%	-8.71%	-13.63%	-2.79%
Portfolio's Volatility	4.93%	6.68%	8.48%	7.95%
SET's Volatility	5.59%	10.16%	13.75%	13.18%
Portfolio's Sharpe Ratio	1.0106	-0.3612	0.9842	1.6713
SET's Sharpe Ratio	-0.2321	-1.4625	-1.2532	-0.3085

Note

Standard Deviation (%): วัดความผันผวนของราคา (แสดงค่าแบบ Annualized)

Sharpe Ratio: เปรียบเทียบผลตอบแทนเมื่อนำความเสี่ยงมาพิจารณา (แสดงค่าแบบ Annualized)

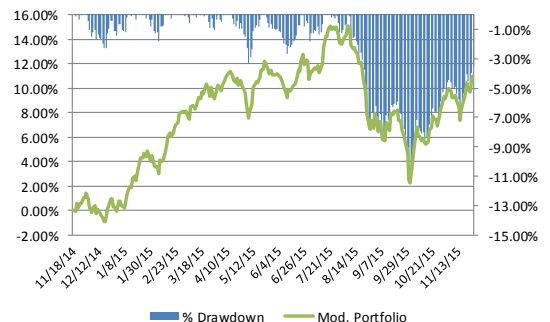


Global Market vs. SET Index (1Y)



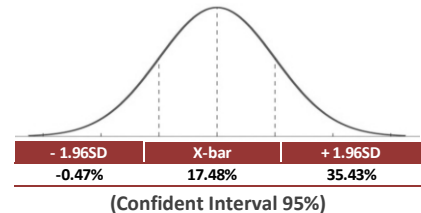
(แสดงการเปลี่ยนแปลงของพอร์ตเทียบกับ SET Index)

Portfolio Drawdown (1Y)



(%Drawdown แสดงการลดลงของเงินทุนที่ลดลงมากที่สุดของพอร์ตในช่วงที่ลงทุนอยู่)

Normal Distribution 1Y



“การลงทุนมีความเสี่ยง ผู้ลงทุนควรศึกษาข้อมูลในหนังสือชี้ชวนก่อนการตัดสินใจลงทุน”

ผู้ลงทุนควรลงทุนเมื่อมีความเข้าใจในความเสี่ยงของกองทุน และผู้ลงทุนควรพิจารณาความเหมาะสมของการลงทุน โดยคำนึงถึงประสบการณ์การลงทุน และฐานะการเงินของผู้ลงทุนเอง เอกสารฉบับนี้จัดทำขึ้นโดยมีวัตถุประสงค์เพื่อให้ความรู้เท่านั้น ไม่ได้เป็นการแนะนำแบบเจาะจง นักลงทุนควรศึกษาข้อมูลในหนังสือชี้ชวนก่อนการตัดสินใจลงทุน

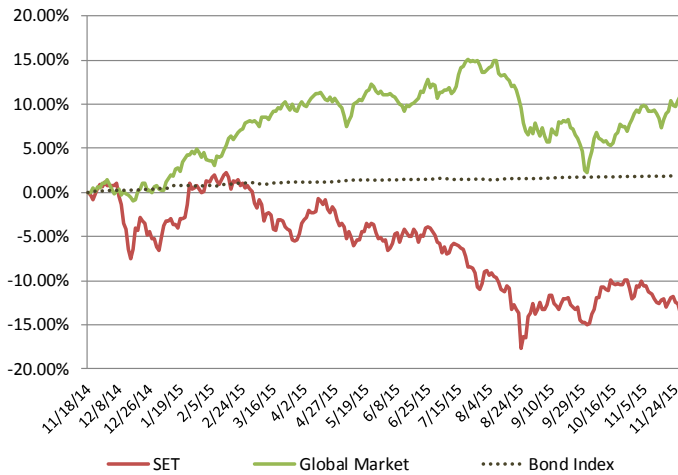
Fixed Income & Unit Trust Trading Division

เสริมศักดิ์ วงศ์สิทธิโชค และทีมงาน

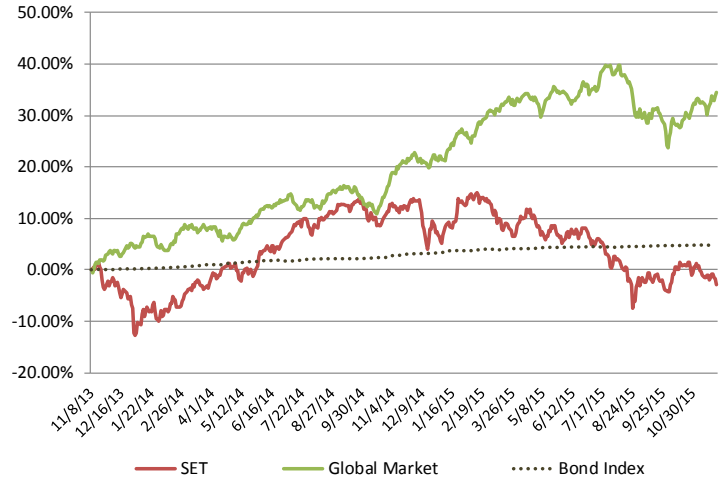
โทร 02-618-1018, 1019, 1116



Global Market Allocation vs. SET Index (1Y)



Global Market Allocation vs. SET Index (2Y)



Statistic Record

Average Return	3 Months	6 Months	1 Year	2 Years
Global Market	3.28%	7.28%	17.48%	41.52%
SET Index	2.09%	4.42%	11.22%	22.35%

Volatility	3 Months	6 Months	1 Year	2 Years
Global Market	9.88%	10.17%	9.16%	10.12%
SET Index	16.13%	16.83%	15.39%	13.31%

Highest Return	3 Months	6 Months	1 Year	2 Years
Global Market	13.98%	22.70%	30.45%	61.02%
SET Index	21.17%	41.57%	52.52%	72.18%

BETA	3 Months	6 Months	1 Year	2 Years
Global Market	0.1841	0.0871	-0.1025	-0.4422
SET Index	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000

CAGR	1 Year	2 Years
Global Market	17.48%	18.96%
SET Index	11.22%	10.61%

Max Drawdown %	3 Months	6 Months	1 Year	2 Years
Global Market	-13.86%	-13.86%	-7.48%	-5.31%
SET Index	-25.23%	-25.23%	-25.48%	-25.48%

Lowest Return	3 Months	6 Months	1 Year	2 Years
Global Market	-13.37%	-11.48%	-6.59%	10.29%
SET Index	-21.02%	-19.48%	-15.62%	-9.19%

Sharpe Ratio	3 Months	6 Months	1 Year	2 Years
Global Market	1.2393	1.4117	1.7229	2.7596
SET Index	0.2850	0.3131	0.4466	0.6145

Note
Volatility และ Sharpe Ratio แสดงค่าแบบ Annualized

“การลงทุนมีความเสี่ยง ผู้ลงทุนควรศึกษาข้อมูลในหนังสือชี้ชวนก่อนการตัดสินใจลงทุน”

ผู้ลงทุนควรลงทุนเมื่อมีความเข้าใจในความเสี่ยงของกองทุน และผู้ลงทุนควรพิจารณาความเหมาะสมของการลงทุน โดยคำนึงถึงประสบการณ์การลงทุน และฐานะการเงินของผู้ลงทุนเอง เอกสารฉบับนี้จัดทำขึ้นโดยมีวัตถุประสงค์เพื่อให้ความรู้เท่านั้น ไม่ได้เป็นการแนะนำแบบเจาะจง นักลงทุนควรศึกษาข้อมูลในหนังสือชี้ชวนก่อนการตัดสินใจลงทุน

Fixed Income & Unit Trust Trading Division

เสริมศักดิ์ วงศ์สิทธิโชค และทีมงาน

โทร 02-618-1018, 1019, 1116