



นโยบายการลงทุน

พอร์ตการลงทุน **Super Sectors Allocation** เน้นลงทุนในตราสารทุนในภูมิภาคต่างๆ ทั่วโลก โดยเน้นลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรมที่มีศักยภาพในการเติบโตสูง ได้แก่ สาธารณูปโภค(น้ำ) **Healthcare** สถาบันการเงิน และตราสารทุนในกลุ่มประเทศที่พัฒนาแล้ว (**Develop Market**) ผ่านการกระจายลงทุนในสัดส่วนที่ก่อให้เกิดผลตอบแทนและความเสี่ยง ที่คุ้มค่ากับการลงทุนมากที่สุด

พอร์ตการลงทุนนี้เหมาะกับนักลงทุนประเภทใด

พอร์ตการลงทุนนี้เหมาะกับนักลงทุนที่ต้องการกระจายความเสี่ยงจากการลงทุนในหุ้นไทย ไปยังต่างประเทศ และสามารถรับความเสี่ยงจากการลงทุนได้สูง โดยคาดหวังผลตอบแทนในระยะยาว

ผลทดสอบผลการดำเนินงาน

จากการทดสอบผลการดำเนินงานย้อนหลัง พอร์ตการลงทุนแบบ **Super Sectors Allocation** ให้ผลตอบแทนเฉลี่ยสูงกว่า **MSCI World Index (THB)** ในขณะที่มีความผันผวนน้อยกว่ามาก ทำให้เกิดความคุ้มค่าในการลงทุนมากกว่า

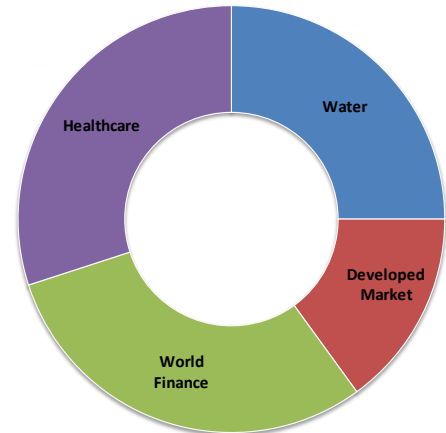
ผลการดำเนินงาน ณ วันที่ 24 พฤศจิกายน 2558

Statistic	Super Sectors Portfolio			
	3 Month	6 Month	1 Year	2 Years
Portfolio's Return	2.26%	2.10%	16.50%	34.99%
MSCI World's Return	1.03%	0.04%	8.21%	22.98%
Portfolio's Volatility	5.03%	6.72%	8.68%	7.91%
MSCI World's Volatility	9.51%	14.71%	18.59%	15.74%
Portfolio's Sharpe Ratio	0.9000	0.4415	1.9007	2.0458
MSCI World's Sharpe Ratio	0.2163	0.0034	0.4416	0.6925

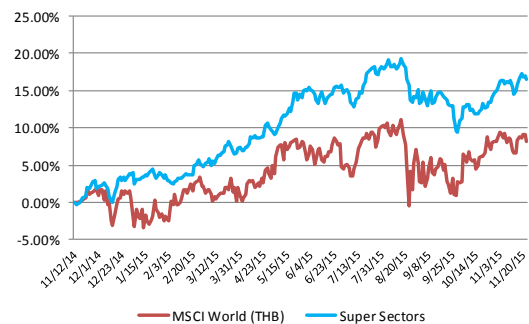
Note

Standard Deviation (%): วัดความผันผวนของราคา (แสดงค่าแบบ Annualized)

Sharpe Ratio: เปรียบเทียบผลตอบแทนเมื่อความเสี่ยงมาพิจารณาพร้อม (แสดงค่าแบบ Annualized)

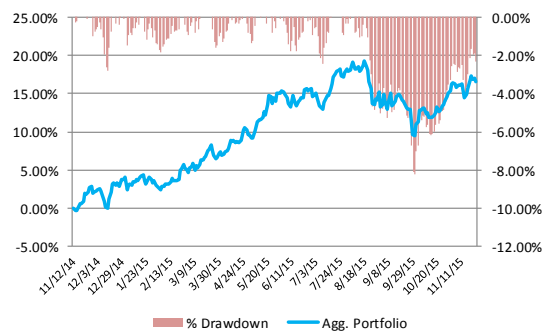


Super Sectors vs. MSCI World Index (THB) (1Y)



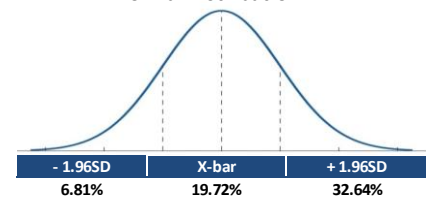
(แสดงการเปลี่ยนแปลงของพอร์ตเทียบกับ SET Index)

Portfolio Drawdown (1Y)



(%Drawdown แสดงการลดลงของเงินทุนที่ลดลงมากที่สุดของพอร์ตในระหว่างที่ลงทุนอยู่)

Normal Distribution 1Y



(Confident Interval 95%)

“การลงทุนมีความเสี่ยง ผู้ลงทุนควรศึกษาข้อมูลในหนังสือชี้ชวนก่อนการตัดสินใจลงทุน”

ผู้ลงทุนควรลงทุนเมื่อมีความเข้าใจในความเสี่ยงของกองทุน และผู้ลงทุนควรพิจารณาความเหมาะสมของการลงทุน โดยคำนึงถึงประสบการณ์การลงทุน และฐานะการเงินของผู้ลงทุนเอง เอกสารฉบับนี้จัดทำขึ้นโดยมีวัตถุประสงค์เพื่อให้ความรู้เท่านั้น ไม่ได้เป็นการแนะนำแบบเจาะจง นักลงทุนควรศึกษาข้อมูลในหนังสือชี้ชวนก่อนการตัดสินใจลงทุน

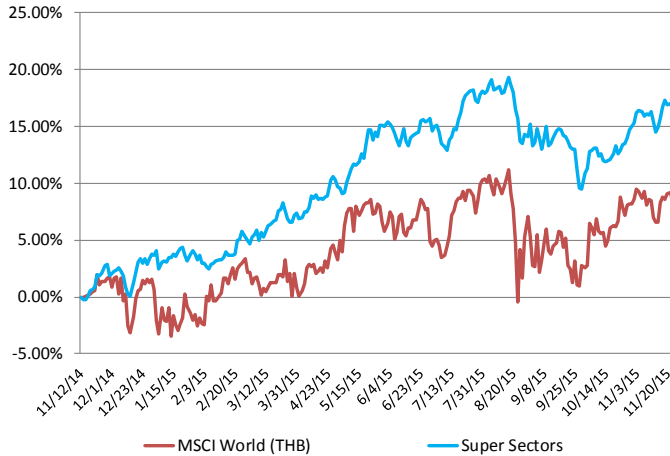
Fixed Income & Unit Trust Trading Division

เสริมศักดิ์ วงศ์สิทธิโชค และทีมงาน

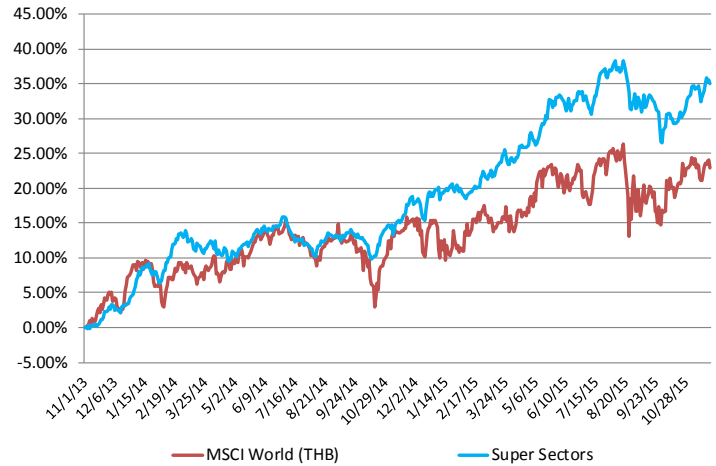
โทร 02-618-1018, 1019, 1116



Super Sectors vs. MSCI World Index (THB) (1Y)



Super Sectors vs. MSCI World Index (THB) (2Y)



Statistic Record

Average Return	3 Months	6 Months	1 Year	2 Years
Super Sectors Portfolio	4.38%	9.65%	19.72%	41.58%
MSCI World (THB)	3.27%	6.84%	14.44%	31.51%

Volatility	3 Months	6 Months	1 Year	2 Years
Super Sectors Portfolio	7.13%	6.91%	6.59%	4.36%
MSCI World (THB)	8.31%	7.34%	8.05%	5.76%

Highest Return	3 Months	6 Months	1 Year	2 Years
Super Sectors Portfolio	15.37%	21.16%	35.27%	52.67%
MSCI World (THB)	15.16%	22.77%	32.46%	48.70%

BETA	3 Months	6 Months	1 Year	2 Years
Super Sectors Portfolio	0.3526	0.6603	0.6988	0.6216
MSCI World (THB)	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000

Note

Volatility และ Sharpe Ratio แสดงค่าแบบ Annualized

CAGR	1 Year	2 Years
Super Sectors Portfolio	19.72%	18.99%
MSCI World (THB)	14.44%	14.68%

Max Drawdown %	3 Months	6 Months	1 Year	2 Years
Super Sectors Portfolio	-9.23%	-9.23%	-9.23%	-9.23%
MSCI World (THB)	-10.47%	-10.96%	-10.96%	-10.96%

Lowest Return	3 Months	6 Months	1 Year	2 Years
Super Sectors Portfolio	-5.61%	-1.45%	6.33%	23.56%
MSCI World (THB)	-8.97%	-4.26%	0.35%	9.20%

Sharpe Ratio	3 Months	6 Months	1 Year	2 Years
Super Sectors Portfolio	1.7872	1.9687	1.9716	2.7761
MSCI World (THB)	0.9026	0.9442	0.9773	1.4744

“การลงทุนมีความเสี่ยง ผู้ลงทุนควรศึกษาข้อมูลในหนังสือชี้ชวนก่อนการตัดสินใจลงทุน”

ผู้ลงทุนควรลงทุนเมื่อมีความเข้าใจในความเสี่ยงของกองทุน และผู้ลงทุนควรพิจารณาความเหมาะสมของการลงทุน โดยคำนึงถึงประสบการณ์การลงทุน และฐานะการเงินของผู้ลงทุนเอง เอกสารฉบับนี้จัดทำขึ้นโดยมีวัตถุประสงค์เพื่อให้ความรู้เท่านั้น ไม่ได้เป็นการแนะนำแบบเจาะจง นักลงทุนควรศึกษาข้อมูลในหนังสือชี้ชวนก่อนการตัดสินใจลงทุน

Fixed Income & Unit Trust Trading Division

เสริมศักดิ์ วงศ์สิทธิโชค และทีมงาน

โทร 02-618-1018, 1019, 1116