

3.4 อัตราผลตอบแทนและความเสี่ยง (เปรียบเทียบ sharpe ratio ของผลตอบแทน vs sharpe ratio benchmark)

ข้อมูล ณ 30 มิถุนายน 2567

กองทุนสำรองเลี้ยงชีพ พรินซิเพิล สมดุลตามอายุ ซึ่งจดทะเบียนแล้ว

ข้อมูล ณ 30 มิถุนายน 2567		กองทุนสำรองเลี้ยงชีพ พรินซิเพิล สมดุลตามอายุ ซึ่งจดทะเบียนแล้ว																					YTD					
กองทุนสำรองเลี้ยงชีพ พรินซิเพิล สมดุลตามอายุ ซึ่งจดทะเบียนแล้ว		YTD				Average			2564			2565			2566			SI			SI date	Port	BM					
Asset Under Mgt		S.Port	S.BM	Diff	S.Port	S.BM	Diff	S.Port	S.BM	Diff	S.Port	S.BM	Diff	S.Port	S.BM	Diff	S.Port	S.BM	Diff									
Fund 1	TR_IDAILY	17,552.81	708.11	0.73	(13.00)	13.73	(2.79)	0.26	(3.04)	(4.63)	2.29	(6.91)	(3.35)	(0.44)	(2.91)	(0.39)	(1.09)	0.70	(1.26)	(0.44)	(0.82)	18/08/2015	4.03%	(0.05)	0.73	0.00		
Fund 2	TR_IFIXED	6,815.2	1.49	0.02	1.47	0.19	(0.06)	0.25	0.46	0.64	(0.18)	(0.27)	(0.16)	(0.11)	0.37	(0.68)	1.05	0.55	0.49	0.06	18/08/2015	38.83%	0.22	1.49	0.02			
Fund 3	TR_TEQ	1,225.5	(1.67)	(2.02)	0.34	0.26	0.09	0.16	1.35	1.27	0.08	0.66	0.36	0.31	(1.24)	(1.34)	0.11	(0.19)	(0.04)	(0.15)	18/08/2015	6.98%	(0.01)	0.00	0.00			
Fund 4	TR_TDIF	40.3	(1.61)	(2.02)	0.41	0.12	0.09	0.02	0.92	1.27	(0.35)	0.49	0.36	0.13	(1.06)	(1.34)	0.28	(0.11)	(0.05)	(0.06)	25/12/2020	0.23%	(0.00)	0.00	0.00			
Fund 5	TR_SET50	68.4	(1.88)	(1.76)	(0.13)	(0.02)	0.03	(0.05)	0.59	0.82	(0.23)	0.55	0.40	0.15	(1.20)	(1.12)	(0.08)	(0.25)	(0.15)	(0.11)	28/11/2020	0.39%	(0.00)	0.00	0.00			
Fund 6	TR_GEQ	946.8	2.79	1.87	0.92	0.66	0.79	(0.14)	2.12	2.11	0.01	(1.34)	(0.89)	(0.44)	1.19	1.16	0.03	0.41	0.53	(0.13)	18/08/2015	5.39%	0.02	2.79	1.87			
Fund 7	TR_GOPP	143.0	1.55	0.96	0.59	(0.17)	0.78	(0.95)	(0.15)	2.15	(2.30)	(1.86)	(0.95)	(0.92)	1.51	1.14	0.37	(0.18)	0.48	(0.67)	26/11/2020	0.81%	(0.00)	1.55	0.96			
Fund 8	TR_GESG	27.5	2.31	1.69	0.63	1.03	1.14	(0.04)			-			-	1.03	1.14	(0.11)	1.17	1.23	(0.06)	01/01/2023	0.16%	0.00	2.31	1.69			
Fund 9	TR_GQE	11.2	1.62	1.22	0.40	#DIV/0!	#DIV/0!	-			-			-			-	2.05	2.20	(0.15)	04/11/2023	0.06%	0.00	1.62	1.22			
Fund 10	TR_IPROP	371.4	(3.89)	(4.86)	0.97	(0.30)	(0.11)	(0.19)	(0.01)	0.47	(0.48)	(0.68)	(0.63)	(0.05)	(0.22)	(0.18)	(0.04)	(0.12)	(0.00)	(0.12)	18/08/2015	2.12%	(0.00)	0.00	0.00			
Fund 11	TD_P	267.7	0.71	0.46	0.25	0.49	0.38	0.11	1.63	1.48	0.15	(0.52)	(0.46)	(0.06)	0.36	0.11	0.25	0.21	0.39	(0.18)	12/09/2014	1.53%	0.00	0.71	0.46			
Fund 12	TD_30	1,497.3	0.73	0.45	0.28	0.49	0.40	0.09	1.71	1.50	0.22	(0.54)	(0.47)	(0.07)	0.29	0.16	0.13	0.03	0.23	(0.20)	31/07/2014	8.53%	0.00	0.73	0.45			
Fund 13	TD_40	2,734.5	0.82	0.50	0.33	0.51	0.47	0.04	1.65	1.53	0.12	(0.39)	(0.40)	0.01	0.27	0.28	(0.01)	0.10	0.29	(0.19)	31/07/2014	15.58%	0.02	0.82	0.50			
Fund 14	TD_50	1,565.3	0.82	0.46	0.36	0.51	0.47	0.04	1.66	1.55	0.11	(0.37)	(0.40)	0.03	0.24	0.26	(0.02)	0.10	0.29	(0.19)	31/07/2014	8.92%	0.01	0.82	0.46			
Fund 15	TD_60	1,021.5	0.78	0.40	0.38	0.49	0.47	0.03	1.67	1.55	0.11	(0.38)	(0.39)	0.01	0.19	0.24	(0.05)	0.09	0.28	(0.19)	31/07/2014	5.82%	0.01	0.78	0.40			
Fund 16	TD_70	109.3	0.74	0.37	0.37	0.44	0.47	(0.02)	1.58	1.56	0.02	(0.43)	(0.37)	(0.07)	0.18	0.20	(0.03)	0.39	0.40	(0.01)	19/12/2020	0.62%	0.00	0.74	0.37			
Average of Excess Return as Sharp ratio		1.36	0.38	(0.95)	1.33	0.13	0.38	(0.23)	0.75	1.44	(0.60)	(0.60)	(0.32)	(0.25)	0.10	(0.07)	0.16	0.19	0.38	(0.20)					0.94	0.52	<- Simple AVG	
																				Since inception (Weighted Avg all funds)		0.21				1.10	0.31	<- Weighted AVG

YTD	
Port	BM
0.73	0.00
1.49	0.02
0.00	0.00
0.00	0.00
0.00	0.00
2.79	1.87
1.55	0.96
2.31	1.69
1.62	1.22
0.00	0.00
0.71	0.46
0.73	0.45
0.82	0.50
0.82	0.46
0.78	0.40
0.74	0.37
0.94	0.52
1.10	0.31

<- Simple AVG
<- Weighted AVG