

หนังสือชี้ชวนส่วนสรุปข้อมูลสำคัญ



krungsri
Asset Management

เครือ MUFG หนึ่งในสถาบันการเงินที่ใหญ่ที่สุดของโลก

บลจ.กรุงศรี จำกัด
การเข้าร่วมการต่อต้านทุจริต :
ได้รับการรับรอง CAC

กองทุนเปิดกรุงศรี
หุ้นปันผลเพื่อการเลี้ยงชีพ
[KFDIVRMF]
กองทุนตราสารทุน

กองทุนรวมเพื่อการเลี้ยงชีพ

กองทุนรวมที่เน้นลงทุนแบบไม่มีความเสี่ยงในต่างประเทศ



คุณกำลังจะลงทุนอะไร?



กองทุนรวมนี้เหมาะกับใคร?



คุณต้องระวังอะไรเป็นพิเศษ?



สัดส่วนของประเภททรัพย์สินที่ลงทุน



ค่าธรรมเนียม



ผลการดำเนินงานในอดีต



ข้อมูลอื่นๆ

การลงทุนในกองทุนรวม **ไม่ใช่** การฝากเงิน



คุณกำลังจะลงทุนอะไร?

• นโยบายการลงทุน

- ลงทุนในตราสารทุนโดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV โดยเน้นลงทุนในหุ้นที่มีแนวโน้มจ่ายเงินปันผลดี
- ส่วนที่เหลือจะลงทุนในตราสารหนี้ภาครัฐ สถาบันการเงิน บริษัทเอกชน หรือเงินฝากธนาคาร

• กลยุทธ์ในการบริหารจัดการลงทุน

มุ่งหวังให้ผลตอบแทนสูงกว่าดัชนีชี้วัด (Active Management)



กองทุนรวมนี้เหมาะกับใคร?

- ผู้ลงทุนที่สามารถรับความผันผวนของราคาตราสารหนี้และหุ้นที่กองทุนรวมไปลงทุน ซึ่งอาจจะปรับตัวเพิ่มสูงขึ้นหรือลดลงจนต่ำกว่ามูลค่าที่ลงทุนและทำให้ขาดทุนได้
- ผู้ที่สามารถลงทุนในระยะกลางถึงระยะยาว โดยคาดหวังผลตอบแทนในระยะยาวที่ดีกว่าการลงทุนในตราสารหนี้ทั่วไป

กองทุนรวมนี้ไม่เหมาะกับใคร

ผู้ลงทุนที่เน้นการได้รับผลตอบแทนในจำนวนเงินที่แน่นอน หรือรักษาเงินต้นให้อยู่ครบ



ทำอย่างไรหากยังไม่เข้าใจนโยบาย และความเสี่ยงของกองทุนนี้

- อ่านหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม หรือสอบถามผู้สนับสนุนการขายและบริษัทจัดการ
อย่าลงทุนหากไม่เข้าใจลักษณะและความเสี่ยงของกองทุนรวมนี้ดีพอ

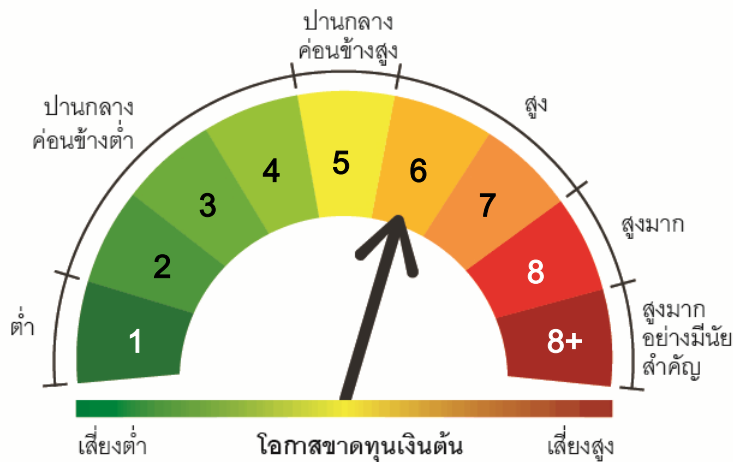


คุณต้องระวังอะไรเป็นพิเศษ?

• ค่าเตือนที่สำคัญ

- กองทุนนี้มีการลงทุนในเงินฝาก ตราสารหนี้ และตราสารทุน ราคาตราสารที่ลงทุนหรือมีไว้ อาจมีความไม่แน่นอน อันเนื่องจากการเปลี่ยนแปลงของอัตราดอกเบี้ย ผลประกอบการของบริษัทหรือของทั้งอุตสาหกรรม หรือภาวะเศรษฐกิจทั่วไป
- ผู้ลงทุนควรศึกษาข้อมูลเกี่ยวกับสิทธิประโยชน์ทางภาษีที่ระบุไว้ในคู่มือการลงทุนในกองทุนรวมเพื่อการเลี้ยงชีพ
- ผู้ลงทุนในกองทุนรวมนี้ จะไม่สามารถนำหน่วยลงทุนของกองทุนไปจำหน่าย จ่าย โอน จำนำ หรือนำไปเป็นประกัน
- ในกรณีที่มีแนวโน้มว่าจะมีการขายคืนหน่วยลงทุนเกินกว่า 2 ใน 3 ของจำนวนหน่วยลงทุนที่จำหน่ายได้ แล้วทั้งหมด บริษัทจัดการอาจใช้ดุลยพินิจในการเลิกกองทุนรวม และอาจยกเลิกคำสั่งซื้อขายหน่วยลงทุนที่ได้รับไว้แล้วหรือ หยุดรับคำสั่งดังกล่าวได้

แผนภาพแสดงตำแหน่งความเสี่ยงของกองทุนรวม



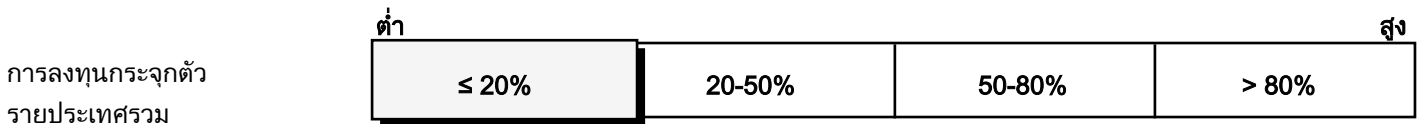
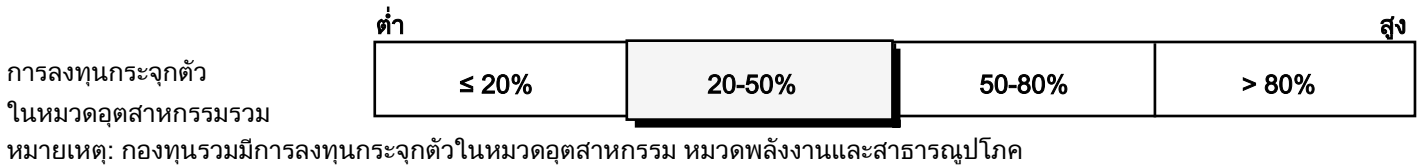
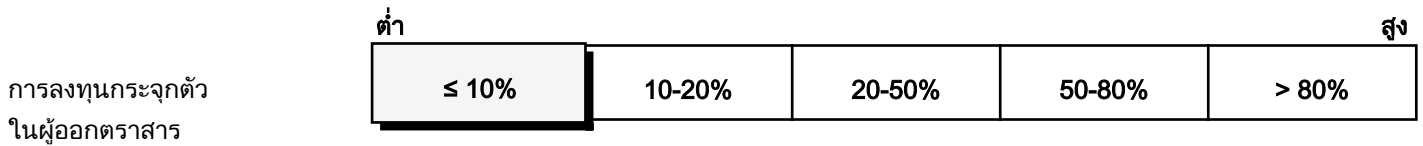
ปัจจัยความเสี่ยงที่สำคัญ

1. ความเสี่ยงจากความผันผวนของมูลค่าหน่วยลงทุน (Market Risk)

| | | | | | | | |
|----------------------------------|---------|-----------|-----------|----------|-------|--|-----|
| | ต่ำ | | | | | | สูง |
| ความผันผวนของผลการดำเนินงาน (SD) | < 5% | 5-10% | 10 - 15% | 15 - 25% | > 25% | | |
| กลุ่มหุ้นในประเทศที่ลงทุน | General | Large Cap | Mid/Small | Sector | | | |

*ค่า SD แสดงความผันผวนของกองทุนย้อนหลัง 5 ปี (หรือตั้งแต่จัดตั้งกองทุนกรณียังไม่ครบ 5 ปี)

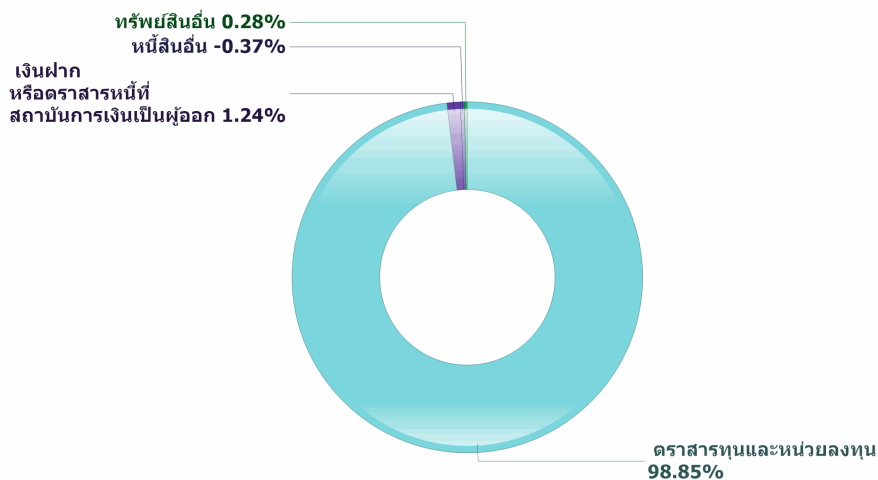
2. ความเสี่ยงจากการลงทุนกระจุกตัว (High Concentration Risk)



หมายเหตุ: กองทุนรวมไม่มีการลงทุนกระจุกตัวในประเทศใดประเทศหนึ่งมากกว่า 20% ของ NAV รวมกัน



สัดส่วนของประเภททรัพย์สินที่ลงทุน



5 หมวดหลักทรัพย์สินแรกที่ลงทุน

| | |
|------------------------------------|-------|
| หมวดพลังงานและสาธารณูปโภค | 24.75 |
| หมวดธนาคาร | 12.40 |
| หมวดพาณิชย์ | 9.70 |
| หมวดเทคโนโลยีสารสนเทศและการสื่อสาร | 7.62 |
| หมวดอาหารและเครื่องดื่ม | 6.96 |

ชื่อหลักทรัพย์ที่ลงทุนสูงสุด 5 อันดับแรก

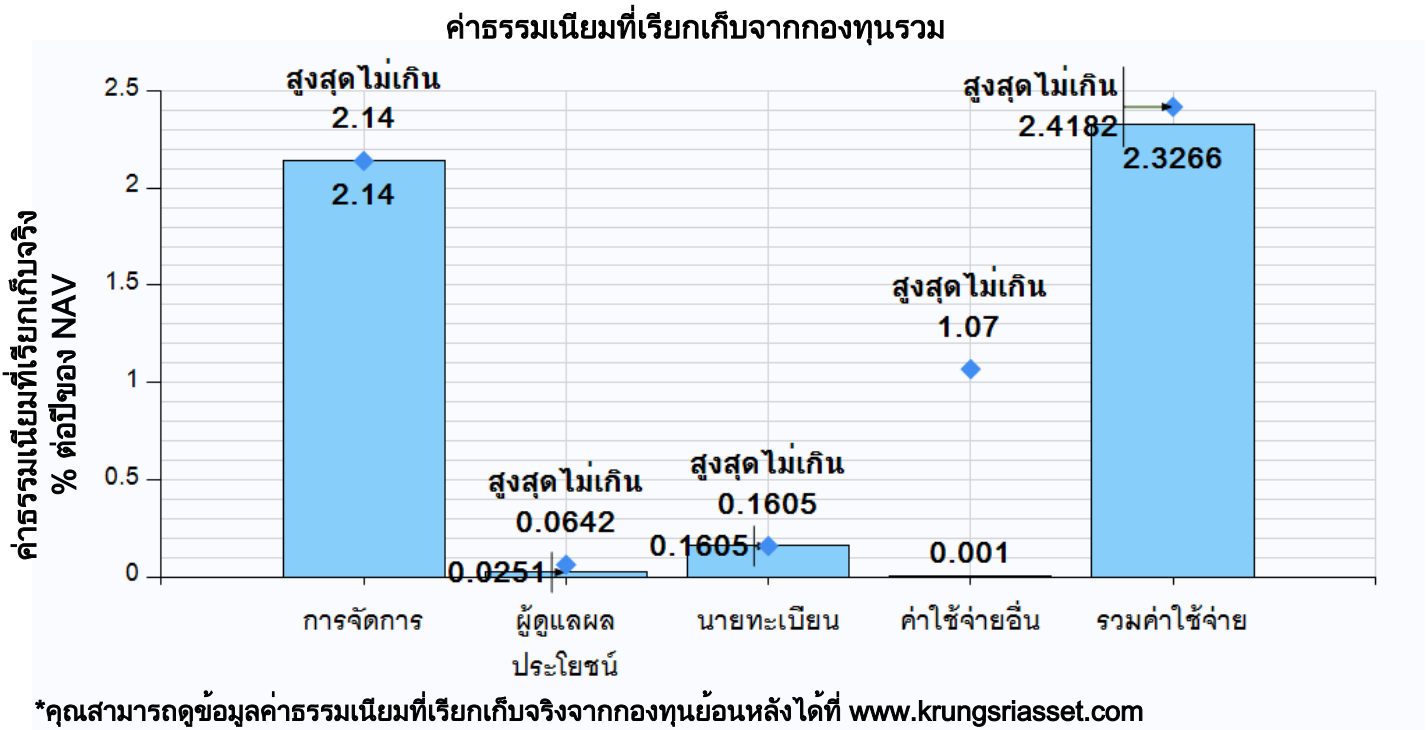
| ชื่อหลักทรัพย์ | Security Code | % ของ NAV |
|---------------------------------|---------------|-----------|
| บมจ.ปตท | PTT | 7.63 |
| บมจ.ท่าอากาศยานไทย | AOT | 5.66 |
| บมจ.ปูนซีเมนต์ไทย | SCC | 4.71 |
| บมจ.ปตท.สำรวจ และผลิตปิโตรเลียม | PTTEP | 3.94 |
| บมจ. ซีพี ออลล์ | CPALL | 3.84 |



ค่าธรรมเนียม

ค่าธรรมเนียมมีผลกระทบต่อผลตอบแทนที่คุณจะได้รับ ดังนั้น คุณควรพิจารณาการเรียกเก็บค่าธรรมเนียมดังกล่าวก่อนการลงทุน

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)



ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)

| รายการ | สูงสุดไม่เกิน | เก็บจริง |
|---|---------------------|--------------|
| ค่าธรรมเนียมขาย | 0.50 | ไม่เรียกเก็บ |
| ค่าธรรมเนียมการรับซื้อคืน | 0.50 | ไม่เรียกเก็บ |
| ค่าธรรมเนียมสับเปลี่ยนเข้า | 0.50 | ไม่เรียกเก็บ |
| ค่าธรรมเนียมสับเปลี่ยนออก | 0.25 | ไม่เรียกเก็บ |
| ค่าปรับกรณีขายคืนและสับเปลี่ยนออกก่อนระยะเวลาที่กำหนด | ไม่มี | ไม่มี |
| ค่าธรรมเนียมการโอน | ไม่มี | ไม่มี |
| ค่าใช้จ่ายในการซื้อขายหลักทรัพย์เมื่อมีการซื้อ ขาย สับเปลี่ยน | ตามที่เรียกเก็บจริง | 0.15 |

หมายเหตุ : ค่าธรรมเนียมดังกล่าวเป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว



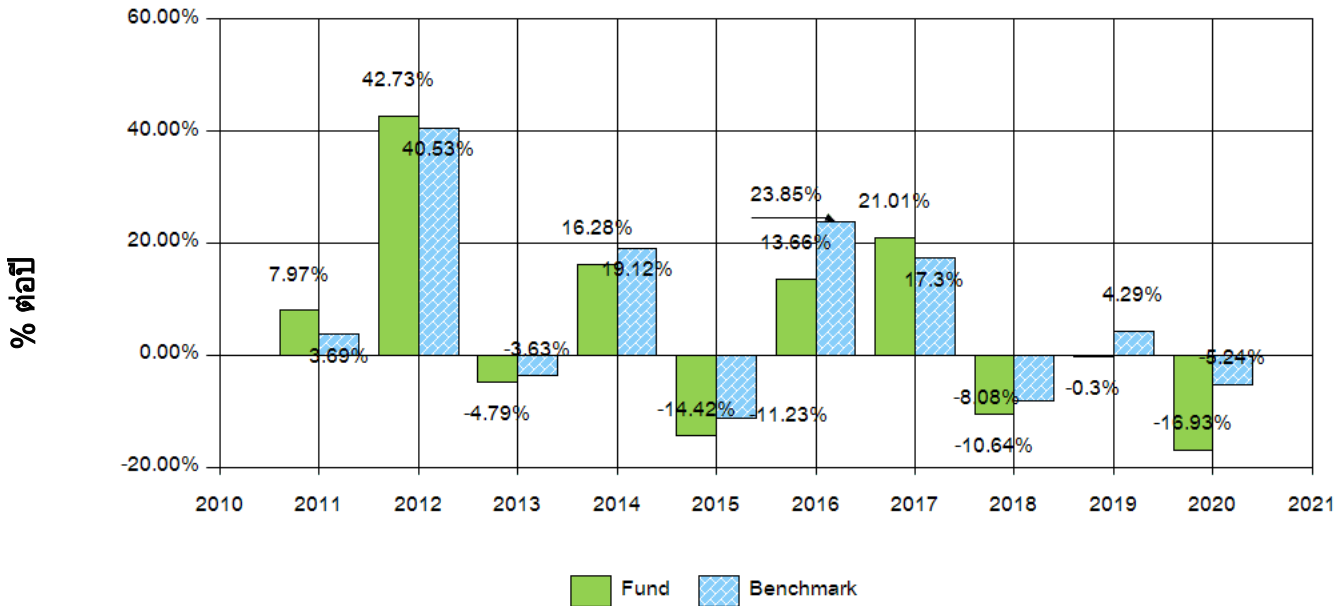
ผลการดำเนินงานในอดีต

ผลการดำเนินงานในอดีต มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

1. ดัชนีชี้วัด (benchmark) ของกองทุนรวม

ดัชนีผลตอบแทนรวมตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET TRI)

2. แบบย้อนหลังตามปีปฏิทิน



* ในปีที่กองทุนจัดตั้ง ผลการดำเนินงานจะแสดงตั้งแต่วันที่จัดตั้งจนถึงสิ้นปีปฏิทิน

3. กองทุนนี้เคยมีผลขาดทุนสูงสุดในช่วงเวลา 5 ปี : -44.17 %

* กรณีกองทุนจัดตั้งไม่ครบ 5 ปีจะแสดงค่าที่เกิดขึ้นนับตั้งแต่จัดตั้งกองทุน

4. ความผันผวนของผลการดำเนินงาน (standard deviation) : 15.99 % ต่อปี

* กรณีกองทุนจัดตั้งไม่ครบ 5 ปีจะแสดงค่าที่เกิดขึ้นนับตั้งแต่จัดตั้งกองทุน

5. ความผันผวนของส่วนต่างผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัด (Tracking Error : TE) : ไม่มีข้อมูล (N/A)

6. ประเภทกองทุนรวมเพื่อใช้เปรียบเทียบผลการดำเนินงาน ณ จุดขาย คือ Equity Large Cap

7. ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด

| ผลการดำเนินงาน | YTD | 3 เดือน | | 6 เดือน | | 1 ปี | | 3 ปี | | 5 ปี | | 10 ปี | | ตั้งแต่จัดตั้ง |
|-------------------------------------|-------|---------|---------------|---------|---------------|-------|---------------|-------|---------------|-------|---------------|-------|---------------|----------------|
| | | % | Perce tile | % | Perce tile | % | Perce tile | % | Perce tile | % | Perce tile | % | Perce tile | |
| KFDIVRMF | 7.95 | 3.82 | 75th | 7.22 | 95th | 6.94 | 95th | -6.75 | 95th | 0.47 | 95th | 4.24 | 95th | 7.44 |
| ดัชนีชี้วัด | 11.87 | 8.04 | 5th | 15.19 | 25th | 21.64 | 25th | 0.45 | 25th | 5.50 | 25th | 7.48 | 25th | 8.81 |
| ความผันผวน ของผลการ ดำเนินงาน | 12.84 | 12.51 | 25th | 15.65 | 5th | 17.36 | 25th | 19.23 | 25th | 15.99 | 25th | 16.10 | 50th | 16.29 |
| ความผันผวน ของดัชนีชี้วัด | 13.78 | 12.94 | 25th | 16.93 | 50th | 17.42 | 25th | 19.69 | 25th | 16.48 | 25th | 16.69 | 75th | 19.32 |

- ผลตอบแทนที่มีอายุเกินหนึ่งปีจะแสดงเป็นผลตอบแทนต่อปี

ตารางแสดงผลการดำเนินงานย้อนหลังของกลุ่ม Equity Large Cap ข้อมูล ณ วันที่ 31 พ.ค. 2564

| เปอร์เซ็นต์ไทล์ | ผลการดำเนินงาน (%) | | | | | |
|-----------------------|--------------------|-----------|-----------|------------|------------|-----------|
| | 3 เดือน | 6 เดือน | 1 ปี | 3 ปี | 5 ปี | 10 ปี |
| เปอร์เซ็นต์ไทล์ที่ 5 | 6.71 | 15.95 | 28.54 | 2.33 | 7.69 | 8.01 |
| เปอร์เซ็นต์ไทล์ที่ 25 | 4.92 | 13.47 | 16.89 | -2.02 | 4.17 | 6.64 |
| เปอร์เซ็นต์ไทล์ที่ 50 | 4.22 | 9.38 | 12.18 | -3.09 | 3.12 | 5.40 |
| เปอร์เซ็นต์ไทล์ที่ 75 | ★ 3.21 | 7.37 | 9.55 | -5.24 | 1.46 | 4.44 |
| เปอร์เซ็นต์ไทล์ที่ 95 | -1.84 | ★ 5.14 | ★ 6.52 | ★ -8.27 | ★ -1.43 | ★ 4.11 |

| เปอร์เซ็นต์ไทล์ | ความผันผวนของผลการดำเนินงาน (%) | | | | | |
|-----------------------|---------------------------------|------------|------------|------------|------------|------------|
| | 3 เดือน | 6 เดือน | 1 ปี | 3 ปี | 5 ปี | 10 ปี |
| เปอร์เซ็นต์ไทล์ที่ 5 | 12.41 | ★ 15.82 | 17.28 | 18.93 | 15.85 | 15.69 |
| เปอร์เซ็นต์ไทล์ที่ 25 | ★ 12.99 | 16.76 | ★ 17.74 | ★ 20.14 | ★ 16.54 | 16.02 |
| เปอร์เซ็นต์ไทล์ที่ 50 | 13.65 | 17.49 | 18.74 | 20.95 | 16.97 | ★ 16.47 |
| เปอร์เซ็นต์ไทล์ที่ 75 | 14.37 | 18.18 | 20.03 | 22.46 | 18.12 | 16.93 |
| เปอร์เซ็นต์ไทล์ที่ 95 | 18.54 | 25.85 | 31.25 | 28.21 | 21.62 | 17.51 |

- กรณศึกษาข้อตกลงและเงื่อนไขของข้อมูลเปรียบเทียบกับผลการดำเนินงานแบบเปอร์เซ็นต์ไทล์ได้ที่หมายเหตุหน้าท้าย



ข้อมูลอื่นๆ

| | | | |
|--|---|--------------------------------------|-------------------------|
| นโยบายการจ่ายเงินปันผล : | ไม่จ่ายปันผล | | |
| ผู้ดูแลผลประโยชน์ : | ธนาคารไทยพาณิชย์ | | |
| วันที่จดทะเบียน : | 27 ธ.ค. 2550 | | |
| อายุโครงการ : | ไม่กำหนดอายุโครงการ | | |
| การซื้อหน่วยลงทุน : | วันทำการซื้อ | ทุกวันทำการของธนาคารภายใน 15:30 น. | |
| | มูลค่าขั้นต่ำของการซื้อครั้งแรก | 2,000 บาทไม่เกิน 500,000 บาท | |
| | มูลค่าขั้นต่ำของการซื้อครั้งต่อไป | 2,000 บาทไม่เกิน 500,000 บาท | |
| การขายคืนหน่วยลงทุน : | วันทำการขายคืน | ทุกวันทำการของธนาคารภายใน 15:30 น. | |
| | มูลค่าขั้นต่ำของการขายคืน | ไม่มี | |
| | ยอดคงเหลือขั้นต่ำ | ไม่กำหนด | |
| | ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน | 3 วันทำการนับถัดจากวันทำรายการ (T+3) | |
| | ผู้ลงทุนสามารถตรวจสอบมูลค่าทรัพย์สินรายวันได้ที่ www.krungsriasset.com | | |
| รายชื่อผู้จัดการกองทุน : | ชื่อ-นามสกุล | ขอบเขตหน้าที่ | วันที่เริ่มบริหารกองทุน |
| | นายสาธิต บัวชู | ผู้จัดการกองทุนตราสารทุน | 30 ต.ค. 2563 |
| | นายวิพุธ เอื้ออานันท์ | ผู้จัดการกองทุนตราสารทุน | 27 ธ.ค. 2550 |
| อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุนของกองทุน (Portfolio Turnover Ratio) | ในรอบระยะเวลาที่ผ่านมาย้อนหลัง 1 ปี เท่ากับ 44.69% กรณีกองทุนรวมที่จดทะเบียนจัดตั้งไม่ถึง 1 ปี จะแสดงค่าที่เกิดขึ้นจริงในช่วงเวลาดังตั้งแต่วันที่จดทะเบียนถึงวันที่รายงาน | | |
| ผู้สนับสนุนการขายหรือรับซื้อคืน | ธนาคารกรุงศรีอยุธยา จำกัด (มหาชน) ทุกสาขา โทร 1572 บลจ.กรุงศรี หรือตัวแทนผู้สนับสนุนการขายและรับซื้อคืน | | |
| ติดต่อสอบถาม รับหนังสือชี้ชวน/ร้องเรียน | บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด ที่อยู่ 898 อาคารเพลินจิตทาวเวอร์ ชั้น 1-2 โชนเอ ชั้น 12 ชั้น 18 โชนบี ถนนเพลินจิต แขวงลุมพินี เขตปทุมวัน กรุงเทพฯ 10330 โทรศัพท์ 0 2657 5757 โทรสาร 02 657 5777 เว็บไซต์ : www.krungsriasset.com อีเมล : krungsriasset.clientservice@krungsri.com | | |
| ธุรกรรมที่อาจก่อให้เกิดความขัดแย้งทางผลประโยชน์ | คุณสามารถตรวจสอบธุรกรรมที่อาจก่อให้เกิดความขัดแย้งทางผลประโยชน์ได้ที่ www.krungsriasset.com/th/Investment/RelatedPartyTransactions.html | | |
| ข้อมูลอื่นๆ | ขนาดกองทุน | 9,409 ล้านบาท | |
| | มูลค่าหน่วยลงทุน | 26.2163 บาท/หน่วย | |
| | Morningstar Rating : | ★★★ (ข้อมูล ณ 30 เม.ย. 2564) | |

หมายเหตุ

- การลงทุนในหน่วยลงทุนไม่ใช่การฝากเงิน รวมทั้งไม่ได้อยู่ภายใต้ความคุ้มครองของสถาบันคุ้มครองเงินฝาก จึงมีความเสี่ยงจากการลงทุนซึ่งผู้ลงทุนอาจไม่ได้รับเงินลงทุนคืนเต็มจำนวน
- ได้รับอนุมัติจัดตั้ง และอยู่ภายใต้การกำกับดูแลของสำนักงาน ก.ล.ต
- การพิจารณาว่าหนังสือชี้ชวนในการเสนอขายหน่วยลงทุนของกองทุนรวมนี้มิได้เป็นการแสดงว่าสำนักงาน ก.ล.ต. ได้รับความถูกต้องของข้อมูลในหนังสือชี้ชวนของกองทุนรวม หรือ ได้ประกันราคาหรือผลตอบแทนของหน่วยลงทุนที่เสนอขายนั้น ทั้งนี้ บริษัทจัดการกองทุนรวมได้สอบทานข้อมูลในหนังสือชี้ชวนส่วนสรุปข้อมูลสำคัญ ณ วันที่ 31 พ.ค. 2564 แล้วด้วยความระมัดระวังในฐานะผู้รับผิดชอบในการดำเนินการของกองทุนรวมและขอรับรองว่าข้อมูลดังกล่าวถูกต้องไม่เป็นเท็จและไม่ทำให้ผู้อื่นสำคัญผิด
- ข้อมูลการจัดอันดับกองทุนเป็นกรรมสิทธิ์ของบริษัท มอร์นิ่งสตาร์ ทั้งนี้บริษัทขอสงวนสิทธิ์ 1) ในการแก้ไข ปรับปรุง หรือเปลี่ยนแปลงข้อมูลใดๆ โดยไม่จำเป็นต้องแจ้งให้ทราบล่วงหน้าแต่อย่างใด 2) บริษัทขอสงวนสิทธิ์ที่จะไม่รับผิดชอบต่อความถูกต้อง ครบถ้วน และความเสียหายต่างๆ ที่เกิดขึ้นทุกกรณีจากการนำรายงานหรือข้อมูลไปใช้อ้างอิง

ข้อตกลงและเงื่อนไขของข้อมูลเปรียบเทียบผลการดำเนินงานแบบเปอร์เซ็นต์ไทล์

1. ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุน มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต
 2. ผู้ลงทุนสามารถดูข้อมูลฉบับเต็มได้ที่ www.aimc.or.th
 3. ผลการดำเนินงานของกองทุนที่การเปรียบเทียบแบ่งตามประเภทกองทุนรวมภายใต้ข้อกำหนดของสมาคมบริษัทจัดการลงทุน โดยกองทุนที่จะถูกเปรียบเทียบผลการดำเนินงานในแต่ละช่วงเวลากับกองทุนประเภทเดียวกันในระดับเปอร์เซ็นต์ไทล์ (Percentiles) ต่างๆ โดยแบ่งออกเป็น
 - 5th Percentile แสดงผลการดำเนินงานของกองทุนอันดับที่ 5 เปอร์เซ็นต์ไทล์ (Top 5% performance)
 - 25th Percentile แสดงผลการดำเนินงานของกองทุนอันดับที่ 25 เปอร์เซ็นต์ไทล์ (Top 25% performance)
 - 50th Percentile แสดงผลการดำเนินงานของกองทุนอันดับที่ 50 เปอร์เซ็นต์ไทล์ (Median performance)
 - 75th Percentile แสดงผลการดำเนินงานของกองทุนอันดับที่ 75 เปอร์เซ็นต์ไทล์ (Bottom 25% performance)
 - 95th Percentile แสดงผลการดำเนินงานของกองทุนอันดับที่ 95 เปอร์เซ็นต์ไทล์ (Bottom 5% performance)
- เมื่อผู้ลงทุนทราบผลตอบแทนของกองทุนที่ลงทุน สามารถนำไปเปรียบเทียบกับเปอร์เซ็นต์ไทล์ตามตาราง จะทราบว่ากองทุนที่ลงทุนนั้นอยู่ในช่วงที่เท่าใดของประเภทกองทุนรวมนั้น

คำอธิบายรายละเอียดของข้อมูลที่ต้องเปิดเผยในหนังสือชี้ชวนส่วนสรุปข้อมูลสำคัญ

ข้อมูลที่เปิดเผยในส่วนนี้เป็นข้อมูล โดยสังเขปเพื่อใช้อธิบายมิติความเสี่ยงต่างๆ

| | หัวข้อ | การเปิดเผยข้อมูล | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|----------------------------------|---|--|--------------------------|--|--------|-----|--|--|---------------|-----|-------|--------|--------|--------|---------------------|------|-------|--------|--------|-------|----------------------------------|---|-----|--|-------|--------|-----------------------|-------|---------|-----------|-----------|--------|--|--|--|--|-----|-----|-------|--------|--------|-------|--|--|
| 1 | <p>ความเสี่ยงจากความผันผวนของมูลค่าหน่วยลงทุน (Market Risk)</p> | <p>แบ่งเป็นกรณีกองทุนรวมต่างๆ ดังต่อไปนี้</p> <table border="1" data-bbox="414 291 1492 448"> <tr> <td data-bbox="414 291 718 336">- กรณีกองทุนรวมตราสารทุน</td> <td colspan="5" data-bbox="718 291 1492 336">พิจารณาค่าความผันผวนของผลการดำเนินงานกองทุนรวม (standard deviation : SD) ต่อปี</td> </tr> <tr> <td data-bbox="414 336 718 380">ความผันผวนของ</td> <td data-bbox="718 336 798 380">ต่ำ</td> <td data-bbox="798 336 877 380"></td> <td data-bbox="877 336 957 380"></td> <td data-bbox="957 336 1037 380"></td> <td data-bbox="1037 336 1492 380">สูง</td> </tr> <tr> <td data-bbox="414 380 718 425">ผลการดำเนินงาน (SD)</td> <td data-bbox="718 380 798 425">< 5%</td> <td data-bbox="798 380 877 425">5-10%</td> <td data-bbox="877 380 957 425">10-15%</td> <td data-bbox="957 380 1037 425">15-25%</td> <td data-bbox="1037 380 1492 425">> 25%</td> </tr> </table> <p>กรณีกองทุนรวมตราสารทุน หมายถึง ความเสี่ยงที่มูลค่าของหลักทรัพย์ที่กองทุนรวมลงทุนจะเปลี่ยนแปลงเพิ่มขึ้นหรือลดลงจากปัจจัยภายนอก เช่น สถานะเศรษฐกิจการลงทุน ปัจจัยทางการเมืองทั้งในและต่างประเทศ เป็นต้น ซึ่งพิจารณาได้จากค่า standard deviation (SD) ของกองทุนรวม หากกองทุนรวมมีค่า SD สูง แสดงว่ากองทุนรวมมีความผันผวนจากการเปลี่ยนแปลงของราคาหลักทรัพย์สูง</p> <p>กรณีกองทุนรวมตราสารทุนในประเทศ สามารถพิจารณาลักษณะหุ้นที่กองทุนรวมเน้นลงทุน</p> <table border="1" data-bbox="414 728 1492 907"> <tr> <td data-bbox="414 728 718 772">- กรณีกองทุนรวมตราสารทุนในประเทศ</td> <td colspan="5" data-bbox="718 728 1492 772">ระบุมิติความเสี่ยงของลักษณะหุ้นที่กองทุนรวมเน้นลงทุน (ประมาณ 80% ของ NAV)</td> </tr> <tr> <td data-bbox="414 772 718 817">กลุ่มหุ้นที่เน้นลงทุน</td> <td data-bbox="718 772 798 817">ต่ำ</td> <td data-bbox="798 772 877 817">general</td> <td data-bbox="877 772 957 817">large cap</td> <td data-bbox="957 772 1037 817">mid/small</td> <td data-bbox="1037 772 1492 817">sector</td> </tr> <tr> <td></td> <td data-bbox="718 817 798 862"></td> <td data-bbox="798 817 877 862"></td> <td data-bbox="877 817 957 862"></td> <td data-bbox="957 817 1037 862"></td> <td data-bbox="1037 817 1492 862">สูง</td> </tr> </table> | - กรณีกองทุนรวมตราสารทุน | พิจารณาค่าความผันผวนของผลการดำเนินงานกองทุนรวม (standard deviation : SD) ต่อปี | | | | | ความผันผวนของ | ต่ำ | | | | สูง | ผลการดำเนินงาน (SD) | < 5% | 5-10% | 10-15% | 15-25% | > 25% | - กรณีกองทุนรวมตราสารทุนในประเทศ | ระบุมิติความเสี่ยงของลักษณะหุ้นที่กองทุนรวมเน้นลงทุน (ประมาณ 80% ของ NAV) | | | | | กลุ่มหุ้นที่เน้นลงทุน | ต่ำ | general | large cap | mid/small | sector | | | | | | สูง | | | | | | |
| - กรณีกองทุนรวมตราสารทุน | พิจารณาค่าความผันผวนของผลการดำเนินงานกองทุนรวม (standard deviation : SD) ต่อปี | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| ความผันผวนของ | ต่ำ | | | | สูง | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| ผลการดำเนินงาน (SD) | < 5% | 5-10% | 10-15% | 15-25% | > 25% | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| - กรณีกองทุนรวมตราสารทุนในประเทศ | ระบุมิติความเสี่ยงของลักษณะหุ้นที่กองทุนรวมเน้นลงทุน (ประมาณ 80% ของ NAV) | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| กลุ่มหุ้นที่เน้นลงทุน | ต่ำ | general | large cap | mid/small | sector | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| | | | | | สูง | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 2 | <p>ความเสี่ยงจากการลงทุนกระจุกตัว</p> <p>- ความเสี่ยงจากการลงทุนกระจุกตัวในผู้ออกตราสารรายใดรายหนึ่ง (High issuer concentration risk)</p> <p>- ความเสี่ยงจากการลงทุนกระจุกตัวในหมวดอุตสาหกรรมใดอุตสาหกรรมหนึ่ง (High sector concentration risk)</p> <p>- ความเสี่ยงจากการลงทุนกระจุกตัวในประเทศใดประเทศ</p> | <p>ความเสี่ยงจากการลงทุนกระจุกตัว (High concentration risk) แบ่งเป็นความเสี่ยงแบบต่างๆ ดังต่อไปนี้</p> <table border="1" data-bbox="710 1019 1524 1108"> <tr> <td data-bbox="710 1019 742 1064">ต่ำ</td> <td data-bbox="742 1019 869 1064"></td> <td data-bbox="869 1019 997 1064"></td> <td data-bbox="997 1019 1125 1064"></td> <td data-bbox="1125 1019 1252 1064"></td> <td data-bbox="1252 1019 1380 1064"></td> <td data-bbox="1380 1019 1524 1064">สูง</td> </tr> <tr> <td data-bbox="710 1064 742 1108"></td> <td data-bbox="742 1064 869 1108">≤ 10%</td> <td data-bbox="869 1064 997 1108">10-20%</td> <td data-bbox="997 1064 1125 1108">20-50%</td> <td data-bbox="1125 1064 1252 1108">50-80%</td> <td data-bbox="1252 1064 1380 1108">> 80%</td> <td data-bbox="1380 1064 1524 1108"></td> </tr> </table> <p>พิจารณาจากการลงทุนแบบกระจุกตัวในตราสารของผู้ออกตราสาร คู่สัญญา หรือบุคคลอื่นที่มีภาระผูกพันตามตราสารหรือสัญญานั้น รายใดรายหนึ่งมากกว่า 10% ของ NAV รวมกัน</p> <p>ทั้งนี้ การลงทุนแบบกระจุกตัวไม่รวมถึงกรณีการลงทุนในทรัพย์สินดังนี้</p> <ol style="list-style-type: none"> ตราสารหนี้ภาครัฐไทย ตราสารภาครัฐต่างประเทศที่มีการจัดอันดับความน่าเชื่อถืออยู่ในอันดับที่สามารถลงทุนได้ เงินฝากหรือตราสารเทียบเท่าเงินฝากที่ผู้รับฝากหรือผู้ออกตราสารที่มีการจัดอันดับความน่าเชื่อถืออยู่ในอันดับที่สามารถลงทุนได้ <table border="1" data-bbox="710 1579 1524 1668"> <tr> <td data-bbox="710 1579 742 1624">ต่ำ</td> <td data-bbox="742 1579 869 1624"></td> <td data-bbox="869 1579 997 1624"></td> <td data-bbox="997 1579 1125 1624"></td> <td data-bbox="1125 1579 1252 1624"></td> <td data-bbox="1252 1579 1380 1624"></td> <td data-bbox="1380 1579 1524 1624">สูง</td> </tr> <tr> <td data-bbox="710 1624 742 1668"></td> <td data-bbox="742 1624 869 1668">≤ 20%</td> <td data-bbox="869 1624 997 1668">20-50%</td> <td data-bbox="997 1624 1125 1668">50-80%</td> <td data-bbox="1125 1624 1252 1668">> 80%</td> <td data-bbox="1252 1624 1380 1668"></td> <td data-bbox="1380 1624 1524 1668"></td> </tr> </table> <p>พิจารณาจากการลงทุนกระจุกตัวในหมวดอุตสาหกรรมใดอุตสาหกรรมหนึ่งมากกว่า 20% ของ NAV รวมกัน</p> <p>ทั้งนี้ ไม่รวมถึงกรณีการลงทุนในทรัพย์สินดังนี้ ตราสารหนี้ภาครัฐไทย และต่างประเทศ</p> <p>เงินฝากหรือตราสารเทียบเท่าเงิน</p> <table border="1" data-bbox="726 1960 1524 2049"> <tr> <td data-bbox="726 1960 758 2004">ต่ำ</td> <td data-bbox="758 1960 885 2004"></td> <td data-bbox="885 1960 1013 2004"></td> <td data-bbox="1013 1960 1141 2004"></td> <td data-bbox="1141 1960 1268 2004"></td> <td data-bbox="1268 1960 1396 2004"></td> <td data-bbox="1396 1960 1524 2004">สูง</td> </tr> <tr> <td data-bbox="726 2004 758 2049"></td> <td data-bbox="758 2004 885 2049">≤ 20%</td> <td data-bbox="885 2004 1013 2049">20-50%</td> <td data-bbox="1013 2004 1141 2049">50-80%</td> <td data-bbox="1141 2004 1268 2049">> 80%</td> <td data-bbox="1268 2004 1396 2049"></td> <td data-bbox="1396 2004 1524 2049"></td> </tr> </table> <p>หมายเหตุ: กองทุนรวมมีการลงทุนกระจุกตัวในประเทศ</p> | ต่ำ | | | | | | สูง | | ≤ 10% | 10-20% | 20-50% | 50-80% | > 80% | | ต่ำ | | | | | | สูง | | ≤ 20% | 20-50% | 50-80% | > 80% | | | ต่ำ | | | | | | สูง | | ≤ 20% | 20-50% | 50-80% | > 80% | | |
| ต่ำ | | | | | | สูง | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| | ≤ 10% | 10-20% | 20-50% | 50-80% | > 80% | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| ต่ำ | | | | | | สูง | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| | ≤ 20% | 20-50% | 50-80% | > 80% | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| ต่ำ | | | | | | สูง | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| | ≤ 20% | 20-50% | 50-80% | > 80% | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |

| | หัวข้อ | การเปิดเผยข้อมูล |
|---|---|---|
| | หนึ่ง (High country concentration risk) | พิจารณาจากการลงทุนแบบกระจุกตัวในประเทศใดประเทศหนึ่งมากกว่า 20% ของ NAV รวมกัน ทั้งนี้ ไม่รวมถึงการลงทุนในตราสารที่ผู้ออกเสนอขายอยู่ในประเทศไทย |
| 3 | ผลขาดทุนสูงสุดที่เกิดขึ้นจริง 5 ปี (Maximum Drawdown) | <p>ผลขาดทุนสะสมสูงสุดที่เกิดจากการลงทุนจริงของกองทุนรวมย้อนหลังเป็นระยะเวลาอย่างน้อย 5 ปี นับแต่วันที่รายงาน (หรือตั้งแต่จัดตั้งกองทุนรวมกรณียังไม่ครบ 5 ปี) โดยมีวิธีการคำนวณดังนี้</p> $\text{Drawdown}_{(t)} = \frac{\text{มูลค่าหน่วยลงทุน}_{(t)} - \text{มูลค่าหน่วยลงทุนสูงสุด}^*}{\text{มูลค่าหน่วยลงทุนสูงสุด}^*}$ $\text{Maximum Drawdown} = \min(\text{Drawdown}_{(t)})$ <p>หมายเหตุ : * มูลค่าหน่วยลงทุนสูงสุด คือ มูลค่าหน่วยลงทุนสูงสุดของระยะเวลาก่อนหน้าจนถึงวันที่คำนวณ (t)</p> |
| 4 | ค่าความผันผวนของผลการดำเนินงาน (Standard Deviation : SD) | คือความผันผวนของผลตอบแทนกองทุน (Standard Deviation of Fund) คำนวณจากผลตอบแทนของกองทุนรวมซึ่งมีวิธีการคำนวณเป็นไปตามหลักเกณฑ์ของสมาคมบริษัทจัดการลงทุนว่าด้วยมาตรฐานการวัดและนำเสนอผลการดำเนินงานของกองทุนรวม ใช้การเปิดเผยค่า SD ของกองทุนรวมย้อนหลังเป็นระยะเวลา 5 ปี นับแต่วันที่รายงาน แสดงเป็น % ต่อปี |
| 5 | ค่าความผันผวนของส่วนต่างของผลตอบแทนเฉลี่ยของกองทุนรวมและผลตอบแทนของดัชนีชี้วัด (Tracking Error) | <p>Tracking Error คือ ความผันผวนของส่วนต่างของผลตอบแทนเฉลี่ยของกองทุนรวมและผลตอบแทนของดัชนีชี้วัด ซึ่งสะท้อนให้เห็นถึงประสิทธิภาพในการเลียนแบบดัชนีชี้วัดของกองทุนรวมว่ามีการเบี่ยงเบนออกไปจากดัชนีชี้วัดมากน้อยเพียงใด เช่น หากกองทุนรวมมีค่า TE ต่ำ แสดงว่า อัตราผลตอบแทนของกองทุนมีการเบี่ยงเบนออกไปจาก ดัชนีชี้วัดในอัตราที่ต่ำ ดังนั้น กองทุนรวมนี้จึงมีประสิทธิภาพในการเลียนแบบดัชนีชี้วัด อ้างอิง ในขณะที่กองทุนรวมที่มีค่า TE สูง แสดงว่าอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมมีการเบี่ยงเบนออกจากดัชนีชี้วัดในอัตราที่สูง ดังนั้น โอกาสที่ผลตอบแทน การลงทุนจะเป็นไปตามผลตอบแทนของ benchmark ก็จะลดน้อยลง เป็นต้น</p> <p>ใช้พิจารณากับกองทุนรวมที่มีนโยบายการบริหารกองทุนแบบ passive fund/ Index tracking เช่น กองทุนรวมดัชนี หรือกองทุนรวมอิตาลีเฟ เป็นต้น</p> |
| 6 | อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุนของกองทุนรวม (Portfolio Turnover Ratio : PTR) | <p>เพื่อให้ผู้ลงทุน ทราบถึงปริมาณการซื้อขายทรัพย์สินของกองทุน และช่วยสะท้อนกลยุทธ์การลงทุนของผู้จัดการกองทุน ได้ดียิ่งขึ้น โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อขายทรัพย์สินที่กองทุนรวมลงทุนในรอบระยะเวลาผ่านมาย้อนหลัง 1 ปี หารด้วยมูลค่าทรัพย์สินสุทธิเฉลี่ยของกองทุนรวมในรอบระยะเวลาเดียวกัน</p> <div style="border: 1px solid black; padding: 10px; width: fit-content; margin: 10px auto;"> $\text{PTR} = \frac{\text{Min (ซื้อหุ้น , ขายหุ้น)}}{\text{Avg. NAV}}$ </div> |