

กองทุนเปิดเคเคพี ตราสารหนี้ 1 ปี 6 เดือน 1 ห้ามขายผู้ลงทุนรายย่อย (KKP FIXED INCOME 1Y6M 1 FUND NOT FOR RETAIL INVESTORS)

KKP FI1Y6M1-AI

ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

กองทุนรวมตราสารหนี้ กองทุนรวมที่เสนอขายเฉพาะผู้ลงทุนที่มีรายย่อย กองทุน buy & hold กองทุนรวมที่มีนโยบายเปิดให้มีการลงทุนในกองทุนรวมอื่นภายใต้บลจ.เดียวกัน (Cross Investing Fund) กองทุนรวมที่ลงทุนแบบมีความเสี่ยงทั้งในและต่างประเทศ กลุ่มกองทุนรวม : Miscellaneous

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- กองทุนรวมมีนโยบายลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งตราสารหนี้ที่มีคุณภาพ โดยกองทุนสามารถลงทุนได้ทั้งในและต่างประเทศตามดุลพินิจของผู้จัดการกองทุน เช่น ตราสารหนี้ภาคธุรกิจ ตราสารหนี้ภาคเอกชน ตราสารหนี้ที่ออกโดยนิติบุคคลที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้น หรือตราสารหนี้ที่ออกโดยธนาคารพาณิชย์หรือบริษัทเอกชน เป็นต้น โดยเน้นลงทุนในตราสารที่ได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือของตราสารหรือของผู้ออกตราสารอยู่ในอันดับที่สามารถลงทุนได้ (Investment Grade) ทั้งนี้ กองทุนอาจพิจารณาการลงทุนในต่างประเทศได้ไม่เกินร้อยละ 79 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน
- กองทุนอาจลงทุนในตราสาร non-investment grade/unrated ได้ไม่เกิน 20 % ของ NAV
- กองทุนอาจพิจารณาเข้าทำสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivative) เพื่อลดความเสี่ยง (Hedging) โดยจะเป็นไปตามที่สำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ด. และ/หรือประกาศที่เกี่ยวข้องประกาศกำหนด และหรือที่มีการแก้ไขเปลี่ยนแปลงเพิ่มเติม (ถ้ามี)
- กองทุนอาจลงทุนในกองทุนรวมอื่นภายใต้ บลจ.เดียวกัน (Cross Investing Fund) ในสัดส่วนโดยเฉลี่ยรวมปีบัญชีไม่เกินร้อยละ 100 ของ NAV โดยเป็นไปตามหลักเกณฑ์เงื่อนไขที่สำนักงาน ก.ล.ด.กำหนด
- กลยุทธ์การลงทุน: มีกลยุทธ์การลงทุนครั้งเดียว (buy-and-hold) (กองทุนสามารถลงทุนในทรัพย์สินอื่น ๆ ตามที่ระบุในนโยบายการลงทุนของกองทุน รวมถึงประเภทหลักทรัพย์ ในรายละเอียดโครงการจัดการกองทุนและหนังสือชี้ชวนส่วนข้อมูลโครงการ โปรดศึกษารายละเอียดทั้งหมดเพิ่มเติม <https://am.kkpf.com>)

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 1,2,3 (%ต่อปี)



ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปีกลุ่ม 1,2,3 (%ต่อปี)

	Year to Date	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี
กองทุนรวม	N/A	N/A	N/A	N/A
ตัวชี้วัด	N/A	N/A	N/A	N/A
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	N/A	N/A	N/A	N/A
ความผันผวนของผลการดำเนินงาน ²	N/A	N/A	N/A	N/A
ความผันผวนของตัวชี้วัด	N/A	N/A	N/A	N/A
	3 ปี	5 ปี	10 ปี	ตั้งแต่จัดตั้งกองทุน
กองทุนรวม	N/A	N/A	N/A	N/A
ตัวชี้วัด	N/A	N/A	N/A	N/A
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	N/A	N/A	N/A	N/A
ความผันผวนของผลการดำเนินงาน ²	N/A	N/A	N/A	N/A
ความผันผวนของตัวชี้วัด	N/A	N/A	N/A	N/A

¹ เอกสารการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวมฉบับนี้ ได้จัดทำขึ้นตามมาตรฐานการวัดและนำเสนอผลการดำเนินงานของกองทุนรวมของสมาคมบริษัทจัดการลงทุน

² หากกองทุนรวมมีผลการดำเนินงานตั้งแต่วันที่จดทะเบียนทรัพย์สินกองทุนรวมหรือวันที่เปิดเสนอขายชนิดหน่วยลงทุนไม่ครบ 1 ปีปฏิทิน จะแสดงผลการดำเนินงานของปีปฏิทินแรกตั้งแต่วันที่กองทุนรวมจดทะเบียนทรัพย์สินกองทุนรวมหรือวันที่เปิดเสนอขายชนิดหน่วยลงทุนจนถึงวันที่การสุดท้ายของปีปฏิทินแรก

³ หากกองทุนรวมมีผลการดำเนินงานในปีที่เลิกกองทุนไม่ครบ 1 ปีปฏิทิน จะแสดงผลการดำเนินงานของปีปฏิทินสุดท้ายตั้งแต่วันที่การสุดท้ายของปีปฏิทินก่อนหน้าจนถึงวันที่เลิกกองทุน

ต่ำ	ระดับความเสี่ยง							สูง
1	2	3	4	5	6	7	8	8+

เสียงปานกลางค่อนข้างต่ำ

ลงทุนในตราสารหนี้ภาคเอกชน โดยอาจมีตราสาร non-investment grade / unrated ไม่เกิน 20 % ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน : ภายใน 3 วันทำการ หลังปิด IPO

นโยบายการจ่ายเงินปันผล : ไม่จ่าย

อายุกองทุน : ประมาณ 1 ปี 6 เดือน

ผู้จัดการกองทุนรวม

1. นายรัฐพล ชัดดียะสูงค์ (ตั้งแต่วันจดทะเบียนกองทุน)
2. นายชวณัฐ ไพศาลวงศ์ดี (ตั้งแต่วันจดทะเบียนกองทุน)

ดัชนีชี้วัด :

ไม่มี เนื่องจากกองทุนมีกลยุทธ์การลงทุนแบบลงทุนครั้งเดียวและถือตราสารจนครบอายุโครงการ (Buy-and-Hold) โดยมีการเปิดเผยข้อมูลเกี่ยวกับประมาณการผลตอบแทนที่ผู้ลงทุนจะได้รับจากการลงทุนในกองทุนนี้ในหนังสือชี้ชวน จึงไม่จำเป็นต้องเปรียบเทียบผลการดำเนินงานของกองทุนกับดัชนีชี้วัด

คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวม มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต
- ผู้ลงทุนไม่สามารถขายคืนหน่วยลงทุนในช่วงระยะเวลา 1 ปี 6 เดือนได้ และกองทุนนี้ลงทุนกระจุกตัวในผู้ออก ดังนั้น หากมีปัจจัยลบที่ส่งผลกระทบต่อการลงทุนดังกล่าว ผู้ลงทุนอาจสูญเสียเงินลงทุนจำนวนมาก

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต : ได้รับการรับรอง CAC จัดอันดับกองทุน Morningstar

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



ผู้ลงทุนสามารถศึกษา เครื่องมือบริหารความเสี่ยง ด้านสภาพคล่อง ได้ใน หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

<https://am.kkpf.com>

การซื้อหน่วยลงทุน

วันทำรายการการซื้อ: เสนอขายหน่วย

ลงทุนครั้งเดียวช่วง IPO

เวลาทำการ: เวลา 8.30 – 16.30 น.

การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ: 1,000 บาท

การซื้อครั้งถัดไปขั้นต่ำ: ไม่กำหนด

การขายคืนหน่วยลงทุน

วันทำรายการขายคืน: รับซื้อคืนหน่วยลงทุน

อัตโนมัติระหว่างอายุโครงการตามที่บริษัทจัดการ

กำหนด และหรือเมื่อครบกำหนดอายุโครงการ

เวลาทำการ: รับซื้อคืนหน่วยลงทุนอัตโนมัติ

การขายคืนขั้นต่ำ: ไม่กำหนด

ยอดคงเหลือขั้นต่ำ: ไม่กำหนด

ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน: ภายใน T+5

หมายเหตุ: ปัจจุบัน T+1 เฉพาะบัญชีรับเงินค่าขายคืนหน่วยลงทุนของ KKP Bank, SCB, BBL, KBank, BAY, TTB, KTB, CIMB Thai, LH Bank, UOB, Citibank และนำฝากเช็ค T+1 สำหรับบัญชีธนาคารอื่นนอกเหนือจากที่ระบุข้างต้น (รายละเอียดอาจมีการเปลี่ยนแปลง))

T = วันที่รับซื้อคืนหน่วยลงทุนอัตโนมัติ โดยไม่นับรวมวันหยุดประเทศไทยและวันหยุดต่างประเทศ ผู้ลงทุนสามารถดูรายละเอียดกำหนดการการซื้อขายของกองทุนเพิ่มเติมได้ที่ <https://am.kkpfng.com>

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	1.6050	
รวมค่าใช้จ่าย	3.7236	

หมายเหตุ: ค่าธรรมเนียมทั้งหมดที่เรียกเก็บจริง ยังไม่รวมค่าใช้จ่ายอื่น ๆ นอกจากนี้ บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ ทั้งนี้ ผู้ลงทุนสามารถดูรายละเอียดค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวมได้ในรายละเอียดโครงการกองทุน บริษัทจัดการจะแจ้งอัตราค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงให้ผู้ถือหน่วยลงทุนทราบในภายหลังจากได้ลงทุนเรียบร้อยแล้ว เนื่องจากบริษัทจัดการจะคำนวณค่าธรรมเนียมการจัดการจากอัตราผลตอบแทนของตราสาร ณ วันที่กองทุนเข้าลงทุน

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การขาย	ไม่มี	ไม่มี
การรับซื้อคืน	ไม่มี	ไม่มี
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า	ไม่มี	ไม่มี
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก	ไม่มี	ไม่มี
การโอนหน่วย	50 บาท ต่อ 1 รายการ	50 บาท ต่อ 1 รายการ

หมายเหตุ: ผู้ลงทุนสามารถดูรายละเอียดค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วยได้ในรายละเอียดโครงการกองทุน

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน

ประเภททรัพย์สิน	% NAV
	N/A

ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก

ชื่อทรัพย์สิน	% NAV
	N/A

ข้อมูลเชิงสถิติ

Maximum Drawdown N/A

Recovering Period N/A

FX Hedging N/A

อัตราส่วนหมุนเวียน
การลงทุน N/A

อายุเฉลี่ยของตราสารหนี้ 1.28 ปี

Yield to Maturity 2.79 %

การจัดสรรการลงทุนในต่างประเทศ

ประเทศ	%NAV
	N/A

การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม / ผู้ออกตราสาร 5 อันดับแรก

ผู้ออกตราสาร	%NAV
	N/A

การจัดสรรการลงทุนตามอันดับความน่าเชื่อถือของตราสาร (%)

อันดับความน่าเชื่อถือ	%NAV
Gov bond/AAA	-
AA	-
A	31.96%
BBB	68.04%
ต่ำกว่า BBB	-
Unrated	-

ตารางประมาณการอัตราผลตอบแทนที่ผู้ลงทุนจะได้รับ

ในกรณีที่มีการนำเงินที่ได้รับจากการเสนอขายหน่วยลงทุนไปลงทุนในทรัพย์สิน และ/หรือ ตราสารตามที่ได้รับไว้ในตารางข้างล่างนี้ ("ทรัพย์สินที่จะลงทุน") ประมาณการผลตอบแทนที่จะได้รับจะเท่ากับ ร้อยละ 1.80 ต่อปี

ทรัพย์สินที่จะลงทุน	อันดับความน่าเชื่อถือของตราสาร/ผู้ออกตราสาร	ประมาณการผลตอบแทนของตราสารต่อปี	สัดส่วนการลงทุนโดยประมาณ	ประมาณการผลตอบแทนที่กองทุนจะได้รับต่อปี
หุ้นกู้ของบริษัท เอเชียเซริมกิจลีสซิ่ง จำกัด (มหาชน)	- / TRIS BBB+	2.71%	24.84%	0.67%
หุ้นกู้บริษัท ภัทรลีสซิ่ง จำกัด (มหาชน)	- / TRIS BBB+	2.41%	24.81%	0.60%
หุ้นกู้ของบริษัท กัลฟ์ เอ็นเนอร์จี ดีเวลลอปเม้นท์ จำกัด (มหาชน)	TRIS A- / TRIS A	1.06%	22.72%	0.24%
หุ้นกู้ของบริษัท เมืองไทย แคปปิตอล จำกัด (มหาชน)	- / TRIS BBB+	1.92%	18.39%	0.35%
หุ้นกู้เพื่ออนุรักษ์สิ่งแวดล้อมของบริษัท บีทีเอส กรุ๊ป โฮลดิ้งส์ จำกัด (มหาชน)	TRIS A / TRIS A	1.03%	4.39%	0.05%
หุ้นกู้ของบริษัท เอ็ชเอ็มซี โปลิเมอส์ จำกัด	FITCH A-(tha) / FITCH A-(tha)	2.71%	3.39%	0.09%
หุ้นกู้ของบริษัท ช.การช่าง จำกัด (มหาชน)	TRIS A- / TRIS A-	1.31%	0.94%	0.01%
หุ้นกู้ของบริษัท เงินดีดล๊อ จำกัด (มหาชน)	TRIS A / TRIS A	1.46%	0.52%	0.01%
รวม			100%	2.02%
ประมาณการค่าใช้จ่ายกองทุน				(0.22%)
ประมาณการผลตอบแทนที่ผู้ถือหน่วยลงทุนจะได้รับโดยเฉลี่ย (ต่อปี)				1.80%
ระยะเวลาการลงทุนโดยประมาณ				1 ปี 6 เดือน

*ตัวเลขสัดส่วนการลงทุนคำนวณโดยมีการปิดจุดศนิยม

อย่างไรก็ตาม ในกรณีที่บริษัทจัดการพิจารณาแล้วเห็นว่ามีการเปลี่ยนแปลงภาวะทางการตลาด หรือมีเหตุการณ์อื่นใดเกิดขึ้น ซึ่งเป็นเหตุอันควรเชื่อว่าอาจเกิดสถานการณ์ที่จะทำให้บริษัทจัดการต้องเปลี่ยนแปลงทรัพย์สินที่ลงทุน หรือที่จะลงทุน และ/หรือสัดส่วนการลงทุนของกองทุนรวม (ซึ่งรวมถึงแต่ไม่จำกัดเฉพาะ มีการเปลี่ยนแปลงหลักเกณฑ์ที่เกี่ยวกับการลงทุนภายในประเทศ และ/หรือ ตามประเทศที่กองทุนรวมลงทุน หรือจะเข้าไปลงทุน) เพื่อรักษาผลประโยชน์ของผู้ลงทุนเป็นสำคัญ บริษัทจัดการจะใช้ดุลพินิจในการเปลี่ยนแปลงทรัพย์สินที่ลงทุน หรือที่จะลงทุน และ/หรือสัดส่วนการลงทุนได้ต่อเมื่อเป็นการดำเนินการภายใต้สถานการณ์ที่จำเป็นและสมควรเพื่อรักษาผลประโยชน์ของผู้ลงทุนเป็นสำคัญ โดยไม่ทำให้ความเสียหายของทรัพย์สินที่ลงทุนเปลี่ยนแปลงไปอย่างมีนัยสำคัญ และในการเปลี่ยนแปลงทรัพย์สินที่ลงทุน หรือที่จะลงทุน และ/หรือสัดส่วนการลงทุนดังกล่าว กรณีที่เป็นทรัพย์สินที่จะลงทุนเพิ่มเติม และ/หรือ แทนที่ จะต้องเป็น ทรัพย์สิน และ/หรือ ตราสารที่ได้รับความเห็นชอบจากคณะกรรมการลงทุนของกองทุนรวม และจะต้องไม่ทำให้ความเสียหายของทรัพย์สินที่ลงทุนเปลี่ยนแปลงไปในทางลบอย่างมีนัยสำคัญ

ทั้งนี้ ผู้ลงทุนรับทราบและตกลงว่า ในกรณีที่มีการเปลี่ยนแปลงทรัพย์สินที่ลงทุน หรือที่จะลงทุน และ/หรือสัดส่วนการลงทุนดังกล่าวอาจทำให้ผู้ลงทุนไม่ได้รับผลตอบแทนตามประมาณการผลตอบแทนที่ได้รับไว้ในข้างต้น

นอกจากนี้ ผู้ลงทุนรับทราบและตกลงว่า (ก) ประมาณการผลตอบแทนของตราสารตามที่ระบุอยู่ในตารางข้างต้นเป็นข้อมูลที่ได้รับจากผู้ออกตราสารหรือผู้เสนอขายตราสาร ณ วันที่ 17 มิถุนายน 2565 ซึ่งผลตอบแทนของตราสารดังกล่าวอาจจะมีการเพิ่มขึ้นหรือลดลงได้ และ (ข) ประมาณการค่าใช้จ่ายของกองทุนรวมตามที่ระบุอยู่ในตารางข้างต้นอาจมีการเปลี่ยนแปลงได้ตามความเหมาะสม แต่ค่าธรรมเนียมหรือค่าใช้จ่ายที่สามารถประมาณการได้ซึ่งเรียกเก็บจากกองทุนรวมทั้งหมดจะต้องไม่เกินอัตราร้อยละ 3.7236 ต่อปี (รวมภาษีมูลค่าเพิ่มแล้ว) ของมูลค่าทรัพย์สิน ณ วันจดทะเบียนกองทรัสต์เป็นกองทุนรวม

ประมาณการผลตอบแทนที่กองทุนจะได้รับ (ต่อปี) คำนวณจากผลตอบแทนที่คาดว่าจะได้รับจากการลงทุนในตราสารหนี้ที่อยู่ในพอร์ตการลงทุนของกองทุนรวม ตั้งแต่วันที่กองทุนรวมลงทุนในตราสารหนี้นั้น จนถึงวันที่มีการจ่ายเงินที่ได้รับจากตราสารหนี้ที่ทยอยครบกำหนดอายุ (maturity) ออกไปให้แก่ผู้ถือหน่วยลงทุนโดยวิธีการรับซื้อคืนหน่วยลงทุนอัตโนมัติ ภายใต้สมมติฐานว่าในช่วงเวลาระหว่างที่ตราสารหนี้ดังกล่าวครบกำหนดอายุจนถึงวันที่มีการรับซื้อคืนหน่วยลงทุนอัตโนมัติ และจะไม่มีมีการนำเงินที่ได้รับไปลงทุนต่อ (reinvest) ในตราสารหนี้อื่นแต่อย่างใด ทั้งนี้ กองทุนอาจนำเงินที่ได้รับนั้นไปลงทุนต่อในทรัพย์สินที่ไม่มีความเสี่ยงด้านความผันผวนทางราคา (market risk) และความเสี่ยงด้านสภาพคล่อง (liquidity risk) ซึ่งอาจทำให้กองทุนได้รับผลตอบแทนเพิ่มเติมจากที่ประเมินไว้

คำอธิบาย

Maximum Drawdown เปอร์เซ็นต์ของผลขาดทุนสูงสุดของกองทุนรวมในระยะเวลา 5 ปีย้อนหลัง (หรือตั้งแต่จัดตั้งกองทุนกรณีที่ยังไม่ครบ 5 ปี) โดยวัดจากระดับ NAV ต่อหน่วยที่จุดสูงสุดไปจนถึงจุดต่ำสุดในช่วงที่ NAV ต่อหน่วยปรับตัวลดลง ค่า Maximum Drawdown เป็นข้อมูลที่จะช่วยให้ทราบถึงความเสี่ยงที่อาจจะขาดทุนจากการลงทุนในกองทุนรวม

Recovering Period ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาดังแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลานานเท่าใด

FX Hedging เปอร์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตกองทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลาหนึ่ง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อหลักทรัพย์กับผลรวมของมูลค่าการขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 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 สูงกว่าจะเป็นกองทุนที่มีประสิทธิภาพในการบริหารจัดการการลงทุนที่ดีกว่า 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 นำมาคิดลดเป็นมูลค่าปัจจุบัน โดยใช้วิธีอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมตราสารหนี้ คำนวณจากค่าเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักของ Yield to Maturity ของตราสารหนี้แต่ละตัวที่กองทุนมีการลงทุน และเนื่องจาก Yield to Maturity มีหน่วยมาตรฐานเป็นเปอร์เซ็นต์ต่อปี จึงสามารถนำไปใช้เปรียบเทียบอัตราผลตอบแทนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีนโยบายถือครองตราสารหนี้จนครบกำหนดอายุและมีลักษณะการลงทุนที่ใกล้เคียงกันได้