

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน เกียรตินาคินภัทร จำกัด

ข้อมูล ณ วันที่ 29 กุมภาพันธ์ 2567

กองทุนเปิดเคเคพี ดราสารหนี้พลัส
KKP FIXED INCOME PLUS FUND

หน่วยลงทุนชนิดทั่วไป
KKP PLUS

ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

กองทุนรวมตราสารหนี้ กองทุนที่ลงทุนแบบมีความเสี่ยงทั้งในและต่างประเทศ
กลุ่มกองทุนรวม : Short Term General Bond

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- กองทุนมีนโยบายลงทุนในตราสารหนี้ภาครัฐ และบริษัทเอกชนที่มีความมั่นคง และให้ผลตอบแทนที่ดี โดยกองทุนจะดำรงอายุถัวเฉลี่ยแบบถ่วงน้ำหนัก (Portfolio Duration) ไม่เกิน 1.5 ปี โดยเฉลี่ยรอบปีบัญชี โดยตราสารหนี้ภาคเอกชน ณ วันที่ลงทุน ต้องได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือ ตั้งแต่ BBB+ ขึ้นไป
- กองทุนอาจลงทุนในต่างประเทศไม่เกินร้อยละ 40 ของ NAV โดยกองทุนจะลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivative) เพื่อป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยนของเงินต้น และอัตราดอกเบี้ยที่คาดว่าจะได้รับ ณ วันที่กองทุนลงทุน ทั้งหมดหรือเกือบทั้งหมด โดยจะป้องกันความเสี่ยงอัตราแลกเปลี่ยนไม่น้อยกว่าร้อยละ 90 ของจำนวนเงินลงทุนในต่างประเทศ
- กองทุนอาจลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivative) เพื่อเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน (Efficient Portfolio Management) เฉพาะที่เป็นตราสารที่มีสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแฝง (Structured Note) ประเภทตราสารหนี้ Callable และตราสารหนี้ Puttable โดยมีการกำหนดผลตอบแทนไว้ อย่างแน่นอน หรือเป็นอัตราที่ผันแปรตามอัตราดอกเบี้ยของ สถาบันการเงินหรืออัตราดอกเบี้ยอื่น และไม่มีกำหนดเงื่อนไขการจ่ายผลตอบแทนที่อ้างอิงกับปัจจัยอ้างอิงอื่นเพิ่มเติม
- กลยุทธ์การลงทุน: มุ่งหวังให้ผลประกอบการสูงกว่าดัชนีชี้วัด (Active Management) (กองทุนสามารถลงทุนในทรัพย์สินอื่นๆ ตามที่ระบุในนโยบายการลงทุนของกองทุน รวมถึงประเภทหลักทรัพย์ ในรายละเอียดโครงการจัดการกองทุนและหนังสือชี้ชวนส่วนข้อมูลโครงการโปรดศึกษารายละเอียดทั้งหมดเพิ่มเติม <https://am.kkpf.com>)

ระดับความเสี่ยง

ต่ำ

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|

 สูง

เสี่ยงปานกลางค่อนข้างต่ำ
ลงทุนในพันธบัตรรัฐบาล และตราสารหนี้เอกชน โดยมีตราสาร non-investment grade / unrated ไม่เกิน 20% ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน : 23 พฤศจิกายน 2547
วันเริ่มต้น class :
นโยบายจ่ายเงินปันผล : ไม่จ่าย
อายุกองทุน : ไม่กำหนด

ผู้จัดการกองทุนรวม

1. นายรัฐพล ชัดดียะสูงศ์ (ตั้งแต่ 1 ก.ย. 63)
2. นายชวณัฐ ไพศาลวงศ์ดี (ตั้งแต่ 1 ส.ค. 61)

ดัชนีชี้วัด :

- (1) 30% ผลตอบแทนรวมของดัชนีพันธบัตรรัฐบาลระยะสั้นของสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย
- (2) 35% ดัชนีผลตอบแทนรวมตราสารหนี้ภาคเอกชนระยะสั้น (ThaiBMA Commercial Paper Index) ที่มีอันดับความน่าเชื่อถือของผู้ออกตราสารอยู่ในระดับ A- ขึ้นไป ของสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย
- (3) 5% ผลตอบแทนรวมสุทธิของดัชนีตราสารหนี้ภาคเอกชน Mark-to-Market ที่มีอันดับความน่าเชื่อถือของผู้ออกตราสารอยู่ในระดับ BBB+ ขึ้นไป อายุ 1 - 3 ปี ของสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย
- (4) 10% อัตราดอกเบี้ยเงินฝากประจำ 3 เดือน วงเงินน้อยกว่า 5 ล้านบาท เฉลี่ยของ 3 ธนาคารพาณิชย์ขนาดใหญ่ ได้แก่ ธนาคารกรุงเทพ ธนาคารกสิกรไทย และธนาคารไทยพาณิชย์ หลังหักภาษี
- (5) 20% ของ Overnight Indexed Swap (OIS) 3 เดือน หลังหักภาษี ปรับด้วยต้นทุนการป้องกันความเสี่ยงด้านอัตราแลกเปลี่ยนเพื่อคำนวณผลตอบแทนเป็นสกุลเงินบาท วันที่ คำนวณผลตอบแทน

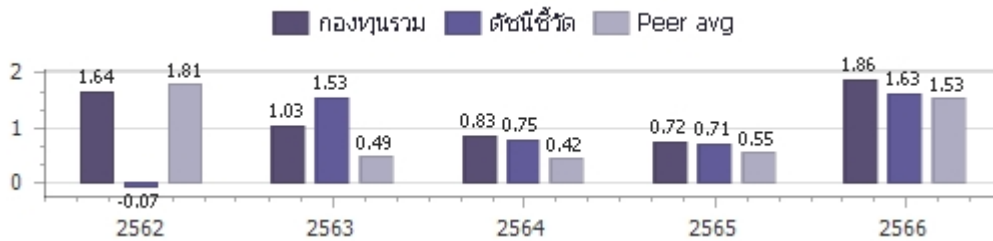
คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวม มิได้เป็นสัญญาณถึงผลการดำเนินงานในอนาคต โปรดศึกษาคำเตือนที่สำคัญอื่นในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต : ได้รับการรับรอง CAC

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน 1,2,3 (%ต่อปี)

(ข้อมูล ณ วันที่ 29 กุมภาพันธ์ 2567)



ผลการดำเนินการย้อนหลังแบบปีกumul 1,4 (%)

| | Year to Date | 3 เดือน | 6 เดือน | 1 ปี ⁴ |
|--------------------------|-------------------|-------------------|--------------------|-----------------------------------|
| กองทุนรวม | 0.46% | 0.65% | 1.24% | 2.11% |
| ตัวชี้วัด | 0.40% | 0.56% | 1.08% | 1.89% |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน | 0.43% | 0.63% | 1.16% | 1.81% |
| ความผันผวนของกองทุน | 0.11% | 0.13% | 0.12% | 0.10% |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด | 0.09% | 0.10% | 0.10% | 0.10% |
| | 3 ปี ⁴ | 5 ปี ⁴ | 10 ปี ⁴ | ตั้งแต่จัดตั้งกองทุน ⁴ |
| กองทุนรวม | 1.24% | 1.26% | 1.44% | 1.96% |
| ตัวชี้วัด | 1.13% | 1.13% | 1.57% | 2.54% |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน | 0.97% | 0.96% | 1.22% | N/A |
| ความผันผวนของกองทุน | 0.09% | 0.09% | 0.11% | 0.17% |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด | 0.09% | 0.66% | 1.31% | 1.53% |

1. เอกสารการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวมฉบับนี้ ได้จัดทำตามมาตรฐานการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวมของสมาคมบริษัทจัดการลงทุน
2. หากกองทุนรวมมีผลการดำเนินงานตั้งแต่วันที่จดทะเบียนทรัพย์สินกองทุนรวมหรือวันที่เปิดเสนอขายชนิดหน่วยลงทุนไม่ครบ 1 ปีปฏิทิน จะแสดงผลการดำเนินงานของปีปฏิทินแรกตั้งแต่วันที่กองทุนรวมจดทะเบียนทรัพย์สินกองทุนรวมหรือวันที่เปิดเสนอขายชนิดหน่วยลงทุนจนถึงวันที่ทำการสุดท้ายของปีปฏิทินแรก
3. หากกองทุนรวมมีผลการดำเนินงานในปีที่เล็กกองทุนไม่ครบ 1 ปีปฏิทิน จะแสดงผลการดำเนินงานของปีปฏิทินสุดท้ายตั้งแต่วันที่ทำการสุดท้ายของปีปฏิทินก่อนหน้าจนถึงวันที่เล็กกองทุน
4. % ต่อปี

จัดอันดับกองทุน Morningstar
Morningstar Rating Overall จาก MorningStar ประเภท Thailand Fund Short Term Bond



ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือบริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่องได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



<https://am.kkpf.com>

การซื้อขายหน่วยลงทุน

วันทำการซื้อ : ทุกวันทำการ
 เวลาทำการ : 8:30 - 16:00 น.
 การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ : 1,000 บาท
 การซื้อครั้งถัดไปขั้นต่ำ : 1,000 บาท

การขายคืนหน่วยลงทุน

วันทำการขายคืน : ทุกวันทำการ
 เวลาทำการ : 8:30 - 15:30 น.
 การขายคืนขั้นต่ำ : ไม่กำหนด
 ยอดคงเหลือขั้นต่ำ : 100 บาท / 10 หน่วย
 ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน : ภายใน 3 วันทำการ¹ (ปัจจุบัน T+1)²

ข้อมูลเชิงสถิติ

(ข้อมูล ณ วันที่ 29 กุมภาพันธ์ 2567)

Maximum Drawdown : -0.08%
FX Hedging : 100.12%
Recovering Period : 27 วัน
อายุเฉลี่ยของตราสารหนี้ : 3 เดือน 30 วัน
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน : 1.86 เท่า
Yield to Maturity : 1.88%

หมายเหตุ ¹ ถัดจากวันที่ส่งขายคืนหน่วยลงทุน

² ปัจจุบัน T+1 เฉพาะบัญชีรับเงินค่าขายคืนหน่วยลงทุนของ KKP Bank, SCB, BBL, KBank, BAY, TTB, KTB, CIMB Thai, LH Bank, UOB, Citibank และนำฝาก/นำส่งเช็ค T+1 สำหรับบัญชีธนาคารอื่นนอกเหนือจากที่ระบุข้างต้น (รายละเอียดอาจมีการเปลี่ยนแปลง)

T = วันทำการซื้อขาย

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (%ต่อปี ของ NAV)

(ข้อมูล ณ วันที่ 29 กุมภาพันธ์ 2567)

| ค่าธรรมเนียม | สูงสุดไม่เกิน | เก็บจริง |
|---------------|---------------|----------|
| การจัดการ | 0.3000 % | 0.2354 % |
| รวมค่าใช้จ่าย | 0.4922 % | 0.3170 % |

หมายเหตุ 1. ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว

2. ค่าใช้จ่ายรวมที่เรียกเก็บจริง เป็นข้อมูลของรอบระยะเวลาบัญชี วันที่ 1 พ.ย. 65 - 31 ต.ค. 66

3. ผู้ลงทุนสามารถดูข้อมูลค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวมย้อนหลัง 3 ปี

ในหนังสือชี้ชวนส่วนข้อมูลกองทุน ได้ที่ <https://am.kkpf.com>

4. บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (%ต่อปี ของมูลค่าซื้อขาย)

(ข้อมูล ณ วันที่ 29 กุมภาพันธ์ 2567)

| ค่าธรรมเนียม | สูงสุดไม่เกิน | เก็บจริง |
|-----------------------------|---------------------|---------------------|
| การขาย | ไม่มี | ไม่มี |
| การรับซื้อคืน | ไม่มี | ไม่มี |
| การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า | ไม่มี | ไม่มี |
| การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก | ไม่มี | ไม่มี |
| การโอนหน่วย | 20 บาท ต่อ 1 รายการ | 20 บาท ต่อ 1 รายการ |

หมายเหตุ 1. ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว

2. บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ

* Yield to Maturity(YTM) อัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในตราสารหนี้ คำนวณจากดอกเบี้ยที่ได้รับจริง โดยมีได้ปรับสัดส่วนเครื่องมือป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยนซึ่งอาจทำให้ผลตอบแทนจริงลดลง/หรือ เพิ่มขึ้นจาก YTM ในรูปสกุลเงินบาทได้

* FX hedging สามารถมากกว่า 100% หากมีการทำสัญญาซื้อขายล่วงหน้า เพื่อป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน ของดอกเบี้ยที่จะได้รับ

การจัดสรรการลงทุนในต่างประเทศ

(ข้อมูล ณ วันที่ 29 กุมภาพันธ์ 2567)

| ประเทศ | %NAV |
|--------|-------|
| QATAR | 25.86 |
| JAPAN | 7.51 |

ผู้ออกตราสาร 5 อันดับแรก

(ข้อมูล ณ วันที่ 29 กุมภาพันธ์ 2567)

| ผู้ออก | %NAV |
|-----------------------------------------|-------|
| ธนาคารแห่งประเทศไทย | 25.16 |
| Doha Bank Q.P.S.C. | 15.18 |
| Government of Japan | 11.06 |
| QATAR NATIONAL BANK | 10.68 |
| บริษัท เจริญโภคภัณฑ์อาหาร จำกัด (มหาชน) | 4.80 |

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน

(ข้อมูล ณ วันที่ 29 กุมภาพันธ์ 2567)

| ประเภททรัพย์สิน | %NAV |
|-----------------------------------------------------------------|-------|
| พันธบัตร,ตัวเงินคลัง | 36.24 |
| เงินฝาก,มัดเงินฝาก | 25.86 |
| ตัวแลกเงิน | 23.38 |
| หุ้นกู้ | 14.48 |
| สัญญาซื้อขายล่วงหน้า | 0.27 |
| ตราสารด้อยสิทธิเพื่อนับเป็นเงินกองทุนของธนาคารพาณิชย์ประเภทที่2 | 0.08 |
| Callable Bonds/Puttable Bonds | 0.01 |
| สินทรัพย์และหนี้สินอื่น | -0.32 |

ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก

(ข้อมูล ณ วันที่ 29 กุมภาพันธ์ 2567)

| ชื่อทรัพย์สิน | %NAV |
|----------------------------------------------|------|
| พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย (CBF24513A) | 4.14 |
| JAPAN TREASURY DISC BILL (JP1742061Q17) | 3.56 |
| พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย (CBF24916A) | 2.86 |
| พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย (CBF24708A) | 2.79 |
| TERM DEPOSIT QATAR NATIONAL BANK (QNB24311A) | 2.77 |

การจัดสรรการลงทุนตามอันดับความน่าเชื่อถือ (%)

(ข้อมูล ณ วันที่ 29 กุมภาพันธ์ 2567)

| | ในประเทศ | national | international |
|-------------|----------|----------|---------------|
| GOV/AAA | 26.05 | 0.00 | 0.00 |
| AA | 5.76 | 1.11 | 0.00 |
| A | 23.73 | 0.00 | 21.74 |
| BBB | 6.48 | 0.00 | 15.18 |
| ต่ำกว่า BBB | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| unrated | 0.00 | 0.00 | 0.00 |

หมายเหตุ:ในการเปลี่ยนแปลงมูลค่าขั้นต่ำของการสั่งซื้อครั้งถัดไป บริษัทจัดการจะคำนึงถึงประโยชน์ของผู้ถือหน่วยลงทุนเป็นสำคัญ โดยบริษัทจัดการจะประกาศการเปลี่ยนแปลง และแจ้งให้ผู้ถือหน่วยลงทุนทราบล่วงหน้าอย่างชัดเจนถึงวันที่มีการเปลี่ยนแปลงมูลค่าขั้นต่ำของการสั่งซื้อ ครั้งถัดไป ค่าอธิบายเกี่ยวกับการเปลี่ยนแปลงและเหตุผลในการเปลี่ยนแปลงข้อมูลดังกล่าว ผ่านเว็บไซต์ของบริษัทจัดการ ภายในระยะเวลาที่ผู้ถือหน่วยลงทุนสามารถใช้ประโยชน์จากข้อมูลในการตัดสินใจลงทุนได้

คำอธิบาย

Maximum Drawdown เปรอ์เซ็นต์ผลขาดทุนสูงสุดของกองทุนรวมในระยะเวลา 5 ปีย้อนหลัง (หรือตั้งแต่จัดตั้งกองทุนกรณีที่ยังไม่ครบ 5 ปี) โดยวัดจากระดับ NAV ต่อหน่วยที่จุดสูงสุดไปจนถึงจุดต่ำสุดในช่วงที่ NAV ต่อหน่วยปรับตัวลดลง ค่า Maximum Drawdown เป็นข้อมูลที่ช่วยให้ทราบถึงความเสี่ยงที่อาจจะขาดทุนจากการลงทุนในกองทุนรวม

Recovering Period ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาดังแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลา นานเท่าใด

FX Hedging เปรอ์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลาหนึ่ง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่า การซื้อหลักทรัพย์กับผลรวมของมูลค่าการขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 1 ปีหารด้วยมูลค่า NAV ของกองทุนรวมเฉลี่ยในรอบระยะเวลาเดียวกัน กองทุนรวมที่มีค่า portfolio turnover สูง บ่งชี้ถึงการซื้อขายหลักทรัพย์บ่อยครั้งของผู้จัดการกองทุนและทำให้มีต้นทุนการซื้อขายหลักทรัพย์ที่สูง จึงต้องพิจารณา เปรียบเทียบกับผลการดำเนินงานของกองทุนรวมเพื่อประเมินความคุ้มค่าของการซื้อขายหลักทรัพย์ดังกล่าว

Sharpe Ratio อัตราส่วนระหว่างผลตอบแทนส่วนเพิ่มของกองทุนรวมเปรียบเทียบกับความเสี่ยงจากการลงทุน โดยคำนวณจากผลต่างระหว่างอัตราผลตอบแทนของ กองทุนรวมกับอัตราผลตอบแทนที่ปราศจากความเสี่ยง (risk-free rate) เปรียบเทียบกับค่าเบี่ยงเบนมาตรฐาน (standard deviation) ของกองทุนรวม ค่า Sharpe Ratio สะท้อนถึงอัตราผลตอบแทนที่กองทุนรวมควรได้รับเพิ่มขึ้นเพื่อชดเชยกับความเสี่ยงที่กองทุนรวมรับมา โดยกองทุนรวมที่มีค่า Sharpe Ratio สูงกว่าจะเป็นกองทุนที่มีประสิทธิภาพในการบริหารจัดการลงทุนที่ดีกว่า เนื่องจากได้รับผลตอบแทนส่วนเพิ่มที่สูงกว่าภายใต้ระดับความเสี่ยงเดียวกัน

Alpha ผลตอบแทนส่วนเกินของกองทุนรวมเมื่อเปรียบเทียบกับดัชนีชี้วัด (benchmark) โดยค่า Alpha ที่สูง หมายถึง กองทุนสามารถสร้างผลตอบแทนได้สูงกว่าดัชนีชี้วัด ซึ่งเป็นผลจากประสิทธิภาพของผู้จัดการกองทุนในการคัดเลือกหรือหาจังหวะการลงทุนในหลักทรัพย์ได้อย่างเหมาะสม

Beta ระดับและทิศทางของการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุน โดยเปรียบเทียบกับอัตราการเปลี่ยนแปลงของตลาด Beta น้อยกว่า 1 แสดงว่า หลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนน้อยกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด Beta มากกว่า 1 แสดงว่า หลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนมากกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด

Tracking Error อัตราผลตอบแทนของกองทุนมีประสิทธิภาพในการเลียนแบบดัชนีชี้วัด โดยหาก tracking error ต่ำ หมายถึง กองทุนรวมมีประสิทธิภาพในการ สร้างผลตอบแทนให้ใกล้เคียงกับดัชนีชี้วัด กองทุนรวมที่มีค่า tracking error สูง จะมีอัตราผลตอบแทนโดยเฉลี่ยห่างจากดัชนีชี้วัดมากขึ้น

Yield to Maturity อัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในตราสารหนี้โดยถือจนครบกำหนดอายุ ซึ่งคำนวณจากดอกเบี้ยที่จะได้รับในอนาคต ตลอดอายุตราสารและเงินต้น ที่จะได้รับคืน นำมาคิดลดเป็นมูลค่าปัจจุบัน โดยใช้วิธีอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมตราสารหนี้ คำนวณจากค่าเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักของ Yield to Maturity ของ ตราสารหนี้แต่ละตัวที่กองทุนมีการลงทุน และเนื่องจาก Yield to Maturity มีหน่วยมาตรฐานเป็นเปอร์เซ็นต์ต่อปี จึงสามารถนำไปใช้เปรียบเทียบอัตราผลตอบแทน ระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีนโยบายถือครองตราสารหนี้จนครบกำหนดอายุและมีลักษณะการลงทุนที่ใกล้เคียงกันได้

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน เกียรตินาคินภัทร จำกัด

โทรศัพท์ (66) 2305 9800 โทรสาร (66) 2305 9803-4 website : <https://am.kkpf.com>

ที่อยู่ : 209 อาคารเคเคพี ทาวเวอร์ เอ ชั้นที่ 17 ถนนสุขุมวิท 21 (อโศก)

แขวงคลองเตยเหนือ เขตวัฒนา กรุงเทพมหานคร 10110

คำเตือน/ข้อแนะนำ

- กรณีลงทุนในต่างประเทศ กองทุนนี้อาจมีความเสี่ยงที่ทางการของต่างประเทศอาจออกมาตรการในภาวะที่เกิดวิกฤตการณ์ที่ไม่ปกติ ทำให้กองทุนไม่สามารถนำเงินกลับเข้ามาในประเทศไทย ซึ่งอาจส่งผลให้ผู้ลงทุนไม่ได้รับคืนเงินตามระยะเวลาที่กำหนด
- กรณีลงทุนในต่างประเทศ กองทุนนี้มีความเสี่ยงจากการเปลี่ยนแปลงในเรื่องเศรษฐกิจ การเมือง และสังคมของประเทศที่กองทุนไปลงทุน กองทุนอาจลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งสัญญาซื้อขายล่วงหน้า และ/หรือ ตราสารที่มีสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแฝง กองทุนอาจมีความเสี่ยงมากกว่ากองทุนรวมที่ลงทุนในหลักทรัพย์อ้างอิงโดยตรง เนื่องจากใช้เงินลงทุนในจำนวนที่น้อยกว่าจึงมีกำไร/ขาดทุนสูงกว่าการลงทุนในหลักทรัพย์อ้างอิงโดยตรง
- ในกรณีที่กองทุนรวมลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า เพื่อการลดความเสี่ยงโดยสินค้าหรือตัวแปรของสัญญาซื้อขายล่วงหน้า นั้นไม่ใช่สิ่งเดียวกับทรัพย์สินที่ต้องการลดความเสี่ยง บริษัทจัดการจะใช้ข้อมูลในอดีตในการคำนวณค่าสัมบูรณ์ของค่าสัมประสิทธิ์สหสัมพันธ์ (absolute correlation coefficient) กองทุนรวมจึงมีความเสี่ยง หากสินค้าหรือตัวแปรที่สัญญาซื้อขายล่วงหน้าอ้างอิง (underlying) และทรัพย์สินที่ต้องการลดความเสี่ยงเคลื่อนไหวในทิศทางที่ไม่เป็นไปตามข้อมูลในอดีต ซึ่งอาจส่งผลให้การเข้าทำสัญญาซื้อขายล่วงหน้าไม่สามารถลดความเสี่ยงได้อย่างเต็มประสิทธิภาพ
- การลงทุนในหน่วยลงทุนมิใช่การฝากเงิน และมีความเสี่ยงของการลงทุน ผู้ลงทุนควรลงทุนในกองทุนเปิดเคเคพี ตราสารหนี้พลัส เมื่อเห็นว่าการลงทุนในกองทุนเปิดนี้เหมาะสมกับวัตถุประสงค์การลงทุนของผู้ลงทุน และผู้ลงทุนยอมรับความเสี่ยงที่อาจเกิดขึ้นจากการลงทุนได้
- ในกรณีหากกองทุนเปิดเคเคพี ตราสารหนี้พลัส มีการลงทุนในต่างประเทศ กองทุนจะทำการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยนทั้งหมด/หรือเกือบทั้งหมด
- การลงทุนมีความเสี่ยง ผู้ลงทุนควรทำความเข้าใจลักษณะสินค้า เงื่อนไขผลตอบแทน และความเสี่ยงก่อนตัดสินใจลงทุน

เครื่องมือบริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่อง

ผู้ลงทุนสามารถศึกษารายละเอียด หลักเกณฑ์ และเงื่อนไขการใช้งานของแต่ละเครื่องมือบริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่องได้ในรายละเอียดโครงการ และหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม ที่ <https://am.kkpfpg.com>

กลุ่มเครื่องมือที่ส่งผ่านภาระค่าใช้จ่ายให้ผู้ลงทุน

1. ค่าธรรมเนียมการรักษาสภาพคล่อง (Liquidity Fee)

เครื่องมือที่สะท้อนต้นทุนของกองทุนที่เกิดขึ้นในภาวะที่ตลาดมีความผันผวนสูงหรือมีการขายคืนหน่วยลงทุนหรือมีการสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออกของกองทุนนั้น ๆ สูงเกินกว่าปกติ โดยจะเรียกเก็บค่าธรรมเนียมเฉพาะ "ผู้ขาย" หรือผู้สับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออกในจำนวนที่เกินกว่าปริมาณและ/หรือ ก่อนระยะเวลาที่กำหนด และเป็น การเรียกเก็บเข้ากองทุน

2. การปรับมูลค่าทรัพย์สินสุทธิด้วยสูตรการคำนวณที่สะท้อนต้นทุนในการซื้อขายทรัพย์สินของกองทุนรวม (Swing Pricing)

เครื่องมือใช้ปรับมูลค่าหน่วยลงทุน เพื่อให้สะท้อนต้นทุนการซื้อขายของกองทุนในภาวะที่ตลาดมีความผันผวน โดยเพิ่มตัวแปร (Swing Factor) ที่ช่วยสะท้อนต้นทุนค่าใช้จ่ายและใช้ตัวแปรนั้นช่วยในการปรับมูลค่าหน่วยลงทุน นอกจากนี้ กองทุนอาจเลือกใช้ Swing Pricing เฉพาะช่วงเวลาที่มีการซื้อขายสุทธิเกินกว่าที่กำหนดไว้ (Partial swing pricing) หรือสามารถใช้ทุกวันในช่วงที่ตลาดมีความผันผวน (Full swing pricing) ขึ้นอยู่กับการกำหนดเงื่อนไขในการใช้เครื่องมือตามลักษณะและสินทรัพย์หรือต้นทุนที่เกิดขึ้นกับกองทุนรวม นั้น ๆ

3. การเพิ่มค่าธรรมเนียมการซื้อขายหน่วยลงทุนที่สะท้อนต้นทุนในการซื้อขายทรัพย์สินของกองทุนรวม (Anti-Dilution Levies - ADLs)

เครื่องมือที่ทำให้การซื้อขายหน่วยลงทุนสะท้อนต้นทุนที่เกี่ยวข้องจากการปรับพอร์ตของกองทุน ในภาวะตลาดผันผวนสูงผิดปกติหรือสภาพคล่องผิดปกติ หรือเกิดเหตุการณ์อื่นที่อาจจะกระทบต่อต้นทุนและค่าใช้จ่ายของกองทุนรวม โดยกองทุนจะกำหนดมูลค่าซื้อขายสุทธิเป็นเกณฑ์ของเครื่องมือ ถ้ามีการซื้อขายหรือสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเกินกว่าระดับที่กำหนด กองทุนจะมีการเรียกเก็บค่าธรรมเนียมเพิ่มเติมเข้ากองทุน และการคิดค่าธรรมเนียมอาจเกิดขึ้นได้ทั้งจากผู้ซื้อ/สับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า หรือจาก ผู้ขาย/สับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออกก็ได้ ซึ่งขึ้นอยู่กับปริมาณธุรกรรมที่เกิดขึ้นตามเงื่อนไขที่ บลจ. กำหนด

กลุ่มเครื่องมือที่จำกัดคำสั่งรับซื้อคืนหน่วยลงทุน

4. ระยะเวลาที่ต้องแจ้งล่วงหน้าก่อนการขายคืนหน่วยลงทุน (Notice Period)

เครื่องมือที่จะกำหนดระยะเวลาในการส่งคำสั่งเพื่อทำการขายคืนหรือสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออกไว้ล่วงหน้าหากผู้ถือหน่วยทำการที่เกินกว่าปริมาณที่กำหนด เพื่อให้กองทุนมีเวลาในการเตรียมขายสินทรัพย์เพื่อมาชำระค่าขายคืนหน่วยลงทุน

5. เพดานการขายคืนหน่วยลงทุน (Redemption Gate)

เป็นเครื่องมือที่กำหนดเพดานมูลค่าที่จะให้ผู้ถือหน่วยลงทุนขายคืนหน่วยลงทุนหรือสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออกได้ในแต่ละกองทุน เมื่อเกิดสถานการณ์ไม่ปกติ หรือ ประเมินว่าสถานการณ์อาจจะไม่ปกติ โดย บลจ. จะใช้วิธีการชำระคืนตามสัดส่วน หรือที่เรียกว่า Pro rata สำหรับคำสั่งขายคืนหน่วยลงทุนหรือสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออกที่เหลือ จะทำการขายคืนให้ในวันทำการถัดไป หากวันทำการถัดไป บลจ. ยังคงใช้เครื่องมือนี้ บลจ. จะชำระคืนตามวิธี Pro rata โดยไม่มีการจัดลำดับก่อนหลัง แต่หากวันทำการถัดไปกองทุนมีสภาพคล่องเพียงพอ ทำให้ บลจ. ไม่ต้องใช้เครื่องมือนี้ บลจ. จะชำระคืนตามรายการขายคืนหน่วยลงทุนหรือสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออกที่ได้รับไว้ทั้งหมด

6. การดำเนินการในกรณีที่ผู้ออกตราสารหนี้หรือลูกหนี้ตามสิทธิเรียกร้องผิดนัดชำระหนี้ หรือตราสารที่ลงทุนประสบปัญหาขาดสภาพคล่องหรือไม่สามารถจำหน่ายได้ด้วยราคาที่เหมาะสมผล (Side Pocket)

เครื่องมือที่ทำให้กองทุนรวมสามารถแยกสินทรัพย์ที่มีปัญหา ด้านสภาพคล่อง ออกจากทรัพย์สินโดยรวมของกองทุน โดยในวันที่ บลจ. ดำเนินการแยกทรัพย์สินดังกล่าว บลจ. จะทำทะเบียนผู้ถือหน่วยลงทุน ณ วันทำการนั้น เพื่อใช้เป็นข้อมูลสำหรับการคืนเงินที่ บลจ. อาจได้รับจากทรัพย์สินที่ติดปัญหาด้านสภาพคล่องข้างต้นในอนาคต

7. การไม่ขายหรือไม่รับซื้อคืนหน่วยลงทุนตามคำสั่งที่รับไว้หรือจะหยุดรับคำสั่งซื้อหรือคำสั่งขายคืนหน่วยลงทุน (Suspension of dealings)

การระงับการซื้อขายหน่วยลงทุนเป็นการชั่วคราวเพื่อลดผลกระทบต่อการบริหารสภาพคล่องของกองทุน และโดยเฉพาะเพื่อป้องกันไม่ให้เกิดปัญหารุนแรงมากขึ้นจนถึงขั้นปิดกอง จัดเป็นเครื่องมือที่มีผลกระทบสูง การใช้เครื่องมือถูกควบคุมดูแลจากสำนักงาน ก.ล.ด. เงื่อนไขของการนำมาใช้จะต้องคำนึงถึงประโยชน์โดยรวมของผู้ถือหน่วยลงทุน

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน เกียรตินาคินภัทร จำกัด

ข้อมูล ณ วันที่ 29 กุมภาพันธ์ 2567

กองทุนเปิดเคเคพี ดราสารหนี้พลัส
KKP FIXED INCOME PLUS FUND

หน่วยลงทุนชนิด F
KKP PLUS-F

ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

กองทุนรวมตราสารหนี้ กองทุนที่ลงทุนแบบมีความเสี่ยงทั้งในและต่างประเทศ
กลุ่มกองทุนรวม : Short Term General Bond

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- กองทุนมีนโยบายลงทุนในตราสารหนี้ภาครัฐ และบริษัทเอกชนที่มีความมั่นคง และให้ผลตอบแทนที่ดี โดยกองทุนจะดำรงอายุถัวเฉลี่ยแบบถ่วงน้ำหนัก (Portfolio Duration) ไม่เกิน 1.5 ปี โดยเฉลี่ยรอบปีบัญชี โดยตราสารหนี้ภาคเอกชน ณ วันที่ลงทุน ต้องได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือ ตั้งแต่ BBB+ ขึ้นไป
- กองทุนอาจลงทุนในต่างประเทศไม่เกินร้อยละ 40 ของ NAV โดยกองทุนจะลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivative) เพื่อป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยนของเงินต้น และอัตราดอกเบี้ยที่คาดว่าจะได้รับ ณ วันที่กองทุนลงทุน ทั้งหมดหรือเกือบทั้งหมด โดยจะป้องกันความเสี่ยงอัตราแลกเปลี่ยนไม่น้อยกว่าร้อยละ 90 ของจำนวนเงินลงทุนในต่างประเทศ
- กองทุนอาจลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivative) เพื่อเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน (Efficient Portfolio Management) เฉพาะที่เป็นตราสารที่มีสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแฝง (Structured Note) ประเภทตราสารหนี้ Callable และตราสารหนี้ Puttable โดยมีการกำหนดผลตอบแทนไว้ อย่างแน่นอน หรือเป็นอัตราที่ผันแปรตามอัตราดอกเบี้ยของ สถาบันการเงินหรืออัตราดอกเบี้ยอื่น และไม่มีการกำหนดเงื่อนไขการจ่ายผลตอบแทนที่อ้างอิงกับปัจจัยอ้างอิงอื่นเพิ่มเติม
- กลยุทธ์การลงทุน: มุ่งหวังให้ผลประกอบการสูงกว่าดัชนีชี้วัด (Active Management) (กองทุนสามารถลงทุนในทรัพย์สินอื่นๆ ตามที่ระบุในนโยบายการลงทุนของกองทุน รวมถึงประเภทหลักทรัพย์ ในรายละเอียดโครงการจัดการกองทุนและหนังสือชี้ชวนส่วนข้อมูลโครงการโปรดศึกษารายละเอียดทั้งหมดเพิ่มเติม <https://am.kkpf.com>)

ระดับความเสี่ยง

| | | | | | | | | | |
|-----|---|---|---|---|---|---|---|---|-----|
| ต่ำ | 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | สูง |
|-----|---|---|---|---|---|---|---|---|-----|

เสี่ยงปานกลางค่อนข้างต่ำ
ลงทุนในพันธบัตรรัฐบาล และตราสารหนี้เอกชน โดยมีตราสาร non-investment grade / unrated ไม่เกิน 20% ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม

- วันจดทะเบียนกองทุน : 23 พฤศจิกายน 2547
- วันเริ่มต้น class : 6 มีนาคม 2562
- นโยบายจ่ายเงินปันผล : ไม่จ่าย
- อายุกองทุน : ไม่กำหนด

ผู้จัดการกองทุนรวม

- นายรัฐพล ชัดดียะสูงศ์ (ตั้งแต่ 1 ก.ย. 63)
- นายชวณัฐ ไพศาลวงศ์ดี (ตั้งแต่ 1 ส.ค. 61)

ดัชนีชี้วัด :

- (1) 30% ผลตอบแทนรวมของดัชนีพันธบัตรรัฐบาลระยะสั้นของสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย
- (2) 35% ดัชนีผลตอบแทนรวมตราสารหนี้ภาคเอกชนระยะสั้น (ThaiBMA Commercial Paper Index) ที่มีอันดับความน่าเชื่อถือของผู้ออกตราสารอยู่ในระดับ A- ขึ้นไป ของสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย
- (3) 5% ผลตอบแทนรวมสุทธิของดัชนีตราสารหนี้ภาคเอกชน Mark-to-Market ที่มีอันดับความน่าเชื่อถือของผู้ออกตราสารอยู่ในระดับ BBB+ ขึ้นไป อายุ 1 - 3 ปี ของสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย
- (4) 10% อัตราดอกเบี้ยเงินฝากประจำ 3 เดือน วงเงินน้อยกว่า 5 ล้านบาท เฉลี่ยของ 3 ธนาคารพาณิชย์ขนาดใหญ่ ได้แก่ ธนาคารกรุงเทพ ธนาคารกสิกรไทย และธนาคารไทยพาณิชย์ หลังหักภาษี
- (5) 20% ของ Overnight Indexed Swap (OIS) 3 เดือน หลังหักภาษี ปรับด้วยต้นทุนการป้องกันความเสี่ยงด้านอัตราแลกเปลี่ยนเพื่อคำนวณผลตอบแทนเป็นสกุลเงินบาท ณ วันที่ คำนวณผลตอบแทน

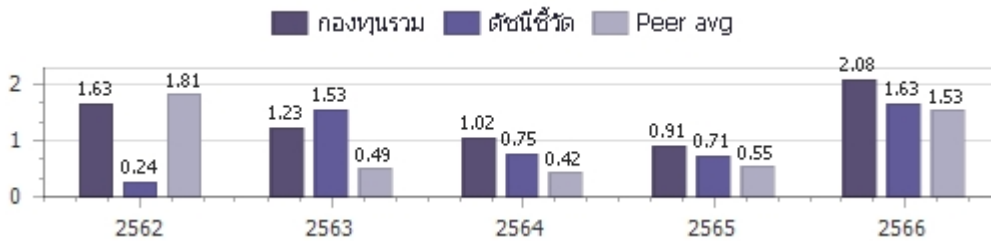
คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวม มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต โปรดศึกษาค่าเดือนที่สำคัญอื่นในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต : ได้รับการรับรอง CAC

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน 1,2,3 (%ต่อปี)

(ข้อมูล ณ วันที่ 29 กุมภาพันธ์ 2567)



ผลการดำเนินการย้อนหลังแบบปีทั้งหมด 1,4 (%)

| | Year to Date | 3 เดือน | 6 เดือน | 1 ปี ⁴ |
|--------------------------|--------------|-------------------|-------------------|--------------------|
| กองทุนรวม | 0.50% | 0.71% | 1.36% | 2.34% |
| ตัวชี้วัด | 0.40% | 0.56% | 1.08% | 1.89% |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน | 0.43% | 0.63% | 1.16% | 1.81% |
| ความผันผวนของกองทุน | 0.12% | 0.14% | 0.13% | 0.11% |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด | 0.09% | 0.10% | 0.10% | 0.10% |
| | | 3 ปี ⁴ | 5 ปี ⁴ | 10 ปี ⁴ |
| กองทุนรวม | 1.44% | | | 1.47% |
| ตัวชี้วัด | 1.13% | | | 1.05% |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน | 0.97% | | | N/A |
| ความผันผวนของกองทุน | 0.10% | | | 0.10% |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด | 0.09% | | | 0.65% |

1. เอกสารการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวมฉบับนี้ ได้จัดทำตามมาตรฐานการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวมของสมาคมบริษัทจัดการลงทุน
2. หากกองทุนรวมมีผลการดำเนินงานตั้งแต่วันที่จดทะเบียนทรัพย์สินกองทุนรวมหรือวันที่เปิดเสนอขายชนิดหน่วยลงทุนไม่ครบ 1 ปีปฏิทิน จะแสดงผลการดำเนินงานของปีปฏิทินแรกตั้งแต่วันที่กองทุนรวมจดทะเบียนทรัพย์สินกองทุนรวมหรือวันที่เปิดเสนอขายชนิดหน่วยลงทุนจนถึงวันที่ทำการสุดท้ายของปีปฏิทินแรก
3. หากกองทุนรวมมีผลการดำเนินงานในปีที่เล็กกองทุนไม่ครบ 1 ปีปฏิทิน จะแสดงผลการดำเนินงานของปีปฏิทินสุดท้ายตั้งแต่วันที่ทำการสุดท้ายของปีปฏิทินก่อนหน้าจนถึงวันที่เล็กกองทุน
4. % ต่อปี

จัดอันดับกองทุน Morningstar
Morningstar Rating Overall จาก MorningStar ประเภท Thailand Fund Short Term Bond



ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือบริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่องได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



<https://am.kkpf.com>

| การซื้อขายหน่วยลงทุน | | การขายคืนหน่วยลงทุน | | ข้อมูลเชิงสถิติ (ข้อมูล ณ วันที่ 29 กุมภาพันธ์ 2567) | |
|--------------------------|-------------------|-----------------------------|-------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|----------------|
| วันทำการซื้อ | : ทุกวันทำการ | วันทำการขายคืน | : ทุกวันทำการ | Maximum Drawdown | -0.08% |
| เวลาทำการ | : 8:30 - 16:00 น. | เวลาทำการ | : 8:30 - 15:30 น. | FX Hedging | 100.12% |
| การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ | : ไม่กำหนด | การขายคืนขั้นต่ำ | : ไม่กำหนด | Recovering Period | 26 วัน |
| การซื้อครั้งถัดไปขั้นต่ำ | : ไม่กำหนด | ยอดคงเหลือขั้นต่ำ | : ไม่กำหนด | อายุเฉลี่ยของตราสารหนี้ | 3 เดือน 30 วัน |
| | | ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน | : ภายใน 3 วันทำการ ¹ (ปัจจุบัน T+1) ² | อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน | 1.86 เท่า |

หมายเหตุ ¹ ถัดจากวันที่ส่งขายคืนหน่วยลงทุน

² ปัจจุบัน T+1 เฉพาะบัญชีรับเงินค่าขายคืนหน่วยลงทุนของ KKP Bank, SCB, BBL, KBank, BAY, TTB, KTB, CIMB Thai, LH Bank, UOB, Citibank และนำฝาก/นำส่งเช็ค T+1 สำหรับบัญชีธนาคารอื่นนอกเหนือจากที่ระบุข้างต้น (รายละเอียดอาจมีการเปลี่ยนแปลง)

T = วันทำการซื้อขาย

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (%ต่อปี ของ NAV) (ข้อมูล ณ วันที่ 29 กุมภาพันธ์ 2567)

| ค่าธรรมเนียม | สูงสุดไม่เกิน | เก็บจริง |
|---------------|---------------|----------------|
| การจัดการ | 0.3000 % | ปัจจุบันยกเว้น |
| รวมค่าใช้จ่าย | 0.4922 % | 0.1050 % |

หมายเหตุ 1. ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว

2. ค่าใช้จ่ายรวมที่เรียกเก็บจริง เป็นข้อมูลของรอบระยะเวลาบัญชี วันที่ 1 พ.ย. 65 - 31 ต.ค. 66

3. ผู้ลงทุนสามารถดูข้อมูลค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวมย้อนหลัง 3 ปี

ในหนังสือชี้ชวนส่วนข้อมูลกองทุน ได้ที่ <https://am.kkpf.com>

4. บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (%ต่อปี ของมูลค่าซื้อขาย) (ข้อมูล ณ วันที่ 29 กุมภาพันธ์ 2567)

| ค่าธรรมเนียม | สูงสุดไม่เกิน | เก็บจริง |
|-----------------------------|---------------------|---------------------|
| การขาย | ไม่มี | ไม่มี |
| การรับซื้อคืน | ไม่มี | ไม่มี |
| การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า | ไม่มี | ไม่มี |
| การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก | ไม่มี | ไม่มี |
| การโอนหน่วย | 20 บาท ต่อ 1 รายการ | 20 บาท ต่อ 1 รายการ |

หมายเหตุ 1. ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว

2. บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ

* Yield to Maturity (YTM) อัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในตราสารหนี้ คำนวณจากดอกเบี้ยที่ได้รับจริง โดยมีได้ปรับสัดส่วนเครื่องมือป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยนซึ่งอาจทำให้ผลตอบแทนจริงลดลง/หรือ เพิ่มขึ้นจาก YTM ในรูปสกุลเงินบาทได้

* FX hedging สามารถมากกว่า 100% หากมีการทำสัญญาซื้อขายล่วงหน้า เพื่อป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน ของดอกเบี้ยที่จะได้รับ

การจัดสรรการลงทุนในต่างประเทศ

(ข้อมูล ณ วันที่ 29 กุมภาพันธ์ 2567)

| ประเทศ | %NAV |
|--------|-------|
| QATAR | 25.86 |
| JAPAN | 7.51 |

ผู้ออกตราสาร 5 อันดับแรก

(ข้อมูล ณ วันที่ 29 กุมภาพันธ์ 2567)

| ผู้ออก | %NAV |
|-----------------------------------------|-------|
| ธนาคารแห่งประเทศไทย | 25.16 |
| Doha Bank Q.P.S.C. | 15.18 |
| Government of Japan | 11.06 |
| QATAR NATIONAL BANK | 10.68 |
| บริษัท เจริญโภคภัณฑ์อาหาร จำกัด (มหาชน) | 4.80 |

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน

(ข้อมูล ณ วันที่ 29 กุมภาพันธ์ 2567)

| ประเภททรัพย์สิน | %NAV |
|------------------------------------------------------------------|-------|
| พันธบัตร, ตัวเงินค้ำ | 36.24 |
| เงินฝาก, บัตรเงินฝาก | 25.86 |
| ตัวแลกเงิน | 23.38 |
| หุ้นกู้ | 14.48 |
| สัญญาซื้อขายล่วงหน้า | 0.27 |
| ตราสารด้อยสิทธิเพื่อนับเป็นเงินกองทุนของธนาคารพาณิชย์ประเภทที่ 2 | 0.08 |
| Callable Bonds/ Puttable Bonds | 0.01 |
| สินทรัพย์และหนี้สินอื่น | -0.32 |

ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก

(ข้อมูล ณ วันที่ 29 กุมภาพันธ์ 2567)

| ชื่อทรัพย์สิน | %NAV |
|----------------------------------------------|------|
| พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย (CBF24513A) | 4.14 |
| JAPAN TREASURY DISC BILL (JP1742061Q17) | 3.56 |
| พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย (CBF24916A) | 2.86 |
| พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย (CBF24708A) | 2.79 |
| TERM DEPOSIT QATAR NATIONAL BANK (QNB24311A) | 2.77 |

การจัดสรรการลงทุนตามอันดับความน่าเชื่อถือ (%)

(ข้อมูล ณ วันที่ 29 กุมภาพันธ์ 2567)

| | ในประเทศ | national | international |
|-------------|----------|----------|---------------|
| GOV/AAA | 26.05 | 0.00 | 0.00 |
| AA | 5.76 | 1.11 | 0.00 |
| A | 23.73 | 0.00 | 21.74 |
| BBB | 6.48 | 0.00 | 15.18 |
| ต่ำกว่า BBB | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| unrated | 0.00 | 0.00 | 0.00 |

หมายเหตุ:ในการเปลี่ยนแปลงมูลค่าขั้นต่ำของการสั่งซื้อครั้งถัดไป บริษัทจัดการจะคำนึงถึงประโยชน์ของผู้ถือหน่วยลงทุนเป็นสำคัญ โดยบริษัทจัดการจะประกาศการเปลี่ยนแปลง และแจ้งให้ผู้ถือหน่วยลงทุนทราบล่วงหน้าอย่างชัดเจนถึงวันที่มีการเปลี่ยนแปลงมูลค่าขั้นต่ำของการสั่งซื้อ ครั้งถัดไป ค่าอธิบายเกี่ยวกับการเปลี่ยนแปลงและเหตุผลในการเปลี่ยนแปลงข้อมูลดังกล่าว ผ่านเว็บไซต์ของบริษัทจัดการ ภายในระยะเวลาที่ผู้ถือหน่วยลงทุนสามารถใช้ประโยชน์จากข้อมูลในการตัดสินใจลงทุนได้

คำอธิบาย

Maximum Drawdown เปรอ์เซ็นต์ผลขาดทุนสูงสุดของกองทุนรวมในระยะเวลา 5 ปีย้อนหลัง (หรือตั้งแต่จัดตั้งกองทุนกรณีที่ยังไม่ครบ 5 ปี) โดยวัดจากระดับ NAV ต่อหน่วยที่จุดสูงสุดไปจนถึงจุดต่ำสุดในช่วงที่ NAV ต่อหน่วยปรับตัวลดลง ค่า Maximum Drawdown เป็นข้อมูลที่ช่วยให้ทราบถึงความเสี่ยงที่อาจจะขาดทุนจากการลงทุนในกองทุนรวม

Recovering Period ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาดังแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลา นานเท่าใด

FX Hedging เปรอ์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลาหนึ่ง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่า การซื้อหลักทรัพย์กับผลรวมของมูลค่าการขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 1 ปีหารด้วยมูลค่า NAV ของกองทุนรวมเฉลี่ยในรอบระยะเวลาเดียวกัน กองทุนรวมที่มีค่า portfolio turnover สูง บ่งชี้ถึงการซื้อขายหลักทรัพย์บ่อยครั้งของผู้จัดการกองทุนและทำให้มีต้นทุนการซื้อขายหลักทรัพย์ที่สูง จึงต้องพิจารณาเปรียบเทียบกับผลการดำเนินงานของกองทุนรวมเพื่อประเมินความคุ้มค่าของการซื้อขายหลักทรัพย์ดังกล่าว

Sharpe Ratio อัตราส่วนระหว่างผลตอบแทนส่วนเพิ่มของกองทุนรวมเปรียบเทียบกับความเสี่ยงจากการลงทุน โดยคำนวณจากผลต่างระหว่างอัตราผลตอบแทนของ กองทุนรวมกับอัตราผลตอบแทนที่ปราศจากความเสี่ยง (risk-free rate) เปรียบเทียบกับค่าเบี่ยงเบนมาตรฐาน (standard deviation) ของกองทุนรวม ค่า Sharpe Ratio สะท้อนถึงอัตราผลตอบแทนที่กองทุนรวมควรได้รับเพิ่มขึ้นเพื่อชดเชยกับความเสี่ยงที่กองทุนรวมรับมา โดยกองทุนรวมที่มีค่า Sharpe Ratio สูงกว่าจะเป็นกองทุนที่มีประสิทธิภาพในการบริหารจัดการลงทุนที่ดีกว่า เนื่องจากได้รับผลตอบแทนส่วนเพิ่มที่สูงกว่าภายใต้ระดับความเสี่ยงเดียวกัน

Alpha ผลตอบแทนส่วนเกินของกองทุนรวมเมื่อเปรียบเทียบกับดัชนีชี้วัด (benchmark) โดยค่า Alpha ที่สูง หมายถึง กองทุนสามารถสร้างผลตอบแทนได้สูงกว่าดัชนีชี้วัด ซึ่งเป็นผลจากประสิทธิภาพของผู้จัดการกองทุนในการคัดเลือกหรือหาจังหวะการลงทุนในหลักทรัพย์ได้อย่างเหมาะสม

Beta ระดับและทิศทางของการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุน โดยเปรียบเทียบกับอัตราการเปลี่ยนแปลงของตลาด Beta น้อยกว่า 1 แสดงว่า หลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนน้อยกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด Beta มากกว่า 1 แสดงว่า หลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนมากกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด

Tracking Error อัตราผลตอบแทนของกองทุนมีประสิทธิภาพในการเลียนแบบดัชนีชี้วัด โดยหาก tracking error ต่ำ หมายถึง กองทุนรวมมีประสิทธิภาพในการ สร้างผลตอบแทนให้ใกล้เคียงกับดัชนีชี้วัด กองทุนรวมที่มีค่า tracking error สูง จะมีอัตราผลตอบแทนโดยเฉลี่ยห่างจากดัชนีชี้วัดมากขึ้น

Yield to Maturity อัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในตราสารหนี้โดยถือจนครบกำหนดอายุ ซึ่งคำนวณจากดอกเบี้ยที่จะได้รับในอนาคต ตลอดอายุตราสารและเงินต้น ที่จะได้รับคืน นำมาคิดลดเป็นมูลค่าปัจจุบัน โดยใช้วิธีอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมตราสารหนี้ คำนวณจากค่าเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักของ Yield to Maturity ของ ตราสารหนี้แต่ละตัวที่กองทุนมีการลงทุน และเนื่องจาก Yield to Maturity มีหน่วยมาตรฐานเป็นเปอร์เซ็นต์ต่อปี จึงสามารถนำไปใช้เปรียบเทียบอัตราผลตอบแทน ระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีนโยบายถือครองตราสารหนี้จนครบกำหนดอายุและมีลักษณะการลงทุนที่ใกล้เคียงกันได้

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน เกียรตินาคินภัทร จำกัด

โทรศัพท์ (66) 2305 9800 โทรสาร (66) 2305 9803-4 website : <https://am.kkpgf.com>

ที่อยู่ : 209 อาคารเคเคพี ทาวเวอร์ เอ ชั้นที่ 17 ถนนสุขุมวิท 21 (อโศก)

แขวงคลองเตยเหนือ เขตวัฒนา กรุงเทพมหานคร 10110

คำเตือน/ข้อแนะนำ

- กรณีลงทุนในต่างประเทศ กองทุนนี้อาจมีความเสี่ยงที่ทางการของต่างประเทศอาจออกมาตรการในภาวะที่เกิดวิกฤตการณ์ที่ไม่ปกติ ทำให้กองทุนไม่สามารถนำเงินกลับเข้ามาในประเทศไทย ซึ่งอาจส่งผลให้ผู้ลงทุนไม่ได้รับคืนเงินตามระยะเวลาที่กำหนด
- กรณีลงทุนในต่างประเทศ กองทุนนี้มีความเสี่ยงจากการเปลี่ยนแปลงในเรื่องเศรษฐกิจ การเมือง และสังคมของประเทศที่กองทุนไปลงทุน กองทุนอาจลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งสัญญาซื้อขายล่วงหน้า และ/หรือ ตราสารที่มีสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแฝง กองทุนอาจมีความเสี่ยงมากกว่ากองทุนรวมที่ลงทุนในหลักทรัพย์อ้างอิงโดยตรง เนื่องจากใช้เงินลงทุนในจำนวนที่น้อยกว่าจึงมีกำไร/ขาดทุนสูงกว่าการลงทุนในหลักทรัพย์อ้างอิงโดยตรง
- ในกรณีที่กองทุนรวมลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า เพื่อการลดความเสี่ยงโดยสินค้าหรือตัวแปรของสัญญาซื้อขายล่วงหน้า นั้นไม่ใช่สิ่งเดียวกับทรัพย์สินที่ต้องการลดความเสี่ยง บริษัทจัดการจะใช้ข้อมูลในอดีตในการคำนวณค่าสัมบูรณ์ของค่าสัมประสิทธิ์สหสัมพันธ์ (absolute correlation coefficient) กองทุนรวมจึงมีความเสี่ยง หากสินค้าหรือตัวแปรที่สัญญาซื้อขายล่วงหน้าอ้างอิง (underlying) และทรัพย์สินที่ต้องการลดความเสี่ยงเคลื่อนไหวในทิศทางที่ไม่เป็นไปตามข้อมูลในอดีต ซึ่งอาจส่งผลให้การเข้าทำสัญญาซื้อขายล่วงหน้าไม่สามารถลดความเสี่ยงได้อย่างเต็มประสิทธิภาพ
- การลงทุนในหน่วยลงทุนมิใช่การฝากเงิน และมีความเสี่ยงของการลงทุน ผู้ลงทุนควรลงทุนในกองทุนเปิดเคเคพี ตราสารหนี้พลัง เมื่อเห็นว่าการลงทุนในกองทุนเปิดนี้เหมาะสมกับวัตถุประสงค์การลงทุนของผู้ลงทุน และผู้ลงทุนยอมรับความเสี่ยงที่อาจเกิดขึ้นจากการลงทุนได้
- ในกรณีหากกองทุนเปิดเคเคพี ตราสารหนี้พลัง มีการลงทุนในต่างประเทศ กองทุนจะทำการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยนทั้งหมด/หรือเกือบทั้งหมด
- การลงทุนมีความเสี่ยง ผู้ลงทุนควรทำความเข้าใจลักษณะสินค้า เงื่อนไขผลตอบแทน และความเสี่ยงก่อนตัดสินใจลงทุน

เครื่องมือบริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่อง

ผู้ลงทุนสามารถศึกษารายละเอียด หลักเกณฑ์ และเงื่อนไขการใช้งานของแต่ละเครื่องมือบริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่องได้ในรายละเอียดโครงการ และหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม ที่ <https://am.kkpfpg.com>

กลุ่มเครื่องมือที่ส่งผ่านภาระค่าใช้จ่ายให้ผู้ลงทุน

1. ค่าธรรมเนียมการรักษาสภาพคล่อง (Liquidity Fee)

เครื่องมือที่สะท้อนต้นทุนของกองทุนที่เกิดขึ้นในภาวะที่ตลาดมีความผันผวนสูงหรือมีการขายคืนหน่วยลงทุนหรือมีการสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออกของกองทุนนั้น ๆ สูงเกินกว่าปกติ โดยจะเรียกเก็บค่าธรรมเนียมเฉพาะ "ผู้ขาย" หรือผู้สับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออกในจำนวนที่เกินกว่าปริมาณและ/หรือ ก่อนระยะเวลาที่กำหนด และเป็น การเรียกเก็บเข้ากองทุน

2. การปรับมูลค่าทรัพย์สินสุทธิด้วยสูตรการคำนวณที่สะท้อนต้นทุนในการซื้อขายทรัพย์สินของกองทุนรวม (Swing Pricing)

เครื่องมือใช้ปรับมูลค่าหน่วยลงทุน เพื่อให้สะท้อนต้นทุนการซื้อขายของกองทุนในภาวะที่ตลาดมีความผันผวน โดยเพิ่มตัวแปร (Swing Factor) ที่ช่วยสะท้อนต้นทุนค่าใช้จ่ายและใช้ตัวแปรนั้นช่วยในการปรับมูลค่าหน่วยลงทุน นอกจากนี้ กองทุนอาจเลือกใช้ Swing Pricing เฉพาะช่วงเวลาที่มีการซื้อขายสุทธิเกินกว่าที่กำหนดไว้ (Partial swing pricing) หรือสามารถใช้ทุกวันในช่วงที่ตลาดมีความผันผวน (Full swing pricing) ขึ้นอยู่กับการกำหนดเงื่อนไขในการใช้เครื่องมือตามลักษณะและสินทรัพย์หรือต้นทุนที่เกิดขึ้นกับกองทุนรวม นั้น ๆ

3. การเพิ่มค่าธรรมเนียมการซื้อขายหน่วยลงทุนที่สะท้อนต้นทุนในการซื้อขายทรัพย์สินของกองทุนรวม (Anti-Dilution Levies - ADLs)

เครื่องมือที่ทำให้การซื้อขายหน่วยลงทุนสะท้อนต้นทุนที่เกี่ยวข้องจากการปรับพอร์ตของกองทุน ในภาวะตลาดผันผวนสูงผิดปกติหรือสภาพคล่องผิดปกติ หรือเกิดเหตุการณ์อื่นที่อาจจะกระทบต่อต้นทุนและค่าใช้จ่ายของกองทุนรวม โดยกองทุนจะกำหนดมูลค่าซื้อขายสุทธิเป็นเกณฑ์ของเครื่องมือ ถ้ามีการซื้อขายหรือสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเกินกว่าระดับที่กำหนด กองทุนจะมีการเรียกเก็บค่าธรรมเนียมเพิ่มเติมเข้ากองทุน และการคิดค่าธรรมเนียมอาจเกิดขึ้นได้ทั้งจากผู้ซื้อ/สับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า หรือจาก ผู้ขาย/สับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออกก็ได้ ซึ่งขึ้นอยู่กับปริมาณธุรกรรมที่เกิดขึ้นตามเงื่อนไขที่ บลจ. กำหนด

กลุ่มเครื่องมือที่จำกัดคำสั่งรับซื้อคืนหน่วยลงทุน

4. ระยะเวลาที่ต้องแจ้งล่วงหน้าก่อนการขายคืนหน่วยลงทุน (Notice Period)

เครื่องมือที่จะกำหนดระยะเวลาในการส่งคำสั่งเพื่อทำการขายคืนหรือสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออกไว้ล่วงหน้าหากผู้ถือหน่วยทำการที่เกินกว่าปริมาณที่กำหนด เพื่อให้กองทุนมีเวลาในการเตรียมขายสินทรัพย์เพื่อมาชำระค่าขายคืนหน่วยลงทุน

5. เพดานการขายคืนหน่วยลงทุน (Redemption Gate)

เป็นเครื่องมือที่กำหนดเพดานมูลค่าที่จะให้ผู้ถือหน่วยลงทุนขายคืนหน่วยลงทุนหรือสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออกได้ในแต่ละกองทุน เมื่อเกิดสถานการณ์ไม่ปกติ หรือ ประเมินว่าสถานการณ์อาจจะไม่ปกติ โดย บลจ. จะใช้วิธีการชำระคืนตามสัดส่วน หรือที่เรียกว่า Pro rata สำหรับคำสั่งขายคืนหน่วยลงทุนหรือสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออกที่เหลือ จะทำการขายคืนให้ในวันทำการถัดไป หากวันทำการถัดไป บลจ. ยังคงใช้เครื่องมือนี้ บลจ. จะชำระคืนตามวิธี Pro rata โดยไม่มีการจัดลำดับก่อนหลัง แต่หากวันทำการถัดไปกองทุนมีสภาพคล่องเพียงพอ ทำให้ บลจ. ไม่ต้องใช้เครื่องมือนี้ บลจ. จะชำระคืนตามรายการขายคืนหน่วยลงทุนหรือสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออกที่ได้รับไว้ทั้งหมด

6. การดำเนินการในกรณีที่ผู้ออกตราสารหนี้หรือลูกหนี้ตามสิทธิเรียกร้องผิดนัดชำระหนี้ หรือตราสารที่ลงทุนประสบปัญหาขาดสภาพคล่องหรือไม่สามารถจำหน่ายได้ด้วยราคาที่เหมาะสมผล (Side Pocket)

เครื่องมือที่ทำให้กองทุนรวมสามารถแยกสินทรัพย์ที่มีปัญหา ด้านสภาพคล่อง ออกจากทรัพย์สินโดยรวมของกองทุน โดยในวันที่ บลจ. ดำเนินการแยกทรัพย์สินดังกล่าว บลจ. จะทำทะเบียนผู้ถือหน่วยลงทุน ณ วันทำการนั้น เพื่อใช้เป็นข้อมูลสำหรับการคืนเงินที่ บลจ. อาจได้รับจากทรัพย์สินที่ติดปัญหาด้านสภาพคล่องข้างต้นในอนาคต

7. การไม่ขายหรือไม่รับซื้อคืนหน่วยลงทุนตามคำสั่งที่รับไว้หรือจะหยุดรับคำสั่งซื้อหรือคำสั่งขายคืนหน่วยลงทุน (Suspension of dealings)

การระงับการซื้อขายหน่วยลงทุนเป็นการชั่วคราวเพื่อลดผลกระทบต่อการบริหารสภาพคล่องของกองทุน และโดยเฉพาะเพื่อป้องกันไม่ให้เกิดปัญหารุนแรงมากขึ้นจนถึงขั้นปิดกอง จัดเป็นเครื่องมือที่มีผลกระทบสูง การใช้เครื่องมือถูกควบคุมดูแลจากสำนักงาน ก.ล.ด. เงื่อนไขของการนำมาใช้จะต้องคำนึงถึงประโยชน์โดยรวมของผู้ถือหน่วยลงทุน

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน เกียรตินาคินภัทร จำกัด

ข้อมูล ณ วันที่ 29 กุมภาพันธ์ 2567

กองทุนเปิดเคเคพี ดราสารหนี้พลัส
KKP FIXED INCOME PLUS FUND

หน่วยลงทุนชนิด M
KKP PLUS-M

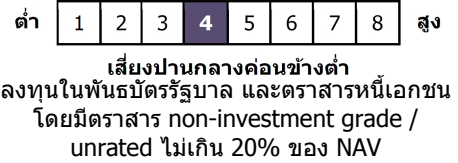
ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

กองทุนรวมตราสารหนี้ กองทุนที่ลงทุนแบบมีความเสี่ยงทั้งในและต่างประเทศ
กลุ่มกองทุนรวม : Short Term General Bond

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- กองทุนมีนโยบายลงทุนในตราสารหนี้ภาครัฐ และบริษัทเอกชนที่มีความมั่นคง และให้ผลตอบแทนที่ดี โดยกองทุนจะดำรงอายุถัวเฉลี่ยแบบถ่วงน้ำหนัก (Portfolio Duration) ไม่เกิน 1.5 ปี โดยเฉลี่ยรอบปีบัญชี โดยตราสารหนี้ภาคเอกชน ณ วันที่ลงทุน ต้องได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือ ตั้งแต่ BBB+ ขึ้นไป
- กองทุนอาจลงทุนในต่างประเทศไม่เกินร้อยละ 40 ของ NAV โดยกองทุนจะลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivative) เพื่อป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยนของเงินต้น และอัตราดอกเบี้ยที่คาดว่าจะได้รับ ณ วันที่กองทุนลงทุน ทั้งหมดหรือเกือบทั้งหมด โดยจะป้องกันความเสี่ยงอัตราแลกเปลี่ยนไม่น้อยกว่าร้อยละ 90 ของจำนวนเงินลงทุนในต่างประเทศ
- กองทุนอาจลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivative) เพื่อเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน (Efficient Portfolio Management) เฉพาะที่เป็นตราสารที่มีสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแฝง (Structured Note) ประเภทตราสารหนี้ Callable และตราสารหนี้ Puttable โดยมีการกำหนดผลตอบแทนไว้ อย่างแน่นอน หรือเป็นอัตราที่ผันแปรตามอัตราดอกเบี้ยของ สถาบันการเงินหรืออัตราดอกเบี้ยอื่น และไม่มีกำหนดเงื่อนไขการจ่ายผลตอบแทนที่อ้างอิงกับปัจจัยอ้างอิงอื่นเพิ่มเติม
- กลยุทธ์การลงทุน: มุ่งหวังให้ผลประกอบการสูงกว่าดัชนีชี้วัด (Active Management) (กองทุนสามารถลงทุนในทรัพย์สินอื่นๆ ตามที่ระบุในนโยบายการลงทุนของกองทุน รวมถึงประเภทหลักทรัพย์ ในรายละเอียดโครงการจัดการกองทุนและหนังสือชี้ชวนส่วนข้อมูลโครงการโปรดศึกษารายละเอียดทั้งหมดเพิ่มเติม <https://am.kkpf.com>)

ระดับความเสี่ยง



ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน : 23 พฤศจิกายน 2547
วันเริ่มต้น class : 16 ธันวาคม 2565
นโยบายจ่ายเงินปันผล : ไม่จ่าย
อายุกองทุน : ไม่กำหนด

ผู้จัดการกองทุนรวม

1. นายรัฐพล ชัดดียะสูงศ์ (ตั้งแต่ 1 ก.ย. 63)
2. นายชวณัฐ ไพศาลวงศ์ดี (ตั้งแต่ 1 ส.ค. 61)

ดัชนีชี้วัด :

- (1) 30% ผลตอบแทนรวมของดัชนีพันธบัตรรัฐบาลระยะสั้นของสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย
- (2) 35% ดัชนีผลตอบแทนรวมตราสารหนี้ภาคเอกชนระยะสั้น (ThaiBMA Commercial Paper Index) ที่มีอันดับความน่าเชื่อถือของผู้ออกตราสารอยู่ในระดับ A- ขึ้นไป ของสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย
- (3) 5% ผลตอบแทนรวมสุทธิของดัชนีตราสารหนี้ภาคเอกชน Mark-to-Market ที่มีอันดับความน่าเชื่อถือของผู้ออกตราสารอยู่ในระดับ BBB+ ขึ้นไป อายุ 1 - 3 ปี ของสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย
- (4) 10% อัตราดอกเบี้ยเงินฝากประจำ 3 เดือน วงเงินน้อยกว่า 5 ล้านบาท เฉลี่ยของ 3 ธนาคารพาณิชย์ขนาดใหญ่ ได้แก่ ธนาคารกรุงเทพ ธนาคารกสิกรไทย และธนาคารไทยพาณิชย์ หลังหักภาษี
- (5) 20% ของ Overnight Indexed Swap (OIS) 3 เดือน หลังหักภาษี ปรับด้วยต้นทุนการป้องกันความเสี่ยงด้านอัตราแลกเปลี่ยนเพื่อคำนวณผลตอบแทนเป็นสกุลเงินบาท วันที่ คำนวณผลตอบแทน

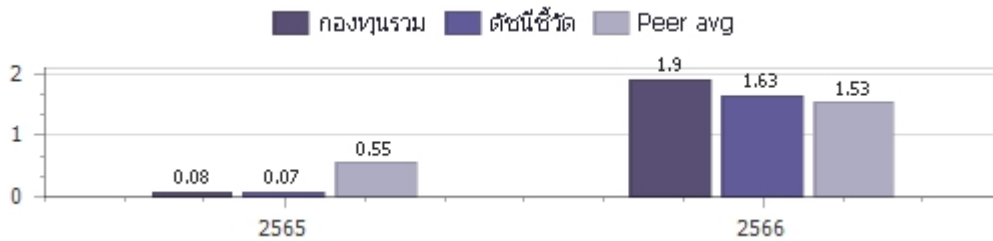
คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวม มิได้เป็นสัญญาณถึงผลการดำเนินงานในอนาคต โปรดศึกษาค่าเดือนที่สำคัญอื่นในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต : ได้รับการรับรอง CAC

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน 1,2,3 (%ต่อปี)

(ข้อมูล ณ วันที่ 29 กุมภาพันธ์ 2567)



ผลการดำเนินการย้อนหลังแบบปีกumul 1,4 (%)

| | Year to Date | 3 เดือน | 6 เดือน | 1 ปี ⁴ |
|--------------------------|--------------|-------------------|-------------------|-----------------------------------|
| กองทุนรวม | 0.46% | 0.65% | 1.24% | 2.12% |
| ตัวชี้วัด | 0.40% | 0.56% | 1.08% | 1.89% |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน | 0.43% | 0.63% | 1.16% | 1.81% |
| ความผันผวนของกองทุน | 0.11% | 0.13% | 0.12% | 0.10% |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด | 0.09% | 0.10% | 0.10% | 0.10% |
| | | 3 ปี ⁴ | 5 ปี ⁴ | 10 ปี ⁴ |
| กองทุนรวม | | | | ตั้งแต่จัดตั้งกองทุน ⁴ |
| ตัวชี้วัด | | | | 2.02% |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน | | | | 1.73% |
| ความผันผวนของกองทุน | | | | N/A |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด | | | | 0.11% |
| | | | | 0.10% |

1. เอกสารการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวมฉบับนี้ ได้จัดทำตามมาตรฐานการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวมของสมาคมบริษัทจัดการลงทุน
2. หากกองทุนรวมมีผลการดำเนินงานตั้งแต่วันที่จดทะเบียนทรัพย์สินกองทุนรวมหรือวันที่เปิดเสนอขายชนิดหน่วยลงทุนไม่ครบ 1 ปีปฏิทิน จะแสดงผลการดำเนินงานของปีปฏิทินแรกตั้งแต่วันที่กองทุนรวมจดทะเบียนทรัพย์สินกองทุนรวมหรือวันที่เปิดเสนอขายชนิดหน่วยลงทุนจนถึงวันที่ทำการสุดท้ายของปีปฏิทินแรก
3. หากกองทุนรวมมีผลการดำเนินงานในปีที่เล็กกองทุนไม่ครบ 1 ปีปฏิทิน จะแสดงผลการดำเนินงานของปีปฏิทินสุดท้ายตั้งแต่วันที่ทำการสุดท้ายของปีปฏิทินก่อนหน้าจนถึงวันที่เล็กกองทุน
4. % ต่อปี

ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือบริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่องได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



<https://am.kkpf.com>

การซื้อหน่วยลงทุน

| | |
|--------------------------|-------------------|
| วันทำการซื้อ | : ทุกวันทำการ |
| เวลาทำการ | : 8:30 - 16:00 น. |
| การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ | : ไม่กำหนด |
| การซื้อครั้งถัดไปขั้นต่ำ | : ไม่กำหนด |

การขายคืนหน่วยลงทุน

| | |
|-----------------------------|-------------------------------------------------------------|
| วันทำการขายคืน | : ทุกวันทำการ |
| เวลาทำการ | : 8:30 - 15:30 น. |
| การขายคืนขั้นต่ำ | : ไม่กำหนด |
| ยอดคงเหลือขั้นต่ำ | : ไม่กำหนด |
| ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน | : ภายใน 3 วันทำการ ¹ (ปัจจุบัน T+1) ² |

ข้อมูลเชิงสถิติ

(ข้อมูล ณ วันที่ 29 กุมภาพันธ์ 2567)

| | |
|----------------------------|----------------|
| Maximum Drawdown | -0.02% |
| FX Hedging | 100.12% |
| Recovering Period | 5 วัน |
| อายุเฉลี่ยของตราสารหนี้ | 3 เดือน 30 วัน |
| อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน | 1.86 เท่า |
| Yield to Maturity | 1.88% |

หมายเหตุ ¹ ถัดจากวันที่ส่งขายคืนหน่วยลงทุน² ปัจจุบัน T+1 เฉพาะบัญชีรับเงินค่าขายคืนหน่วยลงทุนของ KKP Bank, SCB, BBL, KBank, BAY, TTB, KTB, CIMB Thai, LH Bank, UOB, Citibank และนำฝาก/นำส่งเช็ค T+1 สำหรับบัญชีธนาคารอื่นนอกเหนือจากที่ระบุข้างต้น (รายละเอียดอาจมีการเปลี่ยนแปลง)

T = วันทำการซื้อขาย

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (%ต่อปี ของ NAV)

(ข้อมูล ณ วันที่ 29 กุมภาพันธ์ 2567)

| ค่าธรรมเนียม | สูงสุดไม่เกิน | เก็บจริง |
|---------------|---------------|----------|
| การจัดการ | 0.3000 % | 0.2354 % |
| รวมค่าใช้จ่าย | 0.4922 % | 0.2660 % |

หมายเหตุ 1. ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว

2. ค่าใช้จ่ายรวมที่เรียกเก็บจริง เป็นข้อมูลของรอบระยะเวลาบัญชี วันที่ 16 ธ.ค. 65 - 31 ธ.ค. 66

3. ผู้ลงทุนสามารถดูข้อมูลค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวมย้อนหลัง 3 ปี

ในหนังสือชี้ชวนส่วนข้อมูลกองทุน ได้ที่ <https://am.kkpf.com>

4. บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (%ต่อปี ของมูลค่าซื้อขาย)

(ข้อมูล ณ วันที่ 29 กุมภาพันธ์ 2567)

| ค่าธรรมเนียม | สูงสุดไม่เกิน | เก็บจริง |
|-----------------------------|---------------------|---------------------|
| การขาย | ไม่มี | ไม่มี |
| การรับซื้อคืน | ไม่มี | ไม่มี |
| การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า | ไม่มี | ไม่มี |
| การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก | ไม่มี | ไม่มี |
| การโอนหน่วย | 20 บาท ต่อ 1 รายการ | 20 บาท ต่อ 1 รายการ |

หมายเหตุ 1. ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว

2. บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ

* Yield to Maturity (YTM) อัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในตราสารหนี้ คำนวณจากดอกเบี้ยที่ได้รับจริง โดยมีได้ปรับสัดส่วนเครื่องมือป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยนซึ่งอาจทำให้ผลตอบแทนจริงลดลง/หรือ เพิ่มขึ้นจาก YTM ในรูปสกุลเงินบาทได้

* FX hedging สามารถมากกว่า 100% หากมีการทำสัญญาซื้อขายล่วงหน้า เพื่อป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน ของดอกเบี้ยที่จะได้รับ

การจัดสรรการลงทุนในต่างประเทศ

(ข้อมูล ณ วันที่ 29 กุมภาพันธ์ 2567)

| ประเทศ | %NAV |
|--------|-------|
| QATAR | 25.86 |
| JAPAN | 7.51 |

ผู้ออกตราสาร 5 อันดับแรก

(ข้อมูล ณ วันที่ 29 กุมภาพันธ์ 2567)

| ผู้ออก | %NAV |
|-----------------------------------------|-------|
| ธนาคารแห่งประเทศไทย | 25.16 |
| Doha Bank Q.P.S.C. | 15.18 |
| Government of Japan | 11.06 |
| QATAR NATIONAL BANK | 10.68 |
| บริษัท เจริญโภคภัณฑ์อาหาร จำกัด (มหาชน) | 4.80 |

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน

(ข้อมูล ณ วันที่ 29 กุมภาพันธ์ 2567)

| ประเภททรัพย์สิน | %NAV |
|------------------------------------------------------------------|-------|
| พันธบัตร, ตัวเงินค้ำ | 36.24 |
| เงินฝาก, บัตรเงินฝาก | 25.86 |
| ตัวแลกเงิน | 23.38 |
| หุ้นกู้ | 14.48 |
| สัญญาซื้อขายล่วงหน้า | 0.27 |
| ตราสารด้อยสิทธิเพื่อนับเป็นเงินกองทุนของธนาคารพาณิชย์ประเภทที่ 2 | 0.08 |
| Callable Bonds/ Puttable Bonds | 0.01 |
| สินทรัพย์และหนี้สินอื่น | -0.32 |

ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก

(ข้อมูล ณ วันที่ 29 กุมภาพันธ์ 2567)

| ชื่อทรัพย์สิน | %NAV |
|----------------------------------------------|------|
| พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย (CBF24513A) | 4.14 |
| JAPAN TREASURY DISC BILL (JP1742061Q17) | 3.56 |
| พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย (CBF24916A) | 2.86 |
| พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย (CBF24708A) | 2.79 |
| TERM DEPOSIT QATAR NATIONAL BANK (QNB24311A) | 2.77 |

การจัดสรรการลงทุนตามอันดับความน่าเชื่อถือ (%)

(ข้อมูล ณ วันที่ 29 กุมภาพันธ์ 2567)

| | ในประเทศ | national | international |
|-------------|----------|----------|---------------|
| GOV/AAA | 26.05 | 0.00 | 0.00 |
| AA | 5.76 | 1.11 | 0.00 |
| A | 23.73 | 0.00 | 21.74 |
| BBB | 6.48 | 0.00 | 15.18 |
| ต่ำกว่า BBB | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| unrated | 0.00 | 0.00 | 0.00 |

หมายเหตุ:ในการเปลี่ยนแปลงมูลค่าขั้นต่ำของการสั่งซื้อครั้งถัดไป บริษัทจัดการจะคำนึงถึงประโยชน์ของผู้ถือหน่วยลงทุนเป็นสำคัญ โดยบริษัทจัดการจะประกาศการเปลี่ยนแปลง และแจ้งให้ผู้ถือหน่วยลงทุนทราบล่วงหน้าอย่างชัดเจนถึงวันที่มีการเปลี่ยนแปลงมูลค่าขั้นต่ำของการสั่งซื้อ ครั้งถัดไป ค่าอธิบายเกี่ยวกับการเปลี่ยนแปลงและเหตุผลในการเปลี่ยนแปลงข้อมูลดังกล่าว ผ่านเว็บไซต์ของบริษัทจัดการ ภายในระยะเวลาที่ผู้ถือหน่วยลงทุนสามารถใช้ประโยชน์จากข้อมูลในการตัดสินใจลงทุนได้

คำอธิบาย

Maximum Drawdown เปรอ์เซ็นต์ผลขาดทุนสูงสุดของกองทุนรวมในระยะเวลา 5 ปีย้อนหลัง (หรือตั้งแต่จัดตั้งกองทุนกรณีที่ยังไม่ครบ 5 ปี) โดยวัดจากระดับ NAV ต่อหน่วยที่จุดสูงสุดไปจนถึงจุดต่ำสุดในช่วงที่ NAV ต่อหน่วยปรับตัวลดลง ค่า Maximum Drawdown เป็นข้อมูลที่ช่วยให้ทราบถึงความเสี่ยงที่อาจจะขาดทุนจากการลงทุนในกองทุนรวม

Recovering Period ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาดังแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลาสั้นเท่าใด

FX Hedging เปรอ์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลาหนึ่ง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์กับผลรวมของมูลค่าการขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 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 สูงกว่าจะเป็นกองทุนที่มีประสิทธิภาพในการบริหารจัดการลงทุนที่ดีกว่า เนื่องจากได้รับผลตอบแทนส่วนเพิ่มที่สูงกว่าภายใต้ระดับความเสี่ยงเดียวกัน

Alpha ผลตอบแทนส่วนเกินของกองทุนรวมเมื่อเปรียบเทียบกับดัชนีชี้วัด (benchmark) โดยค่า Alpha ที่สูง หมายถึง กองทุนสามารถสร้างผลตอบแทนได้สูงกว่าดัชนีชี้วัด ซึ่งเป็นผลจากประสิทธิภาพของผู้จัดการกองทุนในการคัดเลือกหรือหาจังหวะการลงทุนในหลักทรัพย์ได้อย่างเหมาะสม

Beta ระดับและทิศทางของการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุน โดยเปรียบเทียบกับอัตราการเปลี่ยนแปลงของตลาด Beta น้อยกว่า 1 แสดงว่าหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนน้อยกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด Beta มากกว่า 1 แสดงว่าหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนมากกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด

Tracking Error อัตราผลตอบแทนของกองทุนมีประสิทธิภาพในการเลียนแบบดัชนีชี้วัด โดยหาก tracking error ต่ำ หมายถึง กองทุนรวมมีประสิทธิภาพในการสร้างผลตอบแทนให้ใกล้เคียงกับดัชนีชี้วัด กองทุนรวมที่มีค่า tracking error สูง จะมีอัตราผลตอบแทนโดยเฉลี่ยห่างจากดัชนีชี้วัดมากขึ้น

Yield to Maturity อัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในตราสารหนี้โดยถือจนครบกำหนดอายุ ซึ่งคำนวณจากดอกเบี้ยที่จะได้รับในอนาคต ตลอดอายุตราสารและเงินต้นที่จะได้รับคืน นำมาคิดลดเป็นมูลค่าปัจจุบัน โดยใช้วิธีอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมตราสารหนี้ คำนวณจากค่าเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักของ Yield to Maturity ของตราสารหนี้แต่ละตัวที่กองทุนมีการลงทุน และเนื่องจาก Yield to Maturity มีหน่วยมาตรฐานเป็นเปอร์เซ็นต์ต่อปี จึงสามารถนำไปใช้เปรียบเทียบอัตราผลตอบแทนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีนโยบายถือครองตราสารหนี้จนครบกำหนดอายุและมีลักษณะการลงทุนที่ใกล้เคียงกันได้

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน เกียรตินาคินภัทร จำกัด

โทรศัพท์ (66) 2305 9800 โทรสาร (66) 2305 9803-4 website : <https://am.kkpf.com>

ที่อยู่ : 209 อาคารเคเคพี ทาวเวอร์ เอ ชั้นที่ 17 ถนนสุขุมวิท 21 (อโศก)

แขวงคลองเตยเหนือ เขตวัฒนา กรุงเทพมหานคร 10110

คำเตือน/ข้อแนะนำ

- กรณีลงทุนในต่างประเทศ กองทุนนี้อาจมีความเสี่ยงที่ทางการของต่างประเทศอาจออกมาตรการในภาวะที่เกิดวิกฤตการณ์ที่ไม่ปกติ ทำให้กองทุนไม่สามารถนำเงินกลับเข้ามาในประเทศไทย ซึ่งอาจส่งผลให้ผู้ลงทุนไม่ได้รับคืนเงินตามระยะเวลาที่กำหนด
- กรณีลงทุนในต่างประเทศ กองทุนนี้มีความเสี่ยงจากการเปลี่ยนแปลงในเรื่องเศรษฐกิจ การเมือง และสังคมของประเทศที่กองทุนไปลงทุน กองทุนอาจลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งสัญญาซื้อขายล่วงหน้า และ/หรือ ตราสารที่มีสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแฝง กองทุนอาจมีความเสี่ยงมากกว่ากองทุนรวมที่ลงทุนในหลักทรัพย์อ้างอิงโดยตรง เนื่องจากใช้เงินลงทุนในจำนวนที่น้อยกว่าจึงมีกำไร/ขาดทุนสูงกว่าการลงทุนในหลักทรัพย์อ้างอิงโดยตรง
- ในกรณีที่กองทุนรวมลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า เพื่อการลดความเสี่ยงโดยสินค้าหรือตัวแปรของสัญญาซื้อขายล่วงหน้า นั้นไม่ใช่สิ่งเดียวกับทรัพย์สินที่ต้องการลดความเสี่ยง บริษัทจัดการจะใช้ข้อมูลในอดีตในการคำนวณค่าสัมบูรณ์ของค่าสัมประสิทธิ์สหสัมพันธ์ (absolute correlation coefficient) กองทุนรวมจึงมีความเสี่ยง หากสินค้าหรือตัวแปรที่สัญญาซื้อขายล่วงหน้าอ้างอิง (underlying) และทรัพย์สินที่ต้องการลดความเสี่ยงเคลื่อนไหวในทิศทางที่ไม่เป็นไปตามข้อมูลในอดีต ซึ่งอาจส่งผลให้การเข้าทำสัญญาซื้อขายล่วงหน้าไม่สามารถลดความเสี่ยงได้อย่างเต็มประสิทธิภาพ
- การลงทุนในหน่วยลงทุนมิใช่การฝากเงิน และมีความเสี่ยงของการลงทุน ผู้ลงทุนควรลงทุนในกองทุนเปิดเคเคพี ตราสารหนี้พลัง เมื่อเห็นว่าการลงทุนในกองทุนเปิดนี้เหมาะสมกับวัตถุประสงค์การลงทุนของผู้ลงทุน และผู้ลงทุนยอมรับความเสี่ยงที่อาจเกิดขึ้นจากการลงทุนได้
- ในกรณีหากกองทุนเปิดเคเคพี ตราสารหนี้พลัง มีการลงทุนในต่างประเทศ กองทุนจะทำการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยนทั้งหมด/หรือเกือบทั้งหมด
- การลงทุนมีความเสี่ยง ผู้ลงทุนควรทำความเข้าใจลักษณะสินค้า เงื่อนไขผลตอบแทน และความเสี่ยงก่อนตัดสินใจลงทุน

เครื่องมือบริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่อง

ผู้ลงทุนสามารถศึกษารายละเอียด หลักเกณฑ์ และเงื่อนไขการใช้งานของแต่ละเครื่องมือบริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่องได้ในรายละเอียดโครงการ และหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม ที่ <https://am.kkpfpg.com>

กลุ่มเครื่องมือที่ส่งผ่านภาระค่าใช้จ่ายให้ผู้ลงทุน

1. ค่าธรรมเนียมการรักษาสภาพคล่อง (Liquidity Fee)

เครื่องมือที่สะท้อนต้นทุนของกองทุนที่เกิดขึ้นในภาวะที่ตลาดมีความผันผวนสูงหรือมีการขายคืนหน่วยลงทุนหรือมีการสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออกของกองทุนนั้น ๆ สูงเกินกว่าปกติ โดยจะเรียกเก็บค่าธรรมเนียมเฉพาะ "ผู้ขาย" หรือผู้สับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออกในจำนวนที่เกินกว่าปริมาณและ/หรือ ก่อนระยะเวลาที่กำหนด และเป็น การเรียกเก็บเข้ากองทุน

2. การปรับมูลค่าทรัพย์สินสุทธิด้วยสูตรการคำนวณที่สะท้อนต้นทุนในการซื้อขายทรัพย์สินของกองทุนรวม (Swing Pricing)

เครื่องมือใช้ปรับมูลค่าหน่วยลงทุน เพื่อให้สะท้อนต้นทุนการซื้อขายของกองทุนในภาวะที่ตลาดมีความผันผวน โดยเพิ่มตัวแปร (Swing Factor) ที่ช่วยสะท้อนต้นทุนค่าใช้จ่ายและใช้ตัวแปรนั้นช่วยในการปรับมูลค่าหน่วยลงทุน นอกจากนี้ กองทุนอาจเลือกใช้ Swing Pricing เฉพาะช่วงเวลาที่มีการซื้อขายสุทธิเกินกว่าที่กำหนดไว้ (Partial swing pricing) หรือสามารถใช้ทุกวันในช่วงที่ตลาดมีความผันผวน (Full swing pricing) ขึ้นอยู่กับการกำหนดเงื่อนไขในการใช้เครื่องมือตามลักษณะและสินทรัพย์หรือต้นทุนที่เกิดขึ้นกับกองทุนรวม นั้น ๆ

3. การเพิ่มค่าธรรมเนียมการซื้อขายหน่วยลงทุนที่สะท้อนต้นทุนในการซื้อขายทรัพย์สินของกองทุนรวม (Anti-Dilution Levies - ADLs)

เครื่องมือที่ทำให้การซื้อขายหน่วยลงทุนสะท้อนต้นทุนที่เกี่ยวข้องจากการปรับพอร์ตของกองทุน ในภาวะตลาดผันผวนสูงผิดปกติหรือสภาพคล่องผิดปกติ หรือเกิดเหตุการณ์อื่นที่อาจจะกระทบต่อต้นทุน และค่าใช้จ่ายของกองทุนรวม โดยกองทุนจะกำหนดมูลค่าซื้อขายสุทธิเป็นเกณฑ์ของเครื่องมือ ถ้ามีการซื้อขายหรือสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเกินกว่าระดับที่กำหนด กองทุนจะมีการเรียกเก็บค่าธรรมเนียมเพิ่มเติมเข้ากองทุน และการคิดค่าธรรมเนียมอาจเกิดขึ้นได้ทั้งจากผู้ซื้อ/สับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า หรือจาก ผู้ขาย/สับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออกก็ได้ ซึ่งขึ้นอยู่กับปริมาณธุรกรรมที่เกิดขึ้นตามเงื่อนไขที่ บลจ. กำหนด

กลุ่มเครื่องมือที่จำกัดคำสั่งรับซื้อคืนหน่วยลงทุน

4. ระยะเวลาที่ต้องแจ้งล่วงหน้าก่อนการขายคืนหน่วยลงทุน (Notice Period)

เครื่องมือที่จะกำหนดระยะเวลาในการส่งคำสั่งเพื่อทำการขายคืนหรือสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออกไว้ล่วงหน้าหากผู้ถือหน่วยทำการที่เกินกว่าปริมาณที่กำหนด เพื่อให้กองทุนมีเวลาในการเตรียมขายสินทรัพย์เพื่อมาชำระค่าขายคืนหน่วยลงทุน

5. เพดานการขายคืนหน่วยลงทุน (Redemption Gate)

เป็นเครื่องมือที่กำหนดเพดานมูลค่าที่จะให้ผู้ถือหน่วยลงทุนขายคืนหน่วยลงทุนหรือสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออกได้ในแต่ละกองทุน เมื่อเกิดสถานการณ์ไม่ปกติ หรือ ประเมินว่าสถานการณ์อาจจะไม่ปกติ โดย บลจ. จะใช้วิธีการชำระคืนตามสัดส่วน หรือที่เรียกว่า Pro rata สำหรับคำสั่งขายคืนหน่วยลงทุนหรือสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออกที่เหลือ จะทำการขายคืนให้ในวันทำการถัดไป หากวันทำการถัดไป บลจ. ยังคงใช้เครื่องมือนี้ บลจ. จะชำระคืนตามวิธี Pro rata โดยไม่มีการจัดลำดับก่อนหลัง แต่หากวันทำการถัดไปกองทุนมีสภาพคล่องเพียงพอ ทำให้ บลจ. ไม่ต้องใช้เครื่องมือนี้ บลจ. จะชำระคืนตามรายการขายคืนหน่วยลงทุนหรือสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออกที่ได้รับไว้ทั้งหมด

6. การดำเนินการในกรณีที่ผู้ออกตราสารหนี้หรือลูกหนี้ตามสิทธิเรียกร้องผิดนัดชำระหนี้ หรือตราสารที่ลงทุนประสบปัญหาขาดสภาพคล่องหรือไม่สามารถจำหน่ายได้ด้วยราคาที่เหมาะสมผล (Side Pocket)

เครื่องมือที่ทำให้กองทุนรวมสามารถแยกสินทรัพย์ที่มีปัญหา ด้านสภาพคล่อง ออกจากทรัพย์สินโดยรวมของกองทุน โดยในวันที่ บลจ. ดำเนินการแยกทรัพย์สินดังกล่าว บลจ. จะทำทะเบียนผู้ถือหน่วยลงทุน ณ วันทำการนั้น เพื่อใช้เป็นข้อมูลสำหรับการคืนเงินที่ บลจ. อาจได้รับจากทรัพย์สินที่ติดปัญหาด้านสภาพคล่องข้างต้นในอนาคต

7. การไม่ขายหรือไม่รับซื้อคืนหน่วยลงทุนตามคำสั่งที่รับไว้หรือจะหยุดรับคำสั่งซื้อหรือคำสั่งขายคืนหน่วยลงทุน (Suspension of dealings)

การระงับการซื้อขายหน่วยลงทุนเป็นการชั่วคราวเพื่อลดผลกระทบต่อ การบริหารสภาพคล่องของกองทุน และโดยเฉพาะเพื่อป้องกันไม่ ให้ปัญหารุนแรงมากขึ้นจนถึงขั้นปิดกอง จัดเป็นเครื่องมือที่มีผลกระทบสูง การใช้เครื่องมือถูกควบคุมดูแลจากสำนักงาน ก.ล.ด. เงื่อนไขของการนำมาใช้จะต้องคำนึงถึงประโยชน์โดยรวมของผู้ถือหน่วยลงทุน

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน เกียรตินาคินภัทร จำกัด

ข้อมูล ณ วันที่ 29 กุมภาพันธ์ 2567

กองทุนเปิดเคเคพี ดราสารหนี้พลัส
KKP FIXED INCOME PLUS FUND

หน่วยลงทุนชนิดเพื่อการออม
KKP PLUS-SSF

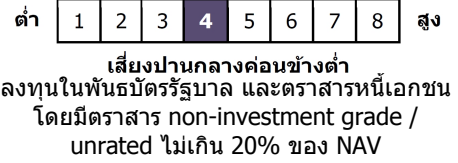
ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

กองทุนรวมตราสารหนี้ กองทุนรวมเพื่อการออม กองทุนที่ลงทุนแบบมีความเสี่ยงทั้งในและต่างประเทศ
กลุ่มกองทุนรวม : Short Term General Bond

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- กองทุนมีนโยบายลงทุนในตราสารหนี้ภาครัฐ และบริษัทเอกชนที่มีความมั่นคง และให้ผลตอบแทนที่ดี โดยกองทุนจะดำรงอายุถัวเฉลี่ยแบบถ่วงน้ำหนัก (Portfolio Duration) ไม่เกิน 1.5 ปี โดยเฉลี่ยรอบปีบัญชี โดยตราสารหนี้ภาคเอกชน ณ วันที่ลงทุน ต้องได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือ ตั้งแต่ BBB+ ขึ้นไป
- กองทุนอาจลงทุนในต่างประเทศไม่เกินร้อยละ 40 ของ NAV โดยกองทุนจะลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivative) เพื่อป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยนของเงินต้น และอัตราดอกเบี้ยที่คาดว่าจะได้รับ ณ วันที่กองทุนลงทุน ทั้งหมดหรือเกือบทั้งหมด โดยจะป้องกันความเสี่ยงอัตราแลกเปลี่ยนไม่น้อยกว่าร้อยละ 90 ของจำนวนเงินลงทุนในต่างประเทศ
- กองทุนอาจลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivative) เพื่อเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน (Efficient Portfolio Management) เฉพาะที่เป็นตราสารที่มีสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแฝง (Structured Note) ประเภทตราสารหนี้ Callable และตราสารหนี้ Puttable โดยมีการกำหนดผลตอบแทนไว้ อย่างแน่นอน หรือเป็นอัตราที่ผันแปรตามอัตราดอกเบี้ยของ สถาบันการเงินหรืออัตราดอกเบี้ยอื่น และไม่มีการกำหนดเงื่อนไขการจ่ายผลตอบแทนที่อ้างอิงกับปัจจัยอ้างอิงอื่นเพิ่มเติม
- กลยุทธ์การลงทุน: มุ่งหวังให้ผลประกอบการสูงกว่าดัชนีชี้วัด (Active Management) (กองทุนสามารถลงทุนในทรัพย์สินอื่นๆ ตามที่ระบุในนโยบายการลงทุนของกองทุน รวมถึงประเภทหลักทรัพย์ ในรายละเอียดโครงการจัดการกองทุนและหนังสือชี้ชวนส่วนข้อมูลโครงการโปรดศึกษารายละเอียดทั้งหมดเพิ่มเติม <https://am.kkpf.com>)

ระดับความเสี่ยง



ข้อมูลกองทุนรวม

- วันจดทะเบียนกองทุน : 23 พฤศจิกายน 2547
- วันเริ่มต้น class : 1 พฤศจิกายน 2564
- นโยบายจ่ายเงินปันผล : ไม่จ่าย
- อายุกองทุน : ไม่กำหนด

ผู้จัดการกองทุนรวม

- นายรัฐพล ชัดดียะสูงศ์ (ตั้งแต่ 1 ก.ย. 63)
- นายชวณัฐ ไพศาลวงศ์ดี (ตั้งแต่ 1 ส.ค. 61)

ดัชนีชี้วัด :

- (1) 30% ผลตอบแทนรวมของดัชนีพันธบัตรรัฐบาลระยะสั้นของสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย
- (2) 35% ดัชนีผลตอบแทนรวมตราสารหนี้ภาคเอกชนระยะสั้น (ThaiBMA Commercial Paper Index) ที่มีอันดับความน่าเชื่อถือของผู้ออกตราสารอยู่ในระดับ A- ขึ้นไป ของสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย
- (3) 5% ผลตอบแทนรวมสุทธิของดัชนีตราสารหนี้ภาคเอกชน Mark-to-Market ที่มีอันดับความน่าเชื่อถือของผู้ออกตราสารอยู่ในระดับ BBB+ ขึ้นไป อายุ 1 - 3 ปี ของสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย
- (4) 10% อัตราดอกเบี้ยเงินฝากประจำ 3 เดือน วงเงินน้อยกว่า 5 ล้านบาท เฉลี่ยของ 3 ธนาคารพาณิชย์ขนาดใหญ่ ได้แก่ ธนาคารกรุงเทพ ธนาคารกสิกรไทย และธนาคารไทยพาณิชย์ หลังหักภาษี
- (5) 20% ของ Overnight Indexed Swap (OIS) 3 เดือน หลังหักภาษี ปรับด้วยต้นทุนการป้องกันความเสี่ยงด้านอัตราแลกเปลี่ยนเพื่อคำนวณผลตอบแทนเป็นสกุลเงินบาท ณ วันที่ คำนวณผลตอบแทน

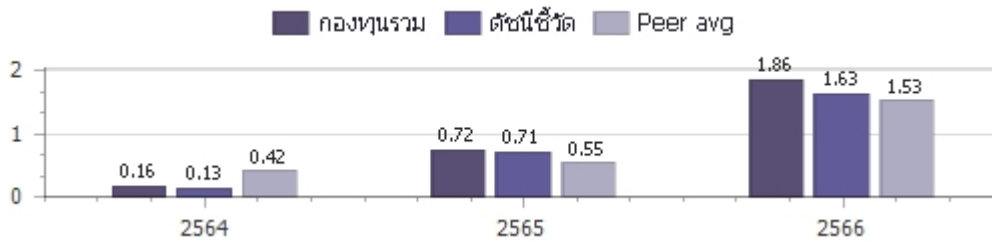
คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวม มิได้เป็นสัญญานยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต โปรดศึกษาค่าเดือนที่สำคัญอื่นในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต : ได้รับการรับรอง CAC

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน 1,2,3 (%ต่อปี)

(ข้อมูล ณ วันที่ 29 กุมภาพันธ์ 2567)



ผลการดำเนินการย้อนหลังแบบปีกumul 1,4 (%)

| | Year to Date | 3 เดือน | 6 เดือน | 1 ปี ⁴ |
|--------------------------|-------------------|-------------------|--------------------|-----------------------------------|
| กองทุนรวม | 0.46% | 0.65% | 1.24% | 2.11% |
| ตัวชี้วัด | 0.40% | 0.56% | 1.08% | 1.89% |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน | 0.43% | 0.63% | 1.16% | 1.81% |
| ความผันผวนของกองทุน | 0.11% | 0.13% | 0.12% | 0.10% |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด | 0.09% | 0.10% | 0.10% | 0.10% |
| | 3 ปี ⁴ | 5 ปี ⁴ | 10 ปี ⁴ | ตั้งแต่จัดตั้งกองทุน ⁴ |
| กองทุนรวม | | | | 1.37% |
| ตัวชี้วัด | | | | 1.23% |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน | | | | N/A |
| ความผันผวนของกองทุน | | | | 0.10% |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด | | | | 0.10% |

1. เอกสารการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวมฉบับนี้ ได้จัดทำตามมาตรฐานการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวมของสมาคมบริษัทจัดการลงทุน
2. หากกองทุนรวมมีผลการดำเนินงานตั้งแต่วันที่จดทะเบียนทรัพย์สินกองทุนรวมหรือวันที่เปิดเสนอขายชนิดหน่วยลงทุนไม่ครบ 1 ปีปฏิทิน จะแสดงผลการดำเนินงานของปีปฏิทินแรกตั้งแต่วันที่กองทุนรวมจดทะเบียนทรัพย์สินกองทุนรวมหรือวันที่เปิดเสนอขายชนิดหน่วยลงทุนจนถึงวันทำการสุดท้ายของปีปฏิทินแรก
3. หากกองทุนรวมมีผลการดำเนินงานในปีที่เล็กกองทุนไม่ครบ 1 ปีปฏิทิน จะแสดงผลการดำเนินงานของปีปฏิทินสุดท้ายตั้งแต่วันที่ทำการสุดท้ายของปีปฏิทินก่อนหน้าจนถึงวันที่เล็กกองทุน
4. % ต่อปี

ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือบริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่องได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



<https://am.kkpf.com>

| การซื้อขายหน่วยลงทุน | | การขายคืนหน่วยลงทุน | | ข้อมูลเชิงสถิติ (ข้อมูล ณ วันที่ 29 กุมภาพันธ์ 2567) | |
|--------------------------|-------------------|-----------------------------|-------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|----------------|
| วันทำการซื้อ | : ทุกวันทำการ | วันทำการขายคืน | : ทุกวันทำการ | Maximum Drawdown | -0.07% |
| เวลาทำการ | : 8:30 - 16:00 น. | เวลาทำการ | : 8:30 - 15:30 น. | FX Hedging | 100.12% |
| การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ | : 1,000 บาท | การขายคืนขั้นต่ำ | : ไม่กำหนด | Recovering Period | 18 วัน |
| การซื้อครั้งถัดไปขั้นต่ำ | : 1,000 บาท | ยอดคงเหลือขั้นต่ำ | : 100 บาท / 10 หน่วย | อายุเฉลี่ยของตราสารหนี้ | 3 เดือน 30 วัน |
| | | ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน | : ภายใน 3 วันทำการ ¹ (ปัจจุบัน T+1) ² | อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน | 1.86 เท่า |

หมายเหตุ ¹ ถัดจากวันที่ส่งขายคืนหน่วยลงทุน

² ปัจจุบัน T+1 เฉพาะบัญชีรับเงินค่าขายคืนหน่วยลงทุนของ KKP Bank, SCB, BBL, KBank, BAY, TTB, KTB, CIMB Thai, LH Bank, UOB, Citibank และนำฝาก/นำส่งเช็ค T+1 สำหรับบัญชีธนาคารอื่นนอกเหนือจากที่ระบุข้างต้น (รายละเอียดอาจมีการเปลี่ยนแปลง)

T = วันทำการซื้อขาย

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (%ต่อปี ของ NAV) (ข้อมูล ณ วันที่ 29 กุมภาพันธ์ 2567)

| ค่าธรรมเนียม | สูงสุดไม่เกิน | เก็บจริง |
|---------------|---------------|----------|
| การจัดการ | 0.3000 % | 0.2354 % |
| รวมค่าใช้จ่าย | 0.4922 % | 0.3170 % |

หมายเหตุ 1. ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว

2. ค่าใช้จ่ายรวมที่เรียกเก็บจริง เป็นข้อมูลของรอบระยะเวลาบัญชี วันที่ 1 พ.ย. 65 - 31 ต.ค. 66

3. ผู้ลงทุนสามารถดูข้อมูลค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวมย้อนหลัง 3 ปี

ในหนังสือชี้ชวนส่วนข้อมูลกองทุน ได้ที่ <https://am.kkpf.com>

4. บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (%ต่อปี ของมูลค่าซื้อขาย) (ข้อมูล ณ วันที่ 29 กุมภาพันธ์ 2567)

| ค่าธรรมเนียม | สูงสุดไม่เกิน | เก็บจริง |
|-----------------------------|---------------------|----------|
| การขาย | ไม่มี | ไม่มี |
| การรับซื้อคืน | ไม่มี | ไม่มี |
| การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า | ไม่มี | ไม่มี |
| การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก | ไม่มี | ไม่มี |
| การโอนหน่วย | 20 บาท ต่อ 1 รายการ | ยกเว้น |

หมายเหตุ 1. ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว

2. บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ

* Yield to Maturity (YTM) อัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในตราสารหนี้ คำนวณจากดอกเบี้ยที่ได้รับจริง โดยมีได้ปรับสัดส่วนเครื่องมือป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยนซึ่งอาจทำให้ผลตอบแทนจริงลดลง/หรือ เพิ่มขึ้นจาก YTM ในรูปสกุลเงินบาทได้

* FX hedging สามารถมากกว่า 100% หากมีการทำสัญญาซื้อขายล่วงหน้า เพื่อป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน ของดอกเบี้ยที่จะได้รับ

การจัดสรรการลงทุนในต่างประเทศ

(ข้อมูล ณ วันที่ 29 กุมภาพันธ์ 2567)

| ประเทศ | %NAV |
|--------|-------|
| QATAR | 25.86 |
| JAPAN | 7.51 |

ผู้ออกตราสาร 5 อันดับแรก

(ข้อมูล ณ วันที่ 29 กุมภาพันธ์ 2567)

| ผู้ออก | %NAV |
|-----------------------------------------|-------|
| ธนาคารแห่งประเทศไทย | 25.16 |
| Doha Bank Q.P.S.C. | 15.18 |
| Government of Japan | 11.06 |
| QATAR NATIONAL BANK | 10.68 |
| บริษัท เจริญโภคภัณฑ์อาหาร จำกัด (มหาชน) | 4.80 |

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน

(ข้อมูล ณ วันที่ 29 กุมภาพันธ์ 2567)

| ประเภททรัพย์สิน | %NAV |
|------------------------------------------------------------------|-------|
| พันธบัตร, ตัวเงินค้ำ | 36.24 |
| เงินฝาก, บัตรเงินฝาก | 25.86 |
| ตัวแลกเงิน | 23.38 |
| หุ้นกู้ | 14.48 |
| สัญญาซื้อขายล่วงหน้า | 0.27 |
| ตราสารด้อยสิทธิเพื่อนับเป็นเงินกองทุนของธนาคารพาณิชย์ประเภทที่ 2 | 0.08 |
| Callable Bonds/ Puttable Bonds | 0.01 |
| สินทรัพย์และหนี้สินอื่น | -0.32 |

ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก

(ข้อมูล ณ วันที่ 29 กุมภาพันธ์ 2567)

| ชื่อทรัพย์สิน | %NAV |
|----------------------------------------------|------|
| พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย (CBF24513A) | 4.14 |
| JAPAN TREASURY DISC BILL (JP1742061Q17) | 3.56 |
| พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย (CBF24916A) | 2.86 |
| พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย (CBF24708A) | 2.79 |
| TERM DEPOSIT QATAR NATIONAL BANK (QNB24311A) | 2.77 |

การจัดสรรการลงทุนตามอันดับความน่าเชื่อถือ (%)

(ข้อมูล ณ วันที่ 29 กุมภาพันธ์ 2567)

| | ในประเทศ | national | international |
|-------------|----------|----------|---------------|
| GOV/AAA | 26.05 | 0.00 | 0.00 |
| AA | 5.76 | 1.11 | 0.00 |
| A | 23.73 | 0.00 | 21.74 |
| BBB | 6.48 | 0.00 | 15.18 |
| ต่ำกว่า BBB | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| unrated | 0.00 | 0.00 | 0.00 |

หมายเหตุ:ในการเปลี่ยนแปลงมูลค่าขั้นต่ำของการสั่งซื้อครั้งถัดไป บริษัทจัดการจะคำนึงถึงประโยชน์ของผู้ถือหน่วยลงทุนเป็นสำคัญ โดยบริษัทจัดการจะประกาศการเปลี่ยนแปลง และแจ้งให้ผู้ถือหน่วยลงทุนทราบล่วงหน้าอย่างชัดเจนถึงวันที่มีการเปลี่ยนแปลงมูลค่าขั้นต่ำของการสั่งซื้อ ครั้งถัดไป ค่าอธิบายเกี่ยวกับการเปลี่ยนแปลงและเหตุผลในการเปลี่ยนแปลงข้อมูลดังกล่าว ผ่านเว็บไซต์ของบริษัทจัดการ ภายในระยะเวลาที่ผู้ถือหน่วยลงทุนสามารถใช้ประโยชน์จากข้อมูลในการตัดสินใจลงทุนได้

คำอธิบาย

Maximum Drawdown เปรอ์เซ็นต์ผลขาดทุนสูงสุดของกองทุนรวมในระยะเวลา 5 ปีย้อนหลัง (หรือตั้งแต่จัดตั้งกองทุนกรณีที่ยังไม่ครบ 5 ปี) โดยวัดจากระดับ NAV ต่อหน่วยที่จุดสูงสุดไปจนถึงจุดต่ำสุดในช่วงที่ NAV ต่อหน่วยปรับตัวลดลง ค่า Maximum Drawdown เป็นข้อมูลที่ช่วยให้ทราบถึงความเสี่ยงที่อาจจะขาดทุนจากการลงทุนในกองทุนรวม

Recovering Period ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาดังแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลา นานเท่าใด

FX Hedging เปรอ์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลาหนึ่ง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่า การซื้อหลักทรัพย์กับผลรวมของมูลค่าการขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 1 ปีหารด้วยมูลค่า NAV ของกองทุนรวมเฉลี่ยในรอบระยะเวลาเดียวกัน กองทุนรวมที่มีค่า portfolio turnover สูง บ่งชี้ถึงการซื้อขายหลักทรัพย์บ่อยครั้งของผู้จัดการกองทุนและทำให้มีต้นทุนการซื้อขายหลักทรัพย์ที่สูง จึงต้องพิจารณาเปรียบเทียบกับผลการดำเนินงานของกองทุนรวมเพื่อประเมินความคุ้มค่าของการซื้อขายหลักทรัพย์ดังกล่าว

Sharpe Ratio อัตราส่วนระหว่างผลตอบแทนส่วนเพิ่มของกองทุนรวมเปรียบเทียบกับความเสี่ยงจากการลงทุน โดยคำนวณจากผลต่างระหว่างอัตราผลตอบแทนของ กองทุนรวมกับอัตราผลตอบแทนที่ปราศจากความเสี่ยง (risk-free rate) เปรียบเทียบกับค่าเบี่ยงเบนมาตรฐาน (standard deviation) ของกองทุนรวม ค่า Sharpe Ratio สะท้อนถึงอัตราผลตอบแทนที่กองทุนรวมควรได้รับเพิ่มขึ้นเพื่อชดเชยกับความเสี่ยงที่กองทุนรวมรับมา โดยกองทุนรวมที่มีค่า Sharpe Ratio สูงกว่าจะเป็นกองทุนที่มีประสิทธิภาพในการบริหารจัดการลงทุนที่ดีกว่า เนื่องจากได้รับผลตอบแทนส่วนเพิ่มที่สูงกว่าภายใต้ระดับความเสี่ยงเดียวกัน

Alpha ผลตอบแทนส่วนเกินของกองทุนรวมเมื่อเปรียบเทียบกับดัชนีชี้วัด (benchmark) โดยค่า Alpha ที่สูง หมายถึง กองทุนสามารถสร้างผลตอบแทนได้สูงกว่าดัชนีชี้วัด ซึ่งเป็นผลจากประสิทธิภาพของผู้จัดการกองทุนในการคัดเลือกหรือหาจังหวะการลงทุนในหลักทรัพย์ได้อย่างเหมาะสม

Beta ระดับและทิศทางของการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุน โดยเปรียบเทียบกับอัตราการเปลี่ยนแปลงของตลาด Beta น้อยกว่า 1 แสดงว่า หลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนน้อยกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด Beta มากกว่า 1 แสดงว่า หลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนมากกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด

Tracking Error อัตราผลตอบแทนของกองทุนมีประสิทธิภาพในการเลียนแบบดัชนีชี้วัด โดยหาก tracking error ต่ำ หมายถึง กองทุนรวมมีประสิทธิภาพในการสร้างผลตอบแทนให้ใกล้เคียงกับดัชนีชี้วัด กองทุนรวมที่มีค่า tracking error สูง จะมีอัตราผลตอบแทนโดยเฉลี่ยห่างจากดัชนีชี้วัดมากขึ้น

Yield to Maturity อัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในตราสารหนี้โดยถือจนครบกำหนดอายุ ซึ่งคำนวณจากดอกเบี้ยที่จะได้รับในอนาคต ตลอดอายุตราสารและเงินต้นที่จะได้รับคืน นำมาคิดลดเป็นมูลค่าปัจจุบัน โดยใช้วิธีอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมตราสารหนี้ คำนวณจากค่าเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักของ Yield to Maturity ของตราสารหนี้แต่ละตัวที่กองทุนมีการลงทุน และเนื่องจาก Yield to Maturity มีหน่วยมาตรฐานเป็นเปอร์เซ็นต์ต่อปี จึงสามารถนำไปใช้เปรียบเทียบอัตราผลตอบแทนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีนโยบายถือครองตราสารหนี้จนครบกำหนดอายุและมีลักษณะการลงทุนที่ใกล้เคียงกันได้

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน เกียรตินาคินภัทร จำกัด

โทรศัพท์ (66) 2305 9800 โทรสาร (66) 2305 9803-4 website : <https://am.kkpf.com>

ที่อยู่ : 209 อาคารเคเคพี ทาวเวอร์ เอ ชั้นที่ 17 ถนนสุขุมวิท 21 (อโศก)

แขวงคลองเตยเหนือ เขตวัฒนา กรุงเทพมหานคร 10110

คำเตือน/ข้อแนะนำ

- กรณีลงทุนในต่างประเทศ กองทุนนี้อาจมีความเสี่ยงที่ทางการของต่างประเทศอาจออกมาตรการในภาวะที่เกิดวิกฤตการณ์ที่ไม่ปกติ ทำให้กองทุนไม่สามารถนำเงินกลับเข้ามาในประเทศไทย ซึ่งอาจส่งผลให้ผู้ลงทุนไม่ได้รับคืนเงินตามระยะเวลาที่กำหนด
- กรณีลงทุนในต่างประเทศ กองทุนนี้มีความเสี่ยงจากการเปลี่ยนแปลงในเรื่องเศรษฐกิจ การเมือง และสังคมของประเทศที่กองทุนไปลงทุน กองทุนอาจลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งสัญญาซื้อขายล่วงหน้า และ/หรือ ตราสารที่มีสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแฝง กองทุนอาจมีความเสี่ยงมากกว่ากองทุนรวมที่ลงทุนในหลักทรัพย์อ้างอิงโดยตรง เนื่องจากใช้เงินลงทุนในจำนวนที่น้อยกว่าจึงมีกำไร/ขาดทุนสูงกว่าการลงทุนในหลักทรัพย์อ้างอิงโดยตรง
- ในกรณีที่กองทุนรวมลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า เพื่อการลดความเสี่ยงโดยสินค้าหรือตัวแปรของสัญญาซื้อขายล่วงหน้า นั้นไม่ใช่สิ่งเดียวกับทรัพย์สินที่ต้องการลดความเสี่ยง บริษัทจัดการจะใช้ข้อมูลในอดีตในการคำนวณค่าสัมบูรณ์ของค่าสัมประสิทธิ์สหสัมพันธ์ (absolute correlation coefficient) กองทุนรวมจึงมีความเสี่ยง หากสินค้าหรือตัวแปรที่สัญญาซื้อขายล่วงหน้าอ้างอิง (underlying) และทรัพย์สินที่ต้องการลดความเสี่ยงเคลื่อนไหวในทิศทางที่ไม่เป็นไปตามข้อมูลในอดีต ซึ่งอาจส่งผลให้การเข้าทำสัญญาซื้อขายล่วงหน้าไม่สามารถลดความเสี่ยงได้อย่างเต็มประสิทธิภาพ
- การลงทุนในหน่วยลงทุนมิใช่การฝากเงิน และมีความเสี่ยงของการลงทุน ผู้ลงทุนควรลงทุนในกองทุนเปิดเคเคพี ตราสารหนี้พลัส เมื่อเห็นว่าการลงทุนในกองทุนเปิดนี้เหมาะสมกับวัตถุประสงค์การลงทุนของผู้ลงทุน และผู้ลงทุนยอมรับความเสี่ยงที่อาจเกิดขึ้นจากการลงทุนได้
- ในกรณีหากกองทุนเปิดเคเคพี ตราสารหนี้พลัส มีการลงทุนในต่างประเทศ กองทุนจะทำการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยนทั้งหมด/หรือเกือบทั้งหมด
- การลงทุนมีความเสี่ยง ผู้ลงทุนควรทำความเข้าใจลักษณะสินค้า เงื่อนไขผลตอบแทน และความเสี่ยงก่อนตัดสินใจลงทุน

เครื่องมือบริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่อง

ผู้ลงทุนสามารถศึกษารายละเอียด หลักเกณฑ์ และเงื่อนไขการใช้งานของแต่ละเครื่องมือบริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่องได้ในรายละเอียดโครงการ และหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม ที่ <https://am.kkpfpg.com>

กลุ่มเครื่องมือที่ส่งผ่านภาระค่าใช้จ่ายให้ผู้ลงทุน

1. ค่าธรรมเนียมการรักษาสภาพคล่อง (Liquidity Fee)

เครื่องมือที่สะท้อนต้นทุนของกองทุนที่เกิดขึ้นในภาวะที่ตลาดมีความผันผวนสูงหรือมีการขายคืนหน่วยลงทุนหรือมีการสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออกของกองทุนนั้น ๆ สูงเกินกว่าปกติ โดยจะเรียกเก็บค่าธรรมเนียมเฉพาะ "ผู้ขาย" หรือผู้สับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออกในจำนวนที่เกินกว่าปริมาณและ/หรือ ก่อนระยะเวลาที่กำหนด และเป็น การเรียกเก็บเข้ากองทุน

2. การปรับมูลค่าทรัพย์สินสุทธิด้วยสูตรการคำนวณที่สะท้อนต้นทุนในการซื้อขายทรัพย์สินของกองทุนรวม (Swing Pricing)

เครื่องมือใช้ปรับมูลค่าหน่วยลงทุน เพื่อให้สะท้อนต้นทุนการซื้อขายของกองทุนในภาวะที่ตลาดมีความผันผวน โดยเพิ่มตัวแปร (Swing Factor) ที่ช่วยสะท้อนต้นทุนค่าใช้จ่ายและใช้ตัวแปรนั้นช่วยในการปรับมูลค่าหน่วยลงทุน นอกจากนี้ กองทุนอาจเลือกใช้ Swing Pricing เฉพาะช่วงเวลาที่มีการซื้อขายสุทธิเกินกว่าที่กำหนดไว้ (Partial swing pricing) หรือสามารถใช้ทุกวันในช่วงที่ตลาดมีความผันผวน (Full swing pricing) ขึ้นอยู่กับการกำหนดเงื่อนไขในการใช้เครื่องมือตามลักษณะและสินทรัพย์หรือต้นทุนที่เกิดขึ้นกับกองทุนรวม นั้น ๆ

3. การเพิ่มค่าธรรมเนียมการซื้อขายหน่วยลงทุนที่สะท้อนต้นทุนในการซื้อขายทรัพย์สินของกองทุนรวม (Anti-Dilution Levies - ADLs)

เครื่องมือที่ทำให้การซื้อขายหน่วยลงทุนสะท้อนต้นทุนที่เกี่ยวข้องจากการปรับพอร์ตของกองทุน ในภาวะตลาดผันผวนสูงผิดปกติหรือสภาพคล่องผิดปกติ หรือเกิดเหตุการณ์อื่นที่อาจจะกระทบต่อต้นทุนและค่าใช้จ่ายของกองทุนรวม โดยกองทุนจะกำหนดมูลค่าซื้อขายสุทธิเป็นเกณฑ์ของเครื่องมือ ถ้ามีการซื้อขายหรือสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเกินกว่าระดับที่กำหนด กองทุนจะมีการเรียกเก็บค่าธรรมเนียมเพิ่มเติมเข้ากองทุน และการคิดค่าธรรมเนียมอาจเกิดขึ้นได้ทั้งจากผู้ซื้อ/สับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า หรือจาก ผู้ขาย/สับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออกก็ได้ ซึ่งขึ้นอยู่กับปริมาณธุรกรรมที่เกิดขึ้นตามเงื่อนไขที่ บลจ. กำหนด

กลุ่มเครื่องมือที่จำกัดคำสั่งรับซื้อคืนหน่วยลงทุน

4. ระยะเวลาที่ต้องแจ้งล่วงหน้าก่อนการขายคืนหน่วยลงทุน (Notice Period)

เครื่องมือที่จะกำหนดระยะเวลาในการส่งคำสั่งเพื่อทำการขายคืนหรือสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออกไว้ล่วงหน้าหากผู้ถือหน่วยทำการที่เกินกว่าปริมาณที่กำหนด เพื่อให้กองทุนมีเวลาในการเตรียมขายสินทรัพย์เพื่อมาชำระค่าขายคืนหน่วยลงทุน

5. เพดานการขายคืนหน่วยลงทุน (Redemption Gate)

เป็นเครื่องมือที่กำหนดเพดานมูลค่าที่จะให้ผู้ถือหน่วยลงทุนขายคืนหน่วยลงทุนหรือสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออกได้ในแต่ละกองทุน เมื่อเกิดสถานการณ์ไม่ปกติ หรือ ประเมินว่าสถานการณ์อาจจะไม่ปกติ โดย บลจ. จะใช้วิธีการชำระคืนตามสัดส่วน หรือที่เรียกว่า Pro rata สำหรับคำสั่งขายคืนหน่วยลงทุนหรือสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออกที่เหลือ จะทำการขายคืนให้ในวันทำการถัดไป หากวันทำการถัดไป บลจ. ยังคงใช้เครื่องมือนี้ บลจ. จะชำระคืนตามวิธี Pro rata โดยไม่มีการจัดลำดับก่อนหลัง แต่หากวันทำการถัดไปกองทุนมีสภาพคล่องเพียงพอ ทำให้ บลจ. ไม่ต้องใช้เครื่องมือนี้ บลจ. จะชำระคืนตามรายการขายคืนหน่วยลงทุนหรือสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออกที่ได้รับไว้ทั้งหมด

6. การดำเนินการในกรณีที่ผู้ออกตราสารหนี้หรือลูกหนี้ตามสิทธิเรียกร้องผิดนัดชำระหนี้ หรือตราสารที่ลงทุนประสบปัญหาขาดสภาพคล่องหรือไม่สามารถจำหน่ายได้ด้วยราคาที่เหมาะสมผล (Side Pocket)

เครื่องมือที่ทำให้กองทุนรวมสามารถแยกสินทรัพย์ที่มีปัญหา ด้านสภาพคล่อง ออกจากทรัพย์สินโดยรวมของกองทุน โดยในวันที่ บลจ. ดำเนินการแยกทรัพย์สินดังกล่าว บลจ. จะทำทะเบียนผู้ถือหน่วยลงทุน ณ วันทำการนั้น เพื่อใช้เป็นข้อมูลสำหรับการคืนเงินที่ บลจ. อาจได้รับจากทรัพย์สินที่ติดปัญหาด้านสภาพคล่องข้างต้นในอนาคต

7. การไม่ขายหรือไม่รับซื้อคืนหน่วยลงทุนตามคำสั่งที่รับไว้หรือจะหยุดรับคำสั่งซื้อหรือคำสั่งขายคืนหน่วยลงทุน (Suspension of dealings)

การระงับการซื้อขายหน่วยลงทุนเป็นการชั่วคราวเพื่อลดผลกระทบต่อการบริหารสภาพคล่องของกองทุน และโดยเฉพาะเพื่อป้องกันไม่ให้เกิดปัญหารุนแรงมากขึ้นจนถึงขั้นปิดกอง จัดเป็นเครื่องมือที่มีผลกระทบสูง การใช้เครื่องมือถูกควบคุมดูแลจากสำนักงาน ก.ล.ด. เงื่อนไขของการนำมาใช้จะต้องคำนึงถึงประโยชน์โดยรวมของผู้ถือหน่วยลงทุน