

**กองทุนเปิดกรุงไทยหุ้น เอ็ม เอ ไอ**  
 Krung Thai mai Equity Fund

KT-mai

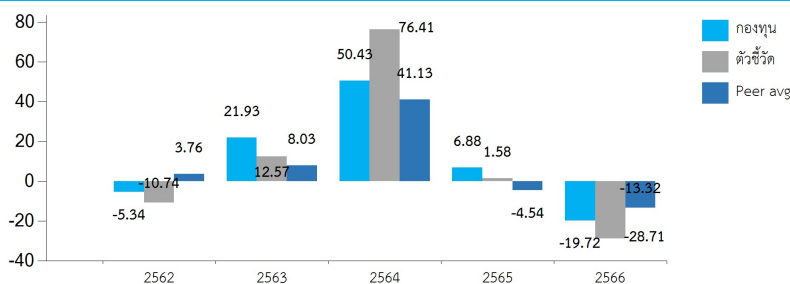
## ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมตราสารแห่งทุน
- กองทุนที่ลงทุนแบบไม่มีความเสี่ยงต่างประเทศ
- กลุ่ม Equity Small - Mid Cap

## นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- เน้นลงทุนในหลักทรัพย์ตราสารทุนของบริษัทที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ เอ็ม เอ ไอ ที่มีแนวโน้มการเจริญเติบโตที่ดีในอนาคต โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของ NAV
- กองทุนอาจพิจารณาลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) เพื่อลดความเสี่ยง (Hedging)
- มุ่งหวังให้ผลประกอบการสูงกว่าดัชนีชี้วัด (active management)

## ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (%ต่อปี)



## ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด

	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี*	3 ปี*	5 ปี*	10 ปี*	ตั้งแต่จัดตั้ง*
กองทุน	-7.90	-6.45	-6.12	-21.05	-2.18	7.33		0.68
ดัชนีชี้วัด	-6.45	-7.24	-2.29	-20.97	-6.25	4.35		-4.05
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	-2.06	-0.63	1.43	-9.83	-3.60	3.63		
ความผันผวนกองทุน	12.19	11.64	12.76	14.70	17.07	19.37		18.23
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	14.13	12.71	14.58	17.20	18.31	18.39		17.03

หมายเหตุ : \* % ต่อปี

## ระดับความเสี่ยง

ต่ำ 1 2 3 4 5 6 7 8 สูง

เสี่ยงสูง

กองทุนรวมตราสารทุน ที่มี net exposure ในตราสารทุนเป็นหลักโดยเฉลี่ยรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของ NAV

## ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน 08/07/58

วันเริ่มต้น class N/A

นโยบายการจ่ายเงินปันผล ไม่มี

อายุกองทุน ไม่กำหนดอายุโครงการ

## ผู้จัดการกองทุนรวม

นาย ชนิต คงพัฒนศิริ ตั้งแต่ 03/04/60

## ดัชนีชี้วัด

ดัชนีผลตอบแทนรวมตลาดหลักทรัพย์เอ็ม เอ ไอ (mai TRI) สัดส่วน 100%

## คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวม มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต : ได้รับการรับรองจาก CAC

จัดอันดับกองทุน

MORNINGSTAR ★★★★★

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือบริหาร

ความเสี่ยงด้านสภาพคล่องได้ในหนังสือชี้

ชวนฉบับเต็ม

[www.ktam.co.th](http://www.ktam.co.th)

การซื้อขายหน่วยลงทุน	การขายคืนหน่วยลงทุน
วันทำการซื้อ : ทุกวันทำการ	วันทำการขายคืน : ทุกวันทำการ
เวลาทำการ : 8:30 - 15:30	เวลาทำการ : 8:30 - 15:30
การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ : 1,000 บาท	การขายคืนขั้นต่ำ : ไม่กำหนด
การซื้อครั้งถัดไปขั้นต่ำ : 1,000 บาท	ยอดคงเหลือขั้นต่ำ : ไม่กำหนด
	ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน : T+3 คือ 3 วันทำการหลังจากวันทำรายการขายคืน

หมายเหตุ :

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)		
ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	2.1400	2.1400
รวมค่าใช้จ่าย	3.7450	2.5200

หมายเหตุ : \* เป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะ หรือภาษีอื่นใดในทำนองเดียวกัน \*\*รวมค่าใช้จ่าย (เก็บจริง) เป็นของรอบปีบัญชีที่ผ่านมา

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)		
ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การขาย	3.000	1.000
การรับซื้อคืน	3.000	ยังไม่เรียกเก็บ
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า	3.000	1.000
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก	3.000	ยังไม่เรียกเก็บ
การโอนหน่วย	ดูหมายเหตุเพิ่มเติม	ดูหมายเหตุเพิ่มเติม

หมายเหตุ : \* เป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะ หรือภาษีอื่นใดในทำนองเดียวกัน \*\* ค่าธรรมเนียมการโอนหน่วยลงทุน ตามที่นายทะเบียนเรียกเก็บ

ข้อมูลเชิงสถิติ	
Maximum Drawdown	-41.15 %
Recovering Period	5 เดือน
FX Hedging	N/A
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน	1.89 เท่า
Sharpe Ratio	-0.12
Alpha	4.07
Beta	0.76

การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม	
กลุ่มอุตสาหกรรม	% NAV
บริการ	34.10
เทคโนโลยี	20.71
เกษตรและอุตสาหกรรมอาหาร	17.80
สินค้าอุปโภคบริโภค	6.43
ทรัพยากร	2.40

หมายเหตุ :

## สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน

ทรัพย์สิน	% NAV
หุ้นสามัญ	84.88
เงินฝากธนาคาร	14.18
สินทรัพย์และหนี้สินอื่นๆ	0.94

หมายเหตุ :

## ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก

ทรัพย์สิน	% NAV
บมจ. ที.เอ.ซี. คอนซูเมอร์	7.74
บมจ. เอ็กโซติค ฟู้ด	6.56
บมจ.เมพ คอร์ปอเรชั่น	6.40
บมจ.มาสเตอร์ สไตล์	6.15
บมจ.เดอะคลินิกส์ คลินิกเวชกรรม	5.53

หมายเหตุ :

## คำอธิบาย

**Maximum Drawdown** เปรอ์เซ็นต์ผลขาดทุนสูงสุดของกองทุนรวมในระยะเวลา 5 ปีย้อนหลัง (หรือตั้งแต่จัดตั้งกองทุนกรณีที่ยังไม่ครบ 5 ปี) โดยวัดจากระดับ NAV ต่อหน่วยที่จุดสูงสุด ไปจนถึงจุดต่ำสุดในช่วงที่ NAV ต่อหน่วยปรับตัวลดลงค่า Maximum Drawdown เป็นข้อมูลที่ช่วยให้ทราบถึงความเสี่ยงที่อาจขาดทุนจากการลงทุนในกองทุนรวม

**Recovering Period** ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาตั้งแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลานานเท่าใด

**FX Hedging** เปรอ์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

**อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน** ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตลงทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลาหนึ่ง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์กับ ผลรวมของมูลค่าการขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 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 ซึ่งเป็นผลจากประสิทธิภาพของผู้จัดการกองทุนในการคัดเลือกหรือหาจังหวะเข้าลงทุนในหลักทรัพย์ได้อย่างเหมาะสม

**Beta** ระดับและทิศทางการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุน โดยเปรียบเทียบกับอัตราการเปลี่ยนแปลงของตลาด Beta น้อยกว่า 1 แสดงว่า หลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนน้อยกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด Beta มากกว่า 1 แสดงว่า หลักทรัพย์ ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนมากกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด

**Tracking Error** อัตราผลตอบแทนของกองทุนมีประสิทธิภาพในการเลียนแบบดัชนีชี้วัด โดยหาก tracking error ต่ำ หมายถึงกองทุนรวมมีประสิทธิภาพในการสร้างผลตอบแทนให้ใกล้เคียงกับดัชนีชี้วัด กองทุนรวมที่มีค่า tracking error สูง จะมีอัตราผลตอบแทนโดยเฉลี่ยห่างจากดัชนีชี้วัดมากขึ้น

**Yield to Maturity** อัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในตราสารหนี้โดยถือจนครบกำหนดอายุ ซึ่งคำนวณจากดอกเบี้ยที่ได้รับในอนาคตตลอดอายุตราสารและเงินต้นที่จะได้รับคืน นำมาคิดลดเป็นมูลค่าปัจจุบัน โดยใช้วัดอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมตราสารหนี้ คำนวณจากค่าเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักของ Yield to Maturity ของตราสารหนี้แต่ละตัวที่กองทุนมีการลงทุน และเนื่องจาก Yield to Maturity มีหน่วยมาตรฐานเป็นเปอร์เซ็นต์ต่อปีจึงสามารถนำไปใช้เปรียบเทียบอัตราผลตอบแทนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีนโยบายถือครอง ตราสารหนี้จนครบกำหนดอายุและมีลักษณะการลงทุนที่ใกล้เคียงกันได้

ข้อมูล Morningstar Rating ณ วันที่ 31/05/2567

© สงวนลิขสิทธิ์ 2566 บริษัท มอร์นิ่งสตาร์ รีเสิร์ช ประเทศไทย ข้อมูลนี้ (1) เป็นกรรมสิทธิ์ของบริษัทมอร์นิ่งสตาร์ และ/หรือ ผู้ให้บริการข้อมูล (2) ขอสงวนสิทธิ์ในการลอกเลียน หรือเผยแพร่ (3) ขอสงวนสิทธิ์ที่จะไม่รับผิดชอบต่อความถูกต้อง ครบถ้วน และความเสียหายต่างๆ ที่เกิดขึ้นทุกกรณีจากการนำข้อมูลไปใช้อ้างอิง, ผลการดำเนินงานในอดีตมิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต.

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงไทย จำกัด (มหาชน)

โทรศัพท์ 0-2686-6100 แฟกซ์ 0-2670-0430 www.ktam.co.th

เลขที่ 1 อาคารเอ็มไพร์ทาวเวอร์ ชั้น 32 ถนนสาทรใต้ แขวงยานนาวา เขตสาทร กรุงเทพมหานคร 10120