

กองทุนเปิดกรุงไทยสุขใจ

Krung Thai Suk Jai Fund

KTSUK-A

ชนิดสะสมมูลค่า

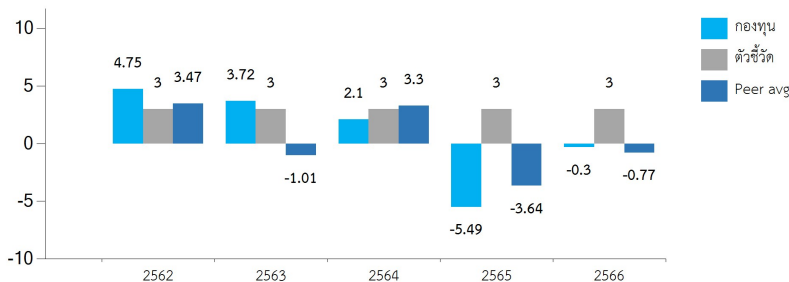
ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมผสม,กองทุนที่มีนโยบายลงทุนในกองทุนรวมภายใต้ บลจ.เดียวกัน
- กองทุนรวมหน่วยลงทุน (Fund of Funds),กองทุนรวมที่ลงทุนแบบมีความเสี่ยงทั้งในและต่างประเทศ
- กลุ่ม Conservative Allocation

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- กองทุนจะลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวม กองทุนรวมโครงสร้างพื้นฐาน หรือ กองทุน property (กองทุนปลายทาง) ทั้งในและต่างประเทศ ตั้งแต่ 2 กองทุนขึ้นไป โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของ NAV โดยกองทุนปลายทางดังกล่าวมีนโยบายลงทุนทั้งในตราสารทุน ตราสารหนี้ ทรัพย์สินทางเลือก
- กองทุนอาจลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมอื่น ซึ่งอยู่ภายใต้การจัดการของบริษัทจัดการ ในสัดส่วนไม่เกินร้อยละ 100 ของ NAV
- กองทุนอาจลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า เพื่อเป็นการเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน
- มุ่งหวังให้ผลประกอบการสูงกว่าดัชนีชี้วัด (active management)

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (%ต่อปี)



ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด

	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี*	3 ปี*	5 ปี*	10 ปี*	ตั้งแต่จัดตั้ง*
กองทุน	0.62	2.22	1.70	0.10	-1.14	0.78		0.70
ดัชนีชี้วัด	0.51	0.74	1.48	3.00	3.00	3.00		3.00
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	0.23	1.37	0.09	-0.55	-0.52	0.07		
ความผันผวนกองทุน	1.79	1.98	2.77	2.99	2.71	2.55		2.40
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	0.13	0.13	0.12	0.13	0.12	0.12		0.12

หมายเหตุ : * % ต่อปี

ระดับความเสี่ยง

ต่ำ 1 2 3 4 5 6 7 8 สูง

เสี่ยงปานกลางค่อนข้างสูง

กองทุนรวมผสม ที่มี net exposure ได้ทั้งในตราสารทุน ตราสารหนี้ หรือทรัพย์สินทางเลือก

ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน 29/03/61

วันเริ่มต้น class 29/03/61

นโยบายการจ่ายเงินปันผล ไม่มี

อายุกองทุน ไม่กำหนดอายุโครงการ

ผู้จัดการกองทุนรวม

นาย สมชัย อมรรธรรม ตั้งแต่ 08/04/61

ดัชนีชี้วัด

อัตราผลตอบแทนร้อยละ 3 ต่อปี สัดส่วน 100%

คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวม ไม่ได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต : ได้รับการรับรองจาก CAC

จัดอันดับกองทุน

MORNINGSTAR ★★★

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือบริหาร

ความเสี่ยงด้านสภาพคล่องได้ในหนังสือชี้

ชวนฉบับเต็ม

www.ktam.co.th

การซื้อหน่วยลงทุน	การขายคืนหน่วยลงทุน
วันทำการซื้อ : ทุกวันทำการซื้อขาย	วันทำการขายคืน : ทุกวันทำการซื้อขาย
เวลาทำการ : 8:30 - 12:00	เวลาทำการ : 8:30 - 12:00
การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ : 1,000 บาท	การขายคืนขั้นต่ำ : ไม่กำหนด
การซื้อครั้งถัดไปขั้นต่ำ : 1,000 บาท	ยอดคงเหลือขั้นต่ำ : ไม่กำหนด
ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน : T+5 คือ 5 วันทำการนับจากวันคำนวณ NAV	

ข้อมูลเชิงสถิติ	
Maximum Drawdown	-10.14 %
Recovering Period	N/A
FX Hedging	N/A
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน	0.72 เท่า

หมายเหตุ : โดยทั่วไปจะได้รับเงินค่าขายคืน T+5 คือ 5 วันทำการหลังจากวันทำการขายคืน

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)		
ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	2.1400	0.5350
รวมค่าใช้จ่าย	5.3500	0.3900

หมายเหตุ : * เป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะ หรือภาษีอื่นใดในทำนองเดียวกัน ** ค่าธรรมเนียมการจัดการข้างต้นเป็นอัตราที่บริษัทจัดการกำหนด โดยหากกองทุนลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมภายใต้การจัดการเดียวกัน (กองทุนปลายทาง) บริษัทจัดการจะไม่เรียกเก็บค่าธรรมเนียมการจัดการซ้ำซ้อนกับกองทุนปลายทาง (ค่าธรรมเนียมการจัดการข้างต้นยังมิได้มีการคิดค่าธรรมเนียมการจัดการที่ซ้ำซ้อนกัน โดยผู้ถือหน่วยลงทุนสามารถเรียกดูค่าใช้จ่ายที่เก็บจริงของรอบปีบัญชีที่ผ่านมาได้ที่หนังสือชี้ชวนส่วนข้อมูลกองทุนรวม) *** รวมค่าใช้จ่าย (เก็บจริง) เป็นของรอบปีบัญชีที่ผ่านมา ได้รวมค่าธรรมเนียมการจัดการ โดยไม่เรียกเก็บค่าธรรมเนียมซ้ำซ้อนกับกองทุนปลายทางกรณีลงทุนในกองทุนภายใต้การจัดการเดียวกัน เรียบร้อยแล้ว

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)		
ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การขาย	2.14	0.27
การรับซื้อคืน	2.14	ดูหมายเหตุเพิ่มเติม
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า	2.14	0.27
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก	2.14	ดูหมายเหตุเพิ่มเติม
การโอนหน่วย	ดูหมายเหตุเพิ่มเติม	ดูหมายเหตุเพิ่มเติม

หมายเหตุ : *ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว ** ค่าธรรมเนียมการรับซื้อคืนและสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก กรณีถือครองหน่วยลงทุนน้อยกว่า 1 ปี เรียกเก็บสูงสุดไม่เกิน 2.14 (ปัจจุบันเรียกเก็บ 0.2675) กรณีถือครองหน่วยลงทุนตั้งแต่ 1 ปีขึ้นไป เรียกเก็บสูงสุดไม่เกิน 2.14 (ปัจจุบันยังไม่เรียกเก็บ) ***หากกองทุนลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมภายใต้การจัดการเดียวกัน (กองทุนปลายทาง) บริษัทจัดการจะไม่เรียกเก็บค่าธรรมเนียมการขายและ/หรือค่าธรรมเนียมการรับซื้อคืนหน่วยลงทุนซ้ำซ้อนกับกองทุนปลายทาง ****ค่าธรรมเนียมการโอนหน่วยลงทุน ตามที่นายทะเบียนเรียกเก็บ

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน

ทรัพย์สิน	% NAV
หน่วยลงทุน ตราสารหนี้	72.85
หน่วยลงทุน ตราสารทุน	14.75
เงินฝากธนาคาร	7.16
หน่วยลงทุนในกองทุนรวมแบบผสม	2.97
หน่วยลงทุนในทรัสต์เพื่อการลงทุนอสังหาริมทรัพย์	1.23
หน่วยลงทุนในกองทุนรวมโครงสร้างพื้นฐาน	0.86
หน่วยลงทุนในกองทุนรวมอสังหาริมทรัพย์	0.78
สินทรัพย์และหนี้สินอื่นๆ	-0.60

หมายเหตุ :

ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก

ทรัพย์สิน	% NAV
กองทุนเปิดกรุงไทยตราสารหนี้ระยะ 1 ถึง 3 ปี	30.68
กองทุนเปิดกรุงไทยตราสารหนี้ พลัส-A	24.60
กองทุนเปิดกรุงไทยตราสารหนี้ระยะสั้น พลัส-A	17.57
กองทุนเปิดเคแอม โกลบอล อีควิตี้ พาสซีฟ ฟันด์-A	6.70
กองทุนเปิดกรุงไทย สตราทีจิค แอคทีฟ โกลบอล แอลโลเคชั่น	2.97

หมายเหตุ :

การลงทุนในกองทุนอื่นเกินกว่า 20% (กองในประเทศ และหรือกองต่างประเทศ)

ชื่อกองทุน : กองทุนเปิดกรุงไทยตราสารหนี้ระยะ 1 ถึง 3 ปี

web link : <https://www.ktam.co.th/mutual-fund-detail-document.aspx?IdF=50>



ชื่อกองทุน : กองทุนเปิดกรุงไทยตราสารหนี้ พลัส-A

web link : <https://www.ktam.co.th/mutual-fund-detail-document.aspx?IdF=53>



คำอธิบาย

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

Recovering Period ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาดังแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลานานเท่าใด

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 28/02/2567

© 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

กองทุนเปิดกรุงไทยสุขใจ

Krung Thai Suk Jai Fund

KTSUK-D

ชนิดจ่ายเงินปันผล

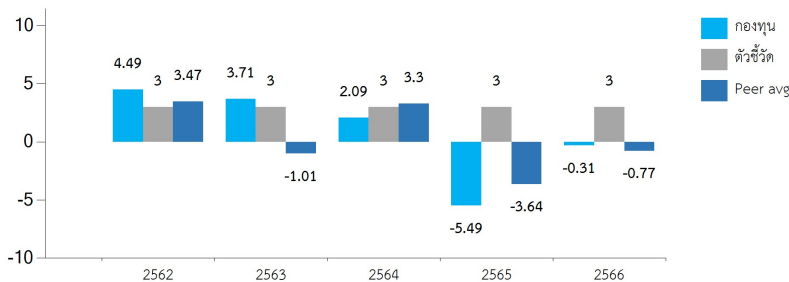
ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมผสม,กองทุนที่มีนโยบายเปิดให้มีการลงทุนในกองทุนรวมอื่นภายใต้ บลจ.เดียวกัน
- กองทุนรวมหน่วยลงทุน (Fund of Funds),กองทุนรวมที่เน้นลงทุนแบบมีความเสี่ยงต่างประเทศ
- กลุ่ม Conservative Allocation

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- กองทุนจะลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวม กองทุนรวมโครงสร้างพื้นฐาน หรือ กองทุน property (กองทุนปลายทาง) ทั้งในและต่างประเทศ ตั้งแต่ 2 กองทุนขึ้นไป โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของ NAV โดยกองทุนปลายทางดังกล่าวมีนโยบายลงทุนทั้งในตราสารทุน ตราสารหนี้ ทรัพย์สินทางเลือก
- กองทุนอาจลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมอื่น ซึ่งอยู่ภายใต้การจัดการของบริษัทจัดการ ในสัดส่วนไม่เกินร้อยละ 100 ของ NAV
- กองทุนอาจลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า เพื่อเป็นการเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน
- มุ่งหวังให้ผลประกอบการสูงกว่าดัชนีชี้วัด (active management)

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (%ต่อปี)



ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด

	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี*	3 ปี*	5 ปี*	10 ปี*	ตั้งแต่จัดตั้ง*
กองทุน	0.62	2.22	1.70	0.10	-1.15	0.76		0.88
ดัชนีชี้วัด	0.51	0.74	1.48	3.00	3.00	3.00		3.00
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	0.23	1.37	0.09	-0.55	-0.52	0.07		
ความผันผวนกองทุน	1.79	1.98	2.77	2.99	2.71	2.55		2.51
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	0.13	0.13	0.12	0.13	0.12	0.12		0.12

หมายเหตุ : * % ต่อปี

ระดับความเสี่ยง



เสี่ยงปานกลางค่อนข้างสูง

*ความเสี่ยงของกองทุน ระดับ 5 หมายถึง กองทุนรวมผสม ที่มี net exposure ได้ทั้งในตราสารทุน ตราสารหนี้ หรือทรัพย์สินทางเลือก

ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน 29/03/61

วันเริ่มต้น class 29/10/61

นโยบายการจ่ายเงินปันผล มี

อายุกองทุน ไม่กำหนดอายุโครงการ

ผู้จัดการกองทุนรวม

นาย สมชัย อมรรธรรม ตั้งแต่ 29/10/61

ดัชนีชี้วัด

อัตราผลตอบแทนร้อยละ 3 ต่อปี สัดส่วน 100%

คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวม ไม่ได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต : ได้รับการรับรองจาก CAC

จัดอันดับกองทุน

MORNINGSTAR ★★★

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือบริหาร

ความเสี่ยงด้านสภาพคล่องได้ในหนังสือชี้

ชวนฉบับเต็ม

www.ktam.co.th

การซื้อขายหน่วยลงทุน	การขายคืนหน่วยลงทุน
วันทำการซื้อ : ทุกวันทำการซื้อขาย	วันทำการขายคืน : ทุกวันทำการซื้อขาย
เวลาทำการ : 8:30 - 12:00	เวลาทำการ : 8:30 - 12:00
การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ : 1,000 บาท	การขายคืนขั้นต่ำ : ไม่กำหนด
การซื้อครั้งถัดไปขั้นต่ำ : 1,000 บาท	ยอดคงเหลือขั้นต่ำ : ไม่กำหนด
ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน : T+5 คือ 5 วันทำการนับจากวันคำนวณ NAV	

ข้อมูลเชิงสถิติ	
Maximum Drawdown	-10.15 %
Recovering Period	N/A
FX Hedging	N/A
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน	0.72 เท่า

หมายเหตุ : โดยทั่วไปจะได้รับเงินค่าขายคืน T+5 คือ 5 วันทำการหลังจากวันทำการขายคืน

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	2.1400	0.5350
รวมค่าใช้จ่าย	5.3500	0.3900

หมายเหตุ : * เป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะ หรือภาษีอื่นใดในทำนองเดียวกัน ** ค่าธรรมเนียมการจัดการข้างต้นเป็นอัตราที่บริษัทจัดการกำหนด โดยหากกองทุนลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมภายใต้การจัดการเดียวกัน (กองทุนปลายทาง) บริษัทจัดการจะไม่เรียกเก็บค่าธรรมเนียมการจัดการซ้ำซ้อนกับกองทุนปลายทาง (ค่าธรรมเนียมการจัดการข้างต้นยังมิได้มีการคิดค่าธรรมเนียมการจัดการที่ซ้ำซ้อนกัน โดยผู้ถือหน่วยลงทุนสามารถเรียกดูค่าใช้จ่ายที่เก็บจริงของรอบปีบัญชีที่ผ่านมาได้ที่หนังสือชี้ชวนส่วนข้อมูลกองทุนรวม) *** รวมค่าใช้จ่าย (เก็บจริง) เป็นของรอบปีบัญชีที่ผ่านมา ได้รวมค่าธรรมเนียมการจัดการ โดยไม่เรียกเก็บค่าธรรมเนียมซ้ำซ้อนกับกองทุนปลายทางกรณีลงทุนในกองทุนภายใต้การจัดการเดียวกัน เรียบร้อยแล้ว

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การขาย	2.14	0.27
การรับซื้อคืน	2.14	ดูหมายเหตุเพิ่มเติม
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า	2.14	0.27
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก	2.14	ดูหมายเหตุเพิ่มเติม
การโอนหน่วย	ดูหมายเหตุเพิ่มเติม	ดูหมายเหตุเพิ่มเติม

หมายเหตุ : *ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว ** ค่าธรรมเนียมการรับซื้อคืนและสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก กรณีถือครองหน่วยลงทุนน้อยกว่า 1 ปี เรียกเก็บสูงสุดไม่เกิน 2.14 (ปัจจุบันเรียกเก็บ 0.2675) กรณีถือครองหน่วยลงทุนตั้งแต่ 1 ปีขึ้นไป เรียกเก็บสูงสุดไม่เกิน 2.14 (ปัจจุบันยังไม่เรียกเก็บ) ***หากกองทุนลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมภายใต้การจัดการเดียวกัน (กองทุนปลายทาง) บริษัทจัดการจะไม่เรียกเก็บค่าธรรมเนียมการขายและ/หรือค่าธรรมเนียมการรับซื้อคืนหน่วยลงทุนซ้ำซ้อนกับกองทุนปลายทาง ****ค่าธรรมเนียมการโอนหน่วยลงทุน ตามที่นายทะเบียนเรียกเก็บ

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน

ทรัพย์สิน	% NAV
หน่วยลงทุน ตราสารหนี้	72.85
หน่วยลงทุน ตราสารทุน	14.75
เงินฝากธนาคาร	7.16
หน่วยลงทุนในกองทุนรวมแบบผสม	2.97
หน่วยลงทุนในทรัสต์เพื่อการลงทุนอสังหาริมทรัพย์	1.23
หน่วยลงทุนในกองทุนรวมโครงสร้างพื้นฐาน	0.86
หน่วยลงทุนในกองทุนรวมอสังหาริมทรัพย์	0.78
สินทรัพย์และหนี้สินอื่นๆ	-0.60

หมายเหตุ :

ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก

ทรัพย์สิน	% NAV
กองทุนเปิดกรุงไทยตราสารหนี้ระยะ 1 ถึง 3 ปี	30.68
กองทุนเปิดกรุงไทยตราสารหนี้ พلاس-A	24.60
กองทุนเปิดกรุงไทยตราสารหนี้ระยะสั้น พلاس-A	17.57
กองทุนเปิดเคแอม โกลบอล อิควิตี้ พาสซีฟ ฟันด์-A	6.70
กองทุนเปิดกรุงไทย สตราทีจิค แอคทีฟ โกลบอล แอลโลเคชั่น	2.97

หมายเหตุ :

การลงทุนในกองทุนอื่นเกินกว่า 20% (กองในประเทศ และหรือกองต่างประเทศ)

ชื่อกองทุน : กองทุนเปิดกรุงไทยตราสารหนี้ระยะ 1 ถึง 3 ปี

web link : <https://www.ktam.co.th/mutual-fund-detail-document.aspx?IdF=50>



ชื่อกองทุน : กองทุนเปิดกรุงไทยตราสารหนี้ พلاس-A

web link : <https://www.ktam.co.th/mutual-fund-detail-document.aspx?IdF=53>



คำอธิบาย

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

Recovering Period ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาดังแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลานานเท่าใด

FX Hedging เปรียบเทียบของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลานึง 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 สูงกว่าจะเป็นกองทุนที่มีประสิทธิภาพในการบริหารจัดการการลงทุนที่ดีกว่า 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 28/02/2567

© 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

กองทุนเปิดกรุงไทยสุขใจ

Krung Thai Suk Jai Fund

KTSUK-SSF

ชนิดเพื่อการออม

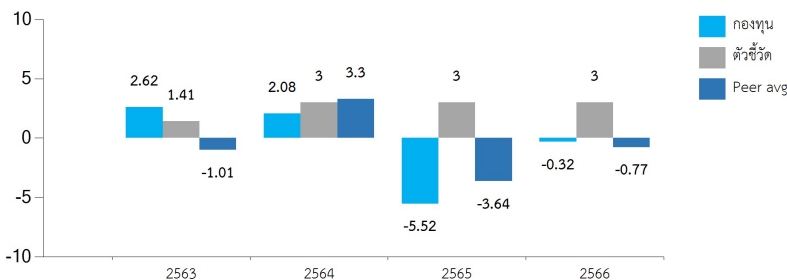
ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมผสม,กองทุนรวมเพื่อการออม (SSF),กองทุนรวมหน่วยลงทุน (Fund of Funds)
- กองทุนที่มีนโยบายลงทุนในกองทุนรวมภายใต้ บลจ. เดียวกัน
- กองทุนที่ลงทุนแบบมีความเสี่ยงทั้งในและต่างประเทศ
- กลุ่ม Conservative Allocation

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- กองทุนจะลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวม กองทุนรวมโครงสร้างพื้นฐาน หรือ กองทุน property (กองทุนปลายทาง) ทั้งในและต่างประเทศ ตั้งแต่ 2 กองทุนขึ้นไป โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของ NAV โดยกองทุนปลายทางดังกล่าวมีนโยบายลงทุนทั้งในตราสารทุน ตราสารหนี้ ทรัพย์สินทางเลือก
- กองทุนอาจลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมอื่น ซึ่งอยู่ภายใต้การจัดการของบริษัทจัดการ ในสัดส่วนไม่เกินร้อยละ 100 ของ NAV
- กองทุนอาจลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า เพื่อเป็นการเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน
- มุ่งหวังให้ผลประกอบการสูงกว่าดัชนีชี้วัด (active management)

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (%ต่อปี)



ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด

	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี*	3 ปี*	5 ปี*	10 ปี*	ตั้งแต่จัดตั้ง*
กองทุน	0.61	2.22	1.68	0.08	-1.17			-0.20
ดัชนีชี้วัด	0.51	0.74	1.48	3.00	3.00			3.00
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	0.23	1.37	0.09	-0.55	-0.52			
ความผันผวนกองทุน	1.79	1.98	2.77	2.99	2.75			2.68
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	0.13	0.13	0.12	0.13	0.12			0.13

หมายเหตุ : * % ต่อปี

ระดับความเสี่ยง

ต่ำ 1 2 3 4 5 6 7 8 สูง

เสี่ยงปานกลางค่อนข้างสูง

*ความเสี่ยงของกองทุน ระดับ 5 หมายถึง กองทุนรวมผสม ที่มี net exposure ได้ทั้งในตราสารทุน ตราสารหนี้ หรือทรัพย์สินทางเลือก

ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน 29/03/61

วันเริ่มต้น class 01/07/63

นโยบายการจ่ายเงินปันผล มี

อายุกองทุน ไม่กำหนดอายุโครงการ

ผู้จัดการกองทุนรวม

นาย สมชัย อมรรธรรม ตั้งแต่ 01/07/63

ดัชนีชี้วัด

อัตราผลตอบแทนร้อยละ 3 ต่อปี สัดส่วน 100%

คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวม ไม่ได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต : ได้รับการรับรองจาก CAC

จัดอันดับกองทุน

MORNINGSTAR ★★

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือบริหาร

ความเสี่ยงด้านสภาพคล่องได้ในหนังสือชี้

ชวนฉบับเต็ม

www.ktam.co.th

การซื้อขายหน่วยลงทุน	การขายคืนหน่วยลงทุน
วันทำการซื้อ : ทุกวันทำการซื้อขาย	วันทำการขายคืน : ทุกวันทำการซื้อขาย
เวลาทำการ : 8:30 - 12:00	เวลาทำการ : 8:30 - 12:00
การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ : ไม่กำหนด	การขายคืนขั้นต่ำ : ไม่กำหนด
การซื้อครั้งถัดไปขั้นต่ำ : ไม่กำหนด	ยอดคงเหลือขั้นต่ำ : ไม่กำหนด
	ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน : T+5 คือ 5 วันทำการนับจากวันคำนวณ NAV

ข้อมูลเชิงสถิติ	
Maximum Drawdown	-10.21 %
Recovering Period	N/A
FX Hedging	N/A
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน	0.72 เท่า

หมายเหตุ : โดยทั่วไปจะได้รับเงินค่าขายคืน T+5 คือ 5 วันทำการหลังจากวันทำการขายคืน

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)		
ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	2.1400	0.5350
รวมค่าใช้จ่าย	5.3500	0.3900

หมายเหตุ : * เป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะ หรือภาษีอื่นใดในทำนองเดียวกัน ** ค่าธรรมเนียมการจัดการข้างต้นเป็นอัตราที่บริษัทจัดการกำหนด โดยหากกองทุนลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมภายใต้การจัดการเดียวกัน (กองทุนปลายทาง) บริษัทจัดการจะไม่เรียกเก็บค่าธรรมเนียมการจัดการซ้ำซ้อนกับกองทุนปลายทาง (ค่าธรรมเนียมการจัดการข้างต้นยังมิได้มีการคิดค่าธรรมเนียมการจัดการที่ซ้ำซ้อนกัน โดยผู้ถือหน่วยลงทุนสามารถเรียกดูค่าใช้จ่ายที่เก็บจริงของรอบปีบัญชีที่ผ่านมาได้ที่หนังสือชี้ชวนส่วนข้อมูลกองทุนรวม) *** รวมค่าใช้จ่าย (เก็บจริง) เป็นของรอบปีบัญชีที่ผ่านมา ได้รวมค่าธรรมเนียมการจัดการ โดยไม่เรียกเก็บค่าธรรมเนียมซ้ำซ้อนกับกองทุนปลายทางกรณีลงทุนในกองทุนภายใต้การจัดการเดียวกัน เรียบร้อยแล้ว

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)		
ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การขาย	2.14	ยังไม่เรียกเก็บ
การรับซื้อคืน	2.14	ยังไม่เรียกเก็บ
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า	2.14	ยังไม่เรียกเก็บ
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก	ดูหมายเหตุเพิ่มเติม	ดูหมายเหตุเพิ่มเติม
การโอนหน่วย	ดูหมายเหตุเพิ่มเติม	ดูหมายเหตุเพิ่มเติม

หมายเหตุ : *ค่าธรรมเนียมข้างต้นเป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะ หรือภาษีอื่นใดในทำนองเดียวกัน ** กรณีสับเปลี่ยนออกไปยังกองทุนภายใน บลจ. เรียกเก็บสูงสุดไม่เกินร้อยละ 2.14 (ปัจจุบันยังไม่เรียกเก็บ), กรณีสับเปลี่ยนออกไปยัง SSF ของ บลจ.อื่น จะเรียกเก็บด้วยวิธีการใดวิธีการหนึ่งดังต่อไปนี้ เรียกเก็บสูงสุดไม่เกินร้อยละ 2.14 ของมูลค่าหน่วยลงทุนของวันทำการก่อนหน้าวันทำการซื้อขายหน่วยลงทุน ขั้นต่ำ 200 บาท หรือ 200 บาทต่อรายการ (ปัจจุบันเรียกเก็บ 200 บาทต่อรายการ) ***ค่าธรรมเนียมการโอนหน่วย ตามที่นายทะเบียนเรียกเก็บ การโอนหน่วย ผู้ลงทุนไม่สามารถนำหน่วยลงทุนไปจำหน่าย จ่ายโอน จำนำ หรือนำไปเป็นประกันได้ ****หากกองทุนลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมภายใต้บริษัทจัดการเดียวกัน (กองทุนปลายทาง) บริษัทจัดการจะไม่เรียกเก็บค่าธรรมเนียมการขายและ/หรือ ค่าธรรมเนียมการรับซื้อคืนซ้ำซ้อนกับกองทุนปลายทาง

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน		ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก	
ทรัพย์สิน	% NAV	ทรัพย์สิน	% NAV
หน่วยลงทุน ตราสารหนี้	72.85	กองทุนเปิดกรุงไทยตราสารหนี้ระยะ 1 ถึง 3 ปี	30.68
หน่วยลงทุน ตราสารทุน	14.75	กองทุนเปิดกรุงไทยตราสารหนี้ พลัส-A	24.60
เงินฝากธนาคาร	7.16	กองทุนเปิดกรุงไทยตราสารหนี้ระยะสั้น พลัส-A	17.57
หน่วยลงทุนในกองทุนรวมแบบผสม	2.97	กองทุนเปิดเคแอม โกลบอล อิควิตี้ พาสซีฟ ฟันด์-A	6.70
หน่วยลงทุนในทรัสต์เพื่อการลงทุนอสังหาริมทรัพย์	1.23	กองทุนเปิดกรุงไทย สตราทีจิค แอคทีฟ โกลบอล แอลโลเคชั่น	2.97
หน่วยลงทุนในกองทุนรวมโครงสร้างพื้นฐาน	0.86	หมายเหตุ :	
หน่วยลงทุนในกองทุนรวมอสังหาริมทรัพย์	0.78		
สินทรัพย์และหนี้สินอื่นๆ	-0.60		

หมายเหตุ :

การลงทุนในกองทุนอื่นเกินกว่า 20% (กองในประเทศ และหรือกองต่างประเทศ)

ชื่อกองทุน : กองทุนเปิดกรุงไทยตราสารหนี้ระยะ 1 ถึง 3 ปี

web link : <https://www.ktam.co.th/mutual-fund-detail-document.aspx?IdF=50>



ชื่อกองทุน : กองทุนเปิดกรุงไทยตราสารหนี้ พลัส-A

web link : <https://www.ktam.co.th/mutual-fund-detail-document.aspx?IdF=53>



คำอธิบาย

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

Recovering Period ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาดังแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลานานเท่าใด

FX Hedging เปรอ์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตลงทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลานึง 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 28/02/2567

© 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