

กองทุนรวมที่มีความเสี่ยงสูงหรือซับซ้อน
กองทุนรวมที่เสนอขายผู้ลงทุนที่มีใช้รายย่อย และผู้มีเงินลงทุนสูง



In alliance with CIMB

หนังสือชี้ชวนส่วนสรุปข้อมูลสำคัญ Factsheet

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน พรินซิเพิล จำกัด

ข้อมูล ณ วันที่ 29 กุมภาพันธ์ 2567

กองทุนเปิดพรินซิเพิล คอมเพล็กซ์ รีเทิร์น ห้ามขายผู้ลงทุนรายย่อย

Principal Complex Return Fund Not for Retail Investors

(PRINCIPAL CR-AI)

ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

ประเภทกองทุน : กองทุนรวมผสม , กองทุนรวมที่จ่ายผลตอบแทนแบบซับซ้อน, buy-and-hold, กองทุนที่ลงทุนแบบไม่มีความเสี่ยงต่างประเทศ

กลุ่มกองทุนรวม : Miscellaneous

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- ในช่วงประมาณ 6 เดือนแรก กองทุนมีนโยบายเน้นลงทุนในสัดส่วนโดยเฉลี่ยรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ในตราสารที่มีสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแบบ ("Structured Note") ที่เป็นหุ้นกู้อนุพันธ์ที่มีหลักทรัพย์อ้างอิง เป็นตราสารหลักที่ประกอบด้วยหุ้นของบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย ("หุ้นอ้างอิง") ตั้งแต่ 1 ตัวขึ้นไป โดย Structured Note สามารถถูกไถ่ถอนก่อนครบกำหนดได้หากราคาหุ้นอ้างอิงเกินราคาที่กำหนด (Autocallable Fixed Coupon Note)
- ทั้งนี้ ภายหลังจากระยะเวลาประมาณ 6 เดือนแรก กรณีที่ Structured Note ข้างต้นครบกำหนดไถ่ถอน โดยเข้าเงื่อนไขการไถ่ถอนตราสารด้วยการส่งมอบหุ้นอ้างอิง กองทุนจะมีไว้ซึ่งหุ้นอ้างอิงที่ได้รับมอบดังกล่าว ซึ่งบริษัทจัดการจะบริหารจัดการหุ้นอ้างอิงที่ได้รับมอบมาโดยไม่ได้ใช้วิธีการบริหารจัดการแบบเชิงรุก แต่จะใช้ดุลยพินิจในการพิจารณาจำหน่ายหุ้นดังกล่าวออกบางส่วนหรือทั้งหมดภายใต้กรอบอายุโครงการที่คงเหลืออยู่
- กองทุนจะไม่ลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) อื่นใดนอกเหนือจากการลงทุนใน Structured Note ข้างต้น

กลยุทธ์ในการบริหารจัดการลงทุน

- ในช่วงประมาณ 6 เดือนแรก กองทุนจะลงทุนใน Structured Note ที่เป็นหุ้นกู้อนุพันธ์ ประเภท Autocallable Fixed Coupon Note ในกรณีที่ Structured Note ที่กองทุนลงทุนครบกำหนดไถ่ถอน โดยเข้าเงื่อนไขการไถ่ถอนตราสารด้วยการส่งมอบหุ้นอ้างอิง ในช่วงประมาณ 6 เดือนหลังกองทุนจะมีไว้ซึ่งหุ้นอ้างอิงที่ได้รับมอบจากการไถ่ถอนตราสารดังกล่าว
- บริษัทจัดการจะบริหารจัดการหุ้นอ้างอิงที่ได้รับมอบมาโดยไม่ได้ใช้วิธีการบริหารจัดการแบบเชิงรุก แต่จะใช้ดุลยพินิจในการจำหน่ายหุ้นดังกล่าวออกบางส่วนหรือทั้งหมดภายใต้กรอบอายุโครงการที่คงเหลืออยู่ (ศึกษารายละเอียดเพิ่มเติมในหนังสือชี้ชวนส่วนข้อมูลกองทุนรวม)

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (%ต่อปี)

ยังไม่มีข้อมูล

ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด (%ต่อปี)

	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี	3 ปี	5 ปี	10 ปี	ตั้งแต่จัดตั้ง
กองทุน	4.43%	4.46%	-5.79%	N/A	N/A	N/A	N/A	-11.30%
ดัชนีชี้วัด*	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
ความผันผวนกองทุน	15.62%	15.74%	16.38%	N/A	N/A	N/A	N/A	14.27%
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A

ระดับความเสี่ยง

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

ลงทุนในตราสารทุน ตราสารหนี้ และ/หรือหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินอื่นที่สำนักงาน ก.ล.ต.เห็นชอบ โดยเน้นลงทุนในตราสารทุนไม่น้อยกว่า ร้อยละ 80 ของ NAV

ข้อมูลกองทุน

วันจดทะเบียนกองทุน	วันที่ 24 มีนาคม 2566
วันเริ่มต้น class	N/A
นโยบายการจ่ายเงินปันผล	ไม่จ่าย
อายุกองทุน	ไม่กำหนด
ผู้จัดการกองทุน	
คุณวรพจน์ คุณาประสิทธิ์	วันที่เริ่มบริหาร 24 มีนาคม 2566
คุณปัญชรัสมิ สีวราภรณ์สกุล	วันที่เริ่มบริหาร 24 มีนาคม 2566

ดัชนีชี้วัด

ไม่มี เนื่องจากอัตราผลตอบแทนของกองทุนจะขึ้นอยู่กับเงื่อนไขการจ่ายผลตอบแทนของตราสารที่มีสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแบบ (Structured Note) ที่เป็นหุ้นกู้อนุพันธ์ ประเภท Autocallable Fixed Coupon Note ซึ่งเป็นลักษณะเฉพาะเจาะจงที่สร้างขึ้นสำหรับกองทุนนี้โดยเฉพาะ

คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนไม่ได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต
- ผู้ลงทุนไม่สามารถขายคืนหน่วยลงทุนในช่วงระยะเวลา 1 ปีได้ และกองทุนนี้ลงทุนกระจุกตัวในผู้ออก ดังนั้น หากมีปัจจัยลบที่ส่งผลกระทบต่อการลงทุนดังกล่าว ผู้ลงทุนอาจสูญเสียเงินลงทุนจำนวนมาก
- กองทุนนี้อาจเลิกกองทุนก่อนครบกำหนดอายุโครงการ โดยจะเป็นไปตามเงื่อนไขที่กำหนดไว้ในรายละเอียดโครงการ

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต : ได้รับการรับรอง CAC

จัดอันดับกองทุน Morningstar

ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือ

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

บริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่องได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



www.principal.th

การซื้อขายหน่วยลงทุน	การขายคืนหน่วยลงทุน	ข้อมูลเชิงสถิติ	
วันที่ทำการซื้อ : เวลาทำการ : การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ : การซื้อครั้งถัดไปขั้นต่ำ :	อื่น ๆ โปรดระบุ ตั้งแต่เวลาเริ่มทำการ ถึงเวลา 15.30 น. 500,000.00 บาท ไม่กำหนด	วันที่ทำการขายคืน : เวลาทำการ : การขายคืนขั้นต่ำ : ยอดคงเหลือขั้นต่ำ : ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน : ประกาศ NAV T+1, คืนเงิน T+3 คือ 3 วันทำการหลังจากวันที่ทำการขายคืน	อื่น ๆ โปรดระบุ - ไม่กำหนด ไม่กำหนด ไม่กำหนด
		Maximum Drawdown Recovering Period FX Hedging อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน Sharpe Ratio Alpha Beta Tracking Error อายุเฉลี่ยของตราสารหนี้ Yield to Maturity	-15.42 N/A N/A 0.00 -0.81 N/A N/A N/A N/A N/A

หมายเหตุ วันที่ทำการซื้อ : เสนอขายหน่วยลงทุนครั้งเดียวช่วง IPO (7- 22 มีนาคม 2566)
วันที่ทำการขายคืน : บริษัทจัดการจะรับซื้อคืนหน่วยลงทุนอัตโนมัติตามบริษัทจัดการกำหนด
ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน : ภายใน 5 วันทำการนับตั้งแต่วันที่ถัดจากวันที่ทำการขายคืนหน่วยลงทุนโดยอัตโนมัติ โดยจะนำเงินค่ารับซื้อคืนหน่วยลงทุนอัตโนมัติดังกล่าวไปซื้อหน่วยลงทุนของกองทุน PRINCIPAL TREASURY ทั้งจำนวน เว้นแต่จะได้รับอนุญาตจากบริษัทจัดการเป็นอย่างอื่น

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	2.1400%	1.0700%
รวมค่าใช้จ่าย	6.2200%	1.2091%

หมายเหตุ ค่าธรรมเนียมเป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะ หรือภาษีอื่นใด ในทำนองเดียวกันไว้แล้ว ในระยะเวลาประมาณ 6 เดือนแรก นับจากวันที่จดทะเบียนทรัพย์สินเป็นกองทุนรวม ถึงวันที่หลักทรัพย์ประเภท structure note ครบอายุทั้งหมด บริษัทจัดการจะเรียกเก็บค่าธรรมเนียมการจัดการในอัตราร้อยละ (ต่อปี) ของมูลค่าที่จดทะเบียนของทรัพย์สินเป็นกองทุนรวม โดยทางบัญชีจะรับรู้เป็นค่าใช้จ่ายของกองทุนทั้งจำนวนในวันที่ถูกเรียกเก็บ และจะเรียกเก็บจากกองทุนภายในระยะเวลาไม่เกิน 90 วันนับจากวันที่จดทะเบียนกองทุน และหลังจากนั้นกรณีที่ไม่เกิดเหตุตามเงื่อนไขการเลิกกองทุน ภายในระยะเวลาประมาณ 6 เดือนแรก นับจากวันที่จดทะเบียนทรัพย์สินเป็นกองทุนรวม ถึงวันที่หลักทรัพย์ประเภท structure note ครบอายุทั้งหมด บริษัทจัดการจะเรียกเก็บค่าธรรมเนียมการจัดการในอัตราร้อยละ (ต่อปี) ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน
บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ
โปรดศึกษารายละเอียดเพิ่มเติมในหนังสือชี้ชวนข้อมูลกองทุนรวม

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การขาย	2.1400%	0.8025%
การรับซื้อคืน	1.0700%	ยกเว้น
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า	2.1400%	0.8025%
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก	1.0700%	ยกเว้น
การโอนหน่วย	ตามที่นายทะเบียนเรียกเก็บ	ตามที่นายทะเบียนเรียกเก็บ

หมายเหตุ ค่าธรรมเนียมเป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะ หรือภาษีอื่นใดในทำนองเดียวกันไว้แล้ว

การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม 5 อันดับแรก

หลักทรัพย์แยกตามกลุ่มอุตสาหกรรม	% ของ NAV
พลังงานและสาธารณูปโภค	27.51
เทคโนโลยีสารสนเทศและการสื่อสาร	24.54
พัฒนาอสังหาริมทรัพย์	19.88
การท่องเที่ยวและสินค้าการ	14.76
ปิโตรเคมีและเคมีภัณฑ์	12.56

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน

การกระจายการลงทุน	% ของ NAV
หุ้นสามัญ	99.25
บัญชีเงินฝากออมทรัพย์	0.43
อื่นๆ	0.31

ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก

ชื่อทรัพย์สิน	% ของ NAV
หุ้นสามัญ : บริษัท ทู คอร์ปอเรชั่น จำกัด (มหาชน) : TRUE	24.54
หุ้นสามัญ : บริษัท แลนด์ แอนด์ เฮ้าส์ จำกัด (มหาชน) : LH	19.88
หุ้นสามัญ : บริษัท กัลฟ์ เอ็นเนอร์จี ดีเวลลอปเม้นท์ จำกัด (มหาชน) : GULF	16.01
หุ้นสามัญ : บริษัท โรงแรมเซ็นทรัล พลาซ่า จำกัด (มหาชน) : CENTEL	14.76
หุ้นสามัญ : บริษัท พีทีที โกลบอล เคมิคอล จำกัด (มหาชน) : PTTGC	12.56

คำอธิบาย

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

Recovering Period ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาตั้งแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินลงทุนเริ่มต้นใช้เวลานานเท่าใด

FX Hedging เปอร์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลานึง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์กับผลรวมของมูลค่าการขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 1 ปีหารด้วยมูลค่า NAV ของกองทุนรวมเฉลี่ยในรอบระยะเวลาเดียวกัน กองทุนรวมที่มีค่า portfolio turnover สูง บ่งชี้ถึงการซื้อขายหลักทรัพย์บ่อยครั้งของผู้จัดการกองทุนและทำให้มีต้นทุนการซื้อขายหลักทรัพย์ที่สูง จึงต้องพิจารณาเปรียบเทียบกับผลการดำเนินงานของกองทุนรวมเพื่อประเมินความคุ้มค่าของการซื้อขายหลักทรัพย์ดังกล่าว

Sharpe Ratio อัตราส่วนระหว่างผลตอบแทนส่วนเพิ่มของกองทุนรวมเปรียบเทียบกับความเสี่ยงจากการลงทุน โดยคำนวณจากผลต่างระหว่างอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมกับอัตราผลตอบแทนที่ปราศจากความเสี่ยง (risk-free rate) หารด้วยค่าเบี่ยงเบนมาตรฐาน (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 หลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนมากกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด

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

Yield to Maturity อัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในตราสารหนี้โดยถือจนครบกำหนดอายุ ซึ่งคำนวณจากดอกเบี้ยที่จะได้รับในอนาคตตลอดอายุตราสารและเงินต้นที่จะได้รับคืน นำมาคิดลดเป็นมูลค่าปัจจุบัน โดยใช้วัดอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมตราสารหนี้ คำนวณจากค่าเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักของ Yield to Maturity ของตราสารหนี้แต่ละตัวที่กองทุนมีการลงทุน และเนื่องจาก Yield to Maturity มีหน่วยมาตรฐานเป็นเปอร์เซ็นต์ต่อปี จึงสามารถนำไปใช้เปรียบเทียบอัตราผลตอบแทนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีนโยบายถือครองตราสารหนี้จนครบกำหนดอายุและมีลักษณะการลงทุนที่ใกล้เคียงกันได้

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน พรินซิเพิล จำกัด

เลขที่ 44 อาคารธนาคารซีไอเอ็มบี ไทย ชั้น 16 ถนนหลังสวน แขวงลุมพินี เขตปทุมวัน กรุงเทพฯ 10330 โทร (662) 686-9500 เว็บไซต์: www.principal.th