

กองทุนเปิดเค มินิมัม โวลาทิลิตี้ หุ้นทุน

K-MVEQ

ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมตราสารทุน
- กลุ่ม Equity General

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- ลงทุนหุ้นที่อยู่ในดัชนี SET100 โดยมีเป้าหมายให้ความผันผวนของผลตอบแทนของพอร์ตการลงทุนโดยรวมอยู่ในระดับต่ำที่สุดเมื่อเทียบกับดัชนีชี้วัด
- อาจลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเพื่อการเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน (Efficient Portfolio Management)
- มุ่งหวังให้ความผันผวนของผลตอบแทนของพอร์ตการลงทุนโดยรวมอยู่ในระดับต่ำที่สุดเมื่อเทียบกับดัชนีชี้วัด (Minimum Volatility)

ระดับความเสี่ยง

ต่ำ 1 2 3 4 5 6 7 8 สูง

ความเสี่ยงสูง

ลงทุนในตราสารทุนเป็นหลัก โดยเฉลี่ยในรอบปีไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน	21 ก.ค. 59
นโยบายการจ่ายเงินปันผล	ไม่จ่าย
อายุกองทุน	ไม่กำหนด

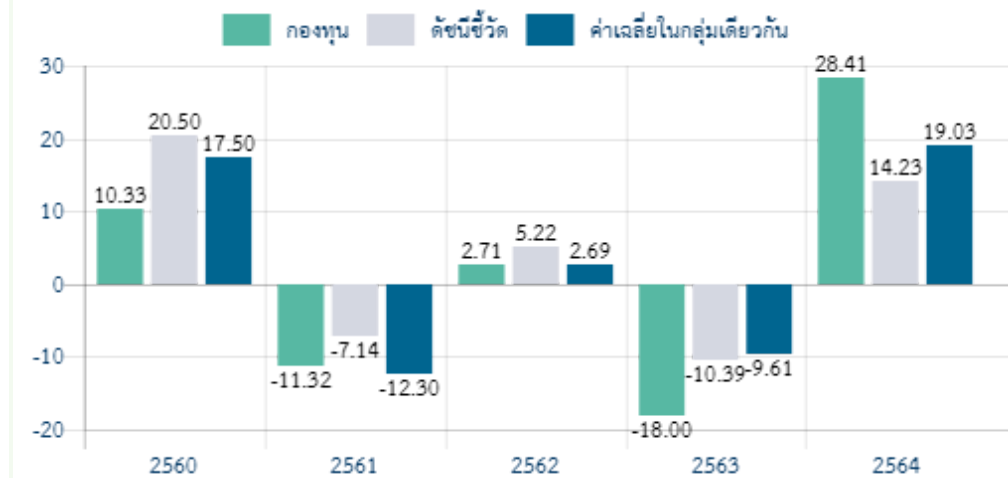
ผู้จัดการกองทุนรวม

น.ส. พิรกานต์ ศรีสุข (ตั้งแต่ 26 ก.พ. 61)

ดัชนีชี้วัด :

1. ดัชนีผลตอบแทนรวม SET 100 (SET100 TRI) (100.00%)

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (% ต่อปี)



ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด (%)

	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี *
กองทุน	-4.56	-5.77	-4.56	1.08
ดัชนีชี้วัด	-3.17	-6.04	-3.17	1.84
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	-4.40	-5.73	-4.40	1.01
ความผันผวนกองทุน	10.11	10.37	10.11	9.71
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	12.52	13.00	12.52	12.23
	3 ปี *	5 ปี *	10 ปี *	ตั้งแต่จัดตั้ง *
กองทุน	-3.41	-0.43	N/A	0.90
ดัชนีชี้วัด	-2.64	2.13	N/A	2.99
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	-1.61	0.98	N/A	N/A
ความผันผวนกองทุน	17.59	14.78	N/A	14.13
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	21.98	18.46	N/A	17.56

หมายเหตุ : * % ต่อปี

คำเตือน:

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวม มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต : ได้รับการรับรองจาก CAC

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

ผู้ลงทุนสามารถศึกษา
เครื่องมือบริหารความเสี่ยง
ด้านสภาพคล่องได้ใน
หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



www.kasikornasset.com

การซื้อขายหน่วยลงทุน

วันทำการซื้อ : ทุกวันทำการ

เวลาทำการ : 08:30 น. - 14:00 น.

การซื้อขายครั้งแรกขั้นต่ำ : 500 บาท

การซื้อขายครั้งถัดไปขั้นต่ำ : 500 บาท

หมายเหตุ :

การขายคืนหน่วยลงทุน

วันทำการขายคืน : ทุกวันทำการ

เวลาทำการ : 08:30 น. - 14:00 น.

การขายคืนขั้นต่ำ : 500 บาท

ยอดคงเหลือขั้นต่ำ : 50 บาท

ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน : T+3

(ประกาศ NAV T+1)

ข้อมูลเชิงสถิติ

Maximum Drawdown	-42.05 %
Recovering Period	N/A
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน	1.19 เท่า
Sharpe Ratio	-0.16
Alpha	-0.77 %
Beta	0.72

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	3.2100	1.0700
รวมค่าใช้จ่าย	4.0125	1.7017

หมายเหตุ : ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะ หรือภาษีอื่นใดแล้ว

- บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริง เพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การขาย	3.00	1.00
การรับซื้อคืน	3.00	ยกเว้น
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า		ดูหมายเหตุ
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก		ดูหมายเหตุ
การโอนหน่วย	ตามที่เก็บจริง	ไม่เรียกเก็บ

หมายเหตุ : ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะ หรือภาษีอื่นใดแล้ว

- บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริง เพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ

• ค่าธรรมเนียมการสับเปลี่ยน (Switching Fee) : อัตราเท่ากับค่าธรรมเนียมการรับซื้อคืนหน่วยลงทุนของกองทุนต้นทางหรือค่าธรรมเนียมการขายหน่วยลงทุนของกองทุนปลายทางแล้วแต่อัตราใดจะสูงกว่า

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน**ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก**

ประเภททรัพย์สิน	% NAV	ทรัพย์สิน	% NAV
ตราสารทุน	96.71	หุ้น บมจ.ปตท.สำรวจและผลิตปิโตรเลียม	9.07
เงินฝาก	3.53	หุ้น บมจ.ผลิตไฟฟ้า	8.58
อื่นๆ	-0.23	หุ้น บมจ.แอดวานซ์ อินโฟร์ เซอร์วิส	7.39
		หุ้น บมจ.แลนด์แอนด์เฮาส์	7.34
		หุ้น บมจ.ทีเอสโก้ไฟแนนเชียลกรุ๊ป	7.20

การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม

อุตสาหกรรม	% NAV
พลังงานและสาธารณูปโภค	24.87
พัฒนาอสังหาริมทรัพย์	13.57
ธนาคาร	10.51
อาหารและเครื่องดื่ม	9.28
พาณิชย์	8.76

คำอธิบาย

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

Recovering Period ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาตั้งแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลานานเท่าใด

FX Hedging เปรอ์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

อัตราส่วนหมุนเวียนการการลงทุน ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตกองทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลาหนึ่ง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์กับผลรวมของมูลค่าการขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 1 ปีหารด้วยมูลค่า NAV ของกองทุนรวมเฉลี่ยในรอบระยะเวลาเดียวกัน กองทุนรวมที่มีค่าอัตราส่วนหมุนเวียนการการลงทุนสูงบ่งชี้ถึงการซื้อขายหลักทรัพย์บ่อยครั้งของผู้จัดการกองทุนและทำให้มีต้นทุนการซื้อขายหลักทรัพย์ที่สูง 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 หลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนมากกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด

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

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

© สงวนลิขสิทธิ์ 2022 บริษัท มอร์นิ่งสตาร์ รีเสิร์ช (ประเทศไทย) จำกัด ข้อมูลนี้ (1) เป็นกรรมสิทธิ์ของบริษัท มอร์นิ่งสตาร์ รีเสิร์ช (ประเทศไทย) จำกัด และ/หรือ ผู้ให้บริการข้อมูล (2) ขอสงวนสิทธิ์ในการลอกเลียน หรือเผยแพร่ (3) ขอสงวนสิทธิ์ที่จะไม่รับผิดชอบต่อความถูกต้อง ครบถ้วน และความเสียหายต่างๆ ที่เกิดขึ้นทุกกรณีจากการนำข้อมูลไปใช้อ้างอิง ผลการดำเนินงานในอดีตมิได้เป็นสิ่งยืนยันผลการดำเนินงานในอนาคต

หนังสือชี้ชวนส่วนสรุปข้อมูลสำคัญ



บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กสิกรไทย จำกัด
ที่อยู่ : 400/22 อาคารธนาคารกสิกรไทย ชั้น 6 และ 12 ถนนพหลโยธิน
แขวงสามเสนใน เขตพญาไท กรุงเทพฯ 10400
โทรศัพท์ : 0 - 2673 - 3888 โทรสาร : 0 - 2673 - 3988
website : www.kasikornasset.com
email : ka.customer@kasikornasset.com