

หนังสือชี้ชวนสรุปข้อมูลสำคัญ



krungsri
Asset Management

เครือข่าย MUFG หนึ่งในสถาบันการเงินที่ใหญ่ที่สุดของโลก

บลจ.กรุงศรี จำกัด
การเข้าร่วมการต่อต้านทุจริต :
ได้รับการรับรอง CAC

**กองทุนเปิดกรุงศรี
ออยล์
[KF-OIL]**

กองทุนทรัพย์สินทางเลือก

กองทุนรวมหน่วยลงทุนประเภท Feeder Fund

กองทุนรวมที่เน้นลงทุนแบบมีความเสี่ยงต่างประเทศ



คุณกำลังจะลงทุนอะไร?



กองทุนรวมนี้เหมาะกับใคร?



คุณต้องระวังอะไรเป็นพิเศษ?



สัดส่วนของประเภททรัพย์สินที่ลงทุน



ค่าธรรมเนียม



ผลการดำเนินงานในอดีต



ข้อมูลอื่นๆ

การลงทุนในกองทุนรวม **ไม่ใช่** การฝากเงิน



คุณกำลังจะลงทุนอะไร?

• นโยบายการลงทุน

- ลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมต่างประเทศชื่อ Invesco DB Oil Fund (กองทุนหลัก)(ISIN Code:US73936B5075) โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่ต่ำกว่าร้อยละ 80.00 ของ NAV
- กองทุนหลักมีนโยบายเน้นลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้าน้ำมันดิบ West Texas Intermediate(WTI) เพื่อให้ได้รับผลตอบแทนใกล้เคียงกับผลตอบแทนของดัชนี DBIQ Optimum Yield Crude Oil Index Excess Return ซึ่งเป็นดัชนีที่มุ่งสะท้อนการเปลี่ยนแปลงของมูลค่าน้ำมันดิบ West Texas Intermediate (WTI)

ศึกษาข้อมูลกองทุนหลักได้จาก www.invesco.com

- บริษัทจัดการขอสิทธิในการเปลี่ยนแปลงประเภทและลักษณะพิเศษของกองทุนรวมในอนาคตให้เป็นกองทุนรวมหน่วยลงทุน (Fund of Funds) หรือกองทุนรวมที่มีการลงทุนโดยตรงในตราสาร และ/หรือหลักทรัพย์ต่างประเทศ หรือสามารถกลับมาเป็นกองทุนรวมฟีดเดอร์ (Feeder Fund) ได้ โดยไม่ทำให้ระดับความเสี่ยงของการลงทุน (risk spectrum) เพิ่มขึ้น ทั้งนี้ ให้เป็นไปตามดุลยพินิจของผู้จัดการกองทุนซึ่งขึ้นอยู่กับสถานการณ์ตลาด โดยเป็นไปเพื่อประโยชน์สูงสุดของผู้ถือหน่วยลงทุน

• กลยุทธ์ในการบริหารจัดการลงทุน

- กองทุนเปิดกรุงศรีออยล์ มุ่งหวังให้ผลประกอบการเคลื่อนไหวตามกองทุนหลัก(Passive Management)
- กองทุนหลัก Invesco DB Oil Fund มุ่งหวังให้ผลประกอบการเคลื่อนไหวตามดัชนี (Passive Management)



กองทุนรวมนี้เหมาะกับใคร?

- ผู้ลงทุนที่คาดหวังผลตอบแทนจากการลงทุนในน้ำมันดิบ
- ผู้ลงทุนที่สามารถรับความผันผวนของราคาน้ำมัน ซึ่งอาจจะปรับตัวเพิ่มสูงขึ้นหรือลดลงจนต่ำกว่ามูลค่าที่ลงทุนและทำให้ขาดทุนได้
- ผู้ลงทุนที่ต้องการลงทุนในทรัพย์สินทางเลือกเพื่อกระจายการลงทุนทรัพย์สินประเภทต่างๆ

กองทุนรวมนี้ไม่เหมาะกับใคร

ผู้ลงทุนที่เน้นการได้รับผลตอบแทนในจำนวนเงินที่แน่นอน หรือรักษาเงินต้นให้อยู่ครบ



ทำอย่างไรหากยังไม่เข้าใจนโยบาย และความเสี่ยงของกองทุนนี้

- อ่านหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม หรือสอบถามผู้สนับสนุนการขายและบริษัทจัดการ
อย่าลงทุนหากไม่เข้าใจลักษณะและความเสี่ยงของกองทุนรวมนี้ดีพอ

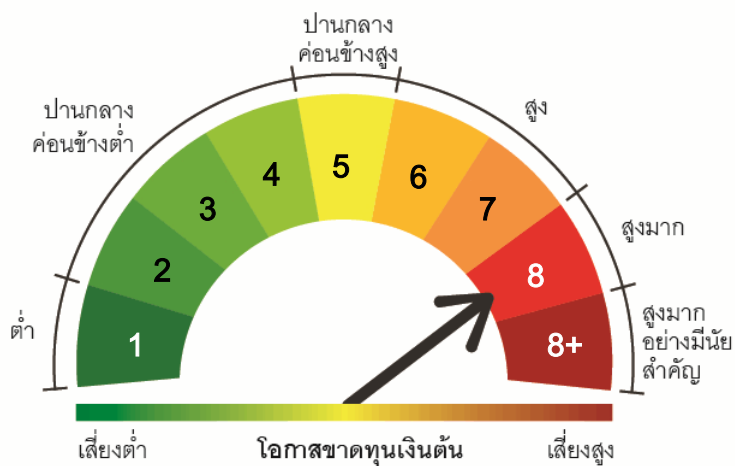


คุณต้องระวังอะไรเป็นพิเศษ?

• ค่าเตือนที่สำคัญ

- ผลตอบแทนจากการลงทุนตามความเคลื่อนไหวของราคาสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (futures price) อาจไม่เท่ากับความเคลื่อนไหวของราคาปัจจุบัน (spot price) ของสินค้าหรือตัวแปร เช่น ผลตอบแทนจากการลงทุนเป็นไปตามการเปลี่ยนแปลงของราคา oil futures ซึ่งอาจไม่เท่ากับการเคลื่อนไหวของราคาน้ำมันที่ท่านเห็นที่จุดบริการน้ำมัน
- กองทุนและ/หรือกองทุนหลักอาจลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเพื่อประสิทธิภาพในการบริหารการลงทุน จึงอาจมีความเสี่ยงมากกว่ากองทุนรวมที่ลงทุนในหลักทรัพย์อ้างอิงโดยตรง เนื่องจากใช้เงินลงทุนในจำนวนที่น้อยกว่าจึงมีกำไร/ขาดทุนสูงกว่าการลงทุนในหลักทรัพย์อ้างอิงโดยตรง
- กองทุนรวมนี้ลงทุนกระจุกตัวในประเทศสหรัฐอเมริกา ผู้ลงทุนจึงควรพิจารณาการกระจายความเสี่ยงของพอร์ตการลงทุนโดยรวมของตนเองด้วย

แผนภาพแสดงตำแหน่งความเสี่ยงของกองทุนรวม



ปัจจัยความเสี่ยงที่สำคัญ

1. ความเสี่ยงจากความผันผวนของมูลค่าหน่วยลงทุน (Market Risk)

	ต่ำ				สูง
ความผันผวนของ ผลการดำเนินงาน (SD)	< 5%	5-10%	10 - 15%	15 - 25%	> 25%

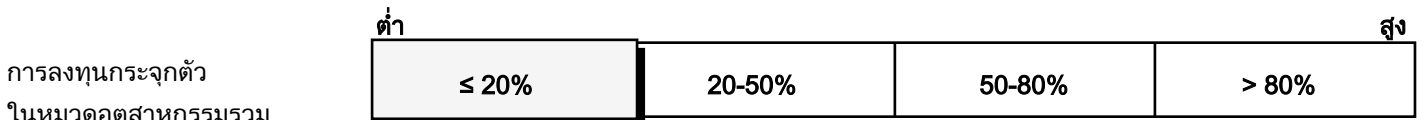
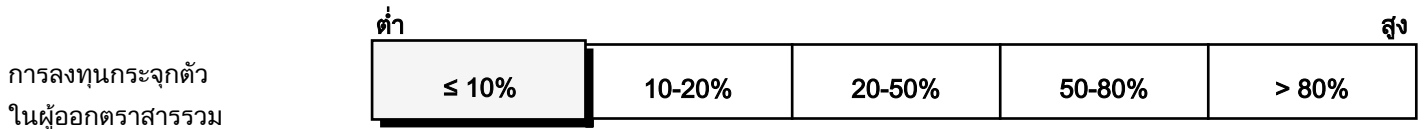
*ค่า SD แสดงความผันผวนของกองทุนย้อนหลัง 5 ปี (หรือตั้งแต่จัดตั้งกองทุนกรณียังไม่ครบ 5 ปี)

2. ความเสี่ยงจากการเปลี่ยนแปลงของอัตราแลกเปลี่ยน (Exchange Rate Risk)

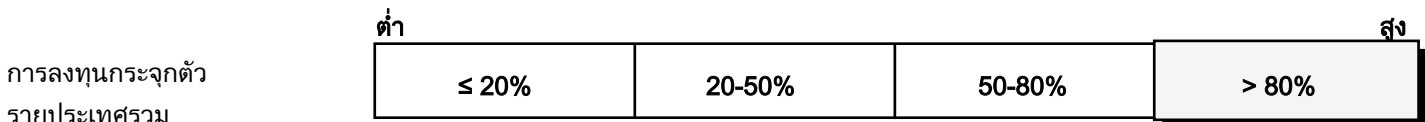
	ต่ำ				สูง
การป้องกันความเสี่ยงจาก อัตราแลกเปลี่ยน	ทั้งหมด/เกือบทั้งหมด	บางส่วน	ดลยพินิจ		ไม่ป้องกัน

หมายเหตุ: กองทุนป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยนร้อยละ 90 ของมูลค่าเงินลงทุนในต่างประเทศ

3. ความเสี่ยงจากการลงทุนกระจุกตัว (High Concentration Risk)



หมายเหตุ: กองทุนรวมไม่มีการลงทุนกระจุกตัวในหมวดอุตสาหกรรมใดอุตสาหกรรมหนึ่งมากกว่า 20% ของ NAV รวมกัน

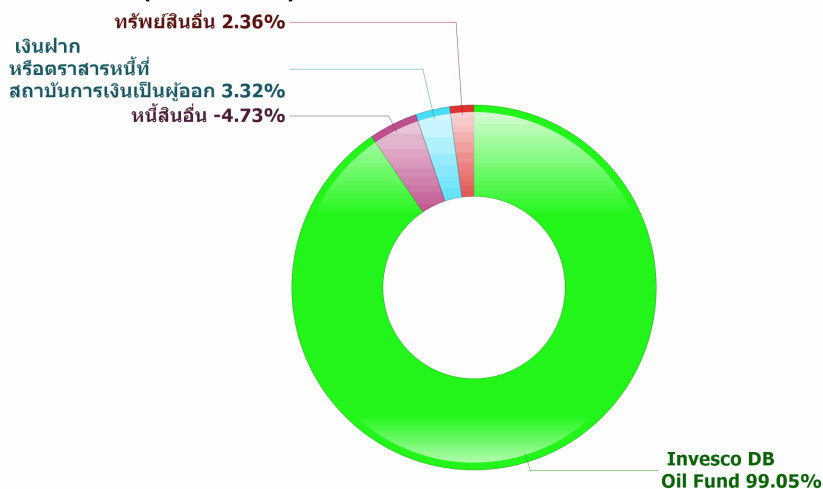


หมายเหตุ: กองทุนรวมมีการลงทุนกระจุกตัวในประเทศ United States



สัดส่วนของประเภททรัพย์สินที่ลงทุน

Portfolio Breakdown (% of NAV)

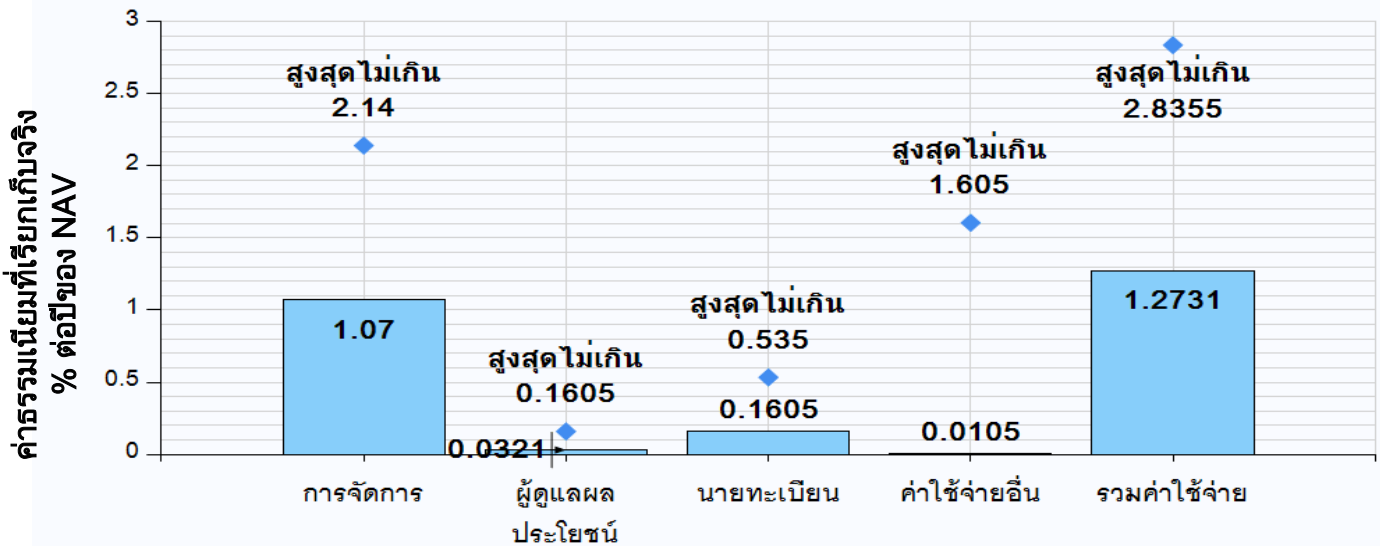




ค่าธรรมเนียม

ค่าธรรมเนียมมีผลกระทบต่อผลตอบแทนที่คุณจะได้รับ ดังนั้น คุณควรพิจารณาการเรียกเก็บค่าธรรมเนียมดังกล่าวก่อนการลงทุน

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)



*คุณสามารถดูข้อมูลค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงจากกองทุนย้อนหลังได้ที่ www.krungsriasset.com

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)

รายการ	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
ค่าธรรมเนียมขาย	ไม่เกิน 1.50	ไม่เรียกเก็บ
ค่าธรรมเนียมการรับซื้อคืน	ไม่เกิน 1.50	ไม่เรียกเก็บ
ค่าธรรมเนียมสับเปลี่ยนเข้า	ไม่เกิน 1.50	ไม่เรียกเก็บ
ค่าธรรมเนียมสับเปลี่ยนออก	ไม่เกิน 1.50	ไม่เรียกเก็บ
ค่าปรับกรณีขายคืนและสับเปลี่ยนออกก่อนระยะเวลาที่กำหนด	ไม่มี	ไม่มี
ค่าธรรมเนียมการโอน	10 บาทต่อ 1,000 หน่วย	10 บาทต่อ 1,000 หน่วย
ค่าใช้จ่ายในการซื้อขายหลักทรัพย์เมื่อมีการซื้อ ขาย สับเปลี่ยน	ไม่มี	ไม่มี

หมายเหตุ : ค่าธรรมเนียมดังกล่าวเป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว

ค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายของกองทุนหลัก

1. ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (ร้อยละของมูลค่าหน่วยลงทุน) : ไม่มี	
2. ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุน (ร้อยละต่อปีของ NAV) : รวมค่าใช้จ่าย 0.78%	
(1) ค่าธรรมเนียมการจัดการ	0.75%



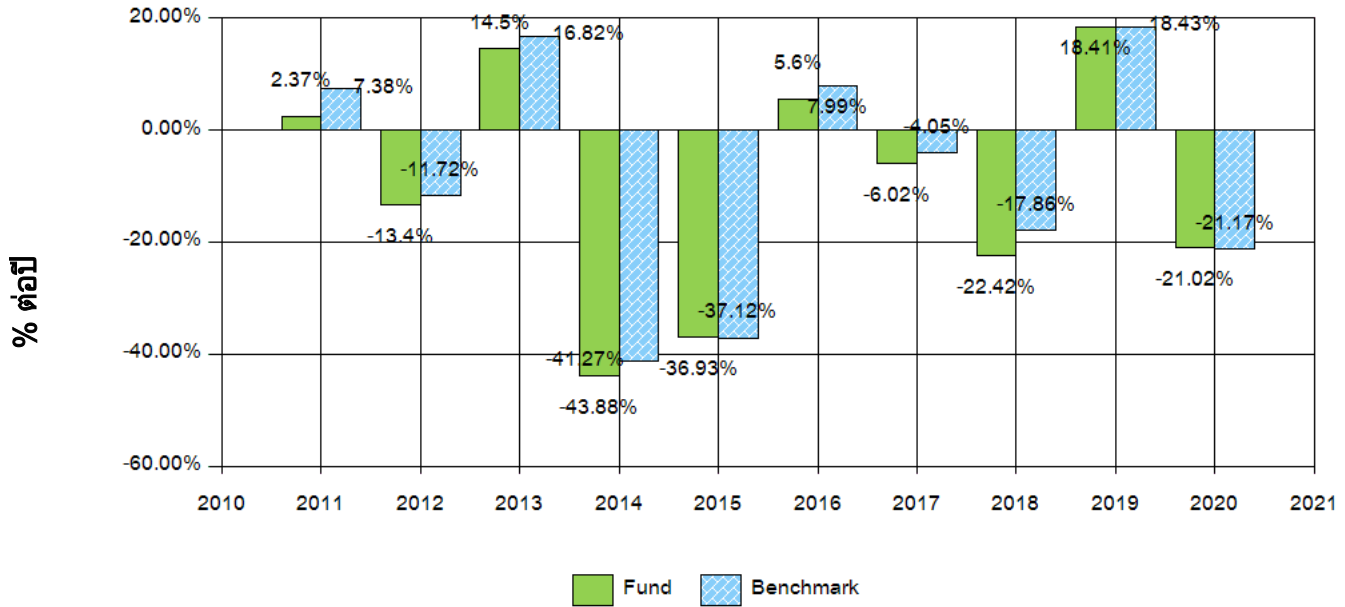
ผลการดำเนินงานในอดีต

ผลการดำเนินงานในอดีต มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

1. ดัชนีชี้วัด (benchmark) ของกองทุนรวม

ดัชนี DBIQ Optimum Yield Crude Oil Index Excess Return ซึ่งได้คำนวณให้อยู่ในรูปเงินสกุลบาทแล้ว

2. แบบย้อนหลังตามปีปฏิทิน



* ในปีที่กองทุนจัดตั้ง ผลการดำเนินงานจะแสดงตั้งแต่วันที่จัดตั้งจนถึงสิ้นปีปฏิทิน

3. กองทุนนี้เคยมีผลขาดทุนสูงสุดในช่วงเวลา 5 ปี : -62.49 %

* กรณีกองทุนจัดตั้งไม่ครบ 5 ปีจะแสดงค่าที่เกิดขึ้นนับตั้งแต่จัดตั้งกองทุน

4. ความผันผวนของผลการดำเนินงาน (standard deviation) : 30.83 % ต่อปี

* กรณีกองทุนจัดตั้งไม่ครบ 5 ปีจะแสดงค่าที่เกิดขึ้นนับตั้งแต่จัดตั้งกองทุน

5. ความผันผวนของส่วนต่างผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัด (Tracking Error : TE) : ไม่มีข้อมูล (N/A)

6. ประเภทกองทุนรวมเพื่อใช้เปรียบเทียบผลการดำเนินงาน ณ จุดขาย คือ Commodities Energy

7.ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปึกหมุด

ผลการดำเนินงาน	YTD	3 เดือน		6 เดือน		1 ปี		3 ปี		5 ปี		10 ปี		ตั้งแต่จัดตั้ง
		%	Percentile	%	Percentile	%	Percentile	%	Percentile	%	Percentile	%	Percentile	
KF-OIL	52.97	21.90	95th	52.97	25th	81.08	50th	-1.61	75th	2.19	75th	-8.92	95th	-7.62
ดัชนีชี้วัด	63.90	26.05	5th	63.90	5th	93.30	5th	0.44	5th	5.42	25th	-6.60	5th	-4.71
ความผันผวนของผลการดำเนินงาน	29.34	24.14	25th	29.34	50th	30.37	50th	34.57	5th	30.83	50th	29.74	95th	29.23
ความผันผวนของดัชนีชี้วัด	28.76	24.33	50th	28.76	5th	31.79	95th	36.89	50th	32.84	95th	31.48	95th	30.89

● ผลตอบแทนที่มีอายุเกินหนึ่งปีจะแสดงเป็นผลตอบแทนต่อปี

ตารางแสดงผลการดำเนินงานย้อนหลังของกลุ่ม Commodities Energy ข้อมูล ณ วันที่ 30 มิ.ย. 2564

เปอร์เซ็นต์ไทล์	ผลการดำเนินงาน (%)					
	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี	3 ปี	5 ปี	10 ปี
เปอร์เซ็นต์ไทล์ที่ 5	24.55	61.06	87.78	0.06	5.96	-7.68
เปอร์เซ็นต์ไทล์ที่ 25	23.73	★ 52.97	81.49	-0.50	4.95	-8.22
เปอร์เซ็นต์ไทล์ที่ 50	22.78	52.26	★ 81.08	-0.60	4.07	-8.34
เปอร์เซ็นต์ไทล์ที่ 75	22.62	51.56	75.53	★ -1.62	★ 2.19	-8.82
เปอร์เซ็นต์ไทล์ที่ 95	★ 21.91	49.82	71.85	-24.05	-11.32	★ -12.49

เปอร์เซ็นต์ไทล์	ความผันผวนของผลการดำเนินงาน (%)					
	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี	3 ปี	5 ปี	10 ปี
เปอร์เซ็นต์ไทล์ที่ 5	23.26	29.11	30.04	★ 35.16	29.29	27.66
เปอร์เซ็นต์ไทล์ที่ 25	★ 24.14	29.26	30.18	35.31	29.46	27.78
เปอร์เซ็นต์ไทล์ที่ 50	24.50	★ 29.60	★ 30.50	37.65	★ 31.02	28.34
เปอร์เซ็นต์ไทล์ที่ 75	24.88	30.00	30.91	37.91	31.23	28.95
เปอร์เซ็นต์ไทล์ที่ 95	25.78	32.05	32.33	53.93	43.92	★ 33.11

● กรณศึกษาข้อตกลงและเงื่อนไขของข้อมูลเปรียบเทียบกับผลการดำเนินงานแบบเปอร์เซ็นต์ไทล์ได้ที่หมายเหตุหน้าท้าย

8.ผลการดำเนินงานของกองทุนหลัก (Master Fund Performance)

	ผลการดำเนินงานของกองทุนหลัก			
	% ต่อปี			
	1 ปี	3 ปี	5 ปี	ตั้งแต่จัดตั้งกองทุน 1-พ.ค.-2550
กองทุนหลัก	81.85	-0.28	5.46	-5.51
Benchmark	80.24	0.04	5.56	-4.78

*ผลการดำเนินงานในสกุลเงินหลัก

ผลการดำเนินงานในอดีต มิได้เป็นสิ่งยืนยันผลการดำเนินงานในอนาคต

ที่มาข้อมูล ณ วันที่ 31 พ.ค. 2564

ที่มา : Fund Ticker - DBO



ข้อมูลอื่นๆ

นโยบายการจ่ายเงินปันผล :	ไม่จ่ายปันผล		
ผู้ดูแลผลประโยชน์ :	ธนาคารไทยพาณิชย์ จำกัด (มหาชน)		
วันที่จดทะเบียน :	28 พ.ค. 2552		
อายุโครงการ :	ไม่กำหนดอายุโครงการ		
การซื้อหน่วยลงทุน :	วันทำการซื้อ	ตามวันทำการกองทุน ภายใน 15:30 น.	
	มูลค่าขั้นต่ำของการซื้อครั้งแรก	2,000 บาท	
	มูลค่าขั้นต่ำของการซื้อครั้งต่อไป	2,000 บาท	
การขายคืนหน่วยลงทุน :	วันทำการขายคืน	ตามวันทำการกองทุน ภายใน 15:30 น.	
	มูลค่าขั้นต่ำของการขายคืน	2,000 บาท หรือ 200 หน่วย	
	ยอดคงเหลือขั้นต่ำ	200 หน่วย	
	ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน	3 วันทำการหลังจากวันทำการขายคืน โดยไม่นับรวมวันหยุดต่างประเทศ (T+3)	
	ผู้ลงทุนสามารถตรวจสอบมูลค่าทรัพย์สินรายวันได้ที่ www.krungsriasset.com		
รายชื่อผู้จัดการกองทุน :	ชื่อ-นามสกุล	ขอบเขตหน้าที่	วันที่เริ่มบริหารกองทุน
	นายจาตุรนต์ สอนไ	ผู้จัดการกองทุนที่ลงทุนในหลักทรัพย์ต่างประเทศ	13 ก.ย. 2554
	นายชูศักดิ์ อวยพรชัยสกุล	ผู้จัดการกองทุนที่ลงทุนในหลักทรัพย์ต่างประเทศ	5 ม.ค. 2560
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุนของกองทุน (Portfolio Turnover Ratio)	ในรอบระยะเวลาที่ผ่านมาย้อนหลัง 1 ปี เท่ากับ 40.12% กรณีกองทุนรวมที่จดทะเบียนจัดตั้งไม่ถึง 1 ปี จะแสดงค่าที่เกิดขึ้นจริงในช่วงเวลาตั้งแต่วันที่จดทะเบียนถึงวันที่รายงาน		
ผู้สนับสนุนการขายหรือรับซื้อคืน	ธนาคารกรุงศรีอยุธยา จำกัด (มหาชน) ทุกสาขา โทร 1572 บลจ.กรุงศรี หรือตัวแทนสนับสนุนการขายและรับซื้อคืน		
ติดต่อสอบถาม รับหนังสือชี้ชวน/ร้องเรียน	บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด ที่อยู่ 898 อาคารเพลินจิตทาวเวอร์ ชั้น 1-2 โชนเอ ชั้น 12 ชั้น 18 โชนบี ถนนเพลินจิต แขวงลุมพินี เขตปทุมวัน กรุงเทพฯ 10330 โทรศัพท์ 0 2657 5757 โทรสาร 02 657 5777 เว็บไซต์ : www.krungsriasset.com อีเมลล์ : krungsriasset.clientservice@krungsri.com		
ธุรกรรมที่อาจก่อให้เกิดความขัดแย้งทางผลประโยชน์	คุณสามารถตรวจสอบธุรกรรมที่อาจก่อให้เกิดความขัดแย้งทางผลประโยชน์ได้ที่ www.krungsriasset.com/th/Investment/RelatedPartyTransactions.html		
ข้อมูลอื่นๆ	ขนาดกองทุน	422 ล้านบาท	
	มูลค่าหน่วยลงทุน	3.8328 บาท/หน่วย	

หมายเหตุ

- การลงทุนในหน่วยลงทุนไม่ใช่การฝากเงิน รวมทั้งไม่ได้อยู่ภายใต้ความคุ้มครองของสถาบันคุ้มครองเงินฝาก จึงมีความเสี่ยงจากการลงทุนซึ่งผู้ลงทุนอาจไม่ได้รับเงินลงทุนคืนเต็มจำนวน
- ได้รับอนุมัติจัดตั้ง และอยู่ภายใต้การกำกับดูแลของสำนักงาน ก.ล.ต
- การพิจารณาร่างหนังสือชี้ชวนในการเสนอขายหน่วยลงทุนของกองทุนรวมนี้มิได้เป็นการแสดงว่าสำนักงาน ก.ล.ต. ด้รับรองถึงความถูกต้องของข้อมูลในหนังสือชี้ชวนของกองทุนรวม หรือ ได้ประกันราคาหรือผลตอบแทนของหน่วยลงทุนที่เสนอขายนั้น ทั้งนี้ บริษัทจัดการกองทุนรวมได้สอบทานข้อมูลในหนังสือชี้ชวนส่วนสรุปข้อมูลสำคัญ ณ วันที่ 30 มิ.ย. 2564 แล้วด้วยความระมัดระวังในฐานะผู้รับผิดชอบในการดำเนินการของกองทุนรวมและขอรับรองว่าข้อมูลดังกล่าวถูกต้องไม่เป็นเท็จและไม่ทำให้ผู้อื่นสำคัญผิด
- ข้อมูลการจัดอันดับกองทุนเป็นกรรมสิทธิ์ของบริษัท มอร์นิ่งสตาร์ ทั้งนี้บริษัทขอสงวนสิทธิ์ 1) ในการแก้ไข ปรับปรุง หรือเปลี่ยนแปลงข้อมูลใดๆ โดยไม่จำเป็นต้องแจ้งให้ทราบล่วงหน้าแต่อย่างใด 2) บริษัทขอสงวนสิทธิ์ที่จะไม่รับผิดชอบต่อความถูกต้อง ครบถ้วน และความเสียหายต่างๆ ที่เกิดขึ้นทุกกรณีจากการนำรายงานหรือข้อมูลไปใช้อ้างอิง

ข้อตกลงและเงื่อนไขของข้อมูลเปรียบเทียบผลการดำเนินงานแบบเปอร์เซ็นต์ไทล์

1. ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุน มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต
2. ผู้ลงทุนสามารถดูข้อมูลฉบับเต็มได้ที่ www.aimc.or.th
3. ผลการดำเนินงานของกองทุนที่การเปรียบเทียบแบ่งตามประเภทกองทุนรวมภายใต้ข้อกำหนดของสมาคมบริษัทจัดการลงทุน โดยกองทุนที่จะถูกเปรียบเทียบผลการดำเนินงานในแต่ละช่วงเวลากับกองทุนประเภทเดียวกันในระดับเปอร์เซ็นต์ไทล์ (Percentiles) ต่างๆ โดยแบ่งออกเป็น
 - 5th Percentile แสดงผลการดำเนินงานของกองทุนอันดับที่ 5 เปอร์เซ็นต์ไทล์ (Top 5% performance)
 - 25th Percentile แสดงผลการดำเนินงานของกองทุนอันดับที่ 25 เปอร์เซ็นต์ไทล์ (Top 25% performance)
 - 50th Percentile แสดงผลการดำเนินงานของกองทุนอันดับที่ 50 เปอร์เซ็นต์ไทล์ (Median performance)
 - 75th Percentile แสดงผลการดำเนินงานของกองทุนอันดับที่ 75 เปอร์เซ็นต์ไทล์ (Bottom 25% performance)
 - 95th Percentile แสดงผลการดำเนินงานของกองทุนอันดับที่ 95 เปอร์เซ็นต์ไทล์ (Bottom 5% performance)
4. ผลตอบแทนที่มีอายุเกินหนึ่งปีนั้นมีการแสดงเป็นผลตอบแทนต่อปี

เมื่อผู้ลงทุนทราบผลตอบแทนของกองทุนที่ลงทุน สามารถนำไปเปรียบเทียบกับเปอร์เซ็นต์ไทล์ตามตาราง จะทราบว่ากองทุนที่ลงทุนนั้นอยู่ในช่วงที่เท่าใดของประเภทกองทุนรวมนั้น

คำอธิบายรายละเอียดของข้อมูลที่ต้องเปิดเผยในหนังสือชี้ชวนส่วนสรุปข้อมูลสำคัญ

ข้อมูลที่เปิดเผยในส่วนนี้เป็นข้อมูล โดยสังเขปเพื่อใช้อธิบายมิติความเสี่ยงต่างๆ

	หัวข้อ	การเปิดเผยข้อมูล										
1	ความเสี่ยงจากความผันผวนของมูลค่าหน่วยลงทุน (Market Risk)	<p>แบ่งเป็นกรณีกองทุนรวมต่างๆ ดังต่อไปนี้</p> <table border="1" data-bbox="416 297 1497 465"> <tr> <td data-bbox="416 297 727 465">- กรณีกองทุนรวมทั่วไป ความผันผวนของ ผลการดำเนินงาน (SD)</td> <td data-bbox="727 297 1497 465">พิจารณาค่าความผันผวนของผลการดำเนินงานกองทุนรวม (standard deviation : SD) ต่อปี ต่ำ สูง</td> </tr> <tr> <td colspan="2" data-bbox="799 398 1369 465"> <table border="1" style="width:100%; text-align:center;"> <tr> <td>< 5%</td> <td>5-10%</td> <td>10-15%</td> <td>15-25%</td> <td>> 25%</td> </tr> </table> </td> </tr> </table> <p>กรณีกองทุนรวมทั่วไป หมายถึง ความเสี่ยงที่มูลค่าของหลักทรัพย์ที่กองทุนรวมลงทุนจะเปลี่ยนแปลงเพิ่มขึ้นหรือลดลงจากปัจจัยภายนอก เช่น สภาพเศรษฐกิจการลงทุน ปัจจัยทางการเมืองทั้งในและต่างประเทศ เป็นต้น ซึ่งพิจารณาได้จากค่า standard deviation (SD) ของกองทุนรวม หากกองทุนรวมมีค่า SD สูง แสดงว่ากองทุนรวมมีความผันผวนจากการเปลี่ยนแปลงของราคาหลักทรัพย์สูง</p>	- กรณีกองทุนรวมทั่วไป ความผันผวนของ ผลการดำเนินงาน (SD)	พิจารณาค่าความผันผวนของผลการดำเนินงานกองทุนรวม (standard deviation : SD) ต่อปี ต่ำ สูง	<table border="1" style="width:100%; text-align:center;"> <tr> <td>< 5%</td> <td>5-10%</td> <td>10-15%</td> <td>15-25%</td> <td>> 25%</td> </tr> </table>		< 5%	5-10%	10-15%	15-25%	> 25%	
- กรณีกองทุนรวมทั่วไป ความผันผวนของ ผลการดำเนินงาน (SD)	พิจารณาค่าความผันผวนของผลการดำเนินงานกองทุนรวม (standard deviation : SD) ต่อปี ต่ำ สูง											
<table border="1" style="width:100%; text-align:center;"> <tr> <td>< 5%</td> <td>5-10%</td> <td>10-15%</td> <td>15-25%</td> <td>> 25%</td> </tr> </table>		< 5%	5-10%	10-15%	15-25%	> 25%						
< 5%	5-10%	10-15%	15-25%	> 25%								
2	ความเสี่ยงจากการเปลี่ยนแปลงของอัตราแลกเปลี่ยน (Currency Risk)	<table border="1" data-bbox="416 763 1497 981"> <tr> <td data-bbox="416 763 743 898">ความเสี่ยงจากการเปลี่ยนแปลงของอัตราแลกเปลี่ยน (exchange rate risk)</td> <td data-bbox="743 763 1497 898">พิจารณาจากนโยบายการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยนของกองทุนรวม</td> </tr> <tr> <td data-bbox="416 898 743 981">การป้องกันความเสี่ยง fx</td> <td data-bbox="743 898 1497 981"> <table border="1" style="width:100%; text-align:center;"> <tr> <td>ต่ำ</td> <td>ทั้งหมด/เกือบทั้งหมด</td> <td>บางส่วน</td> <td>ดูลยพินิจ</td> <td>ไม่ป้องกัน</td> <td>สูง</td> </tr> </table> </td> </tr> </table> <p>ความเสี่ยงจากการเปลี่ยนแปลงของอัตราแลกเปลี่ยน (Currency Risk) หมายถึง การเปลี่ยนแปลงของอัตราแลกเปลี่ยนมีผลกระทบต่อมูลค่าของหน่วยลงทุน เช่น กองทุนรวมลงทุนด้วยสกุลเงินดอลลาร์ในช่วงที่เงินบาทอ่อน แต่ขายทำกำไรในช่วงที่บาทแข็ง กองทุนรวมจะได้เงินบาทกลับมาน้อยลง ในทางกลับกันหากกองทุนรวมลงทุนในช่วงที่บาทแข็งและขายทำกำไรในช่วงที่บาทอ่อนก็อาจได้ผลตอบแทนมากขึ้นกว่าเดิมด้วยเช่นกัน ดังนั้น การป้องกัน ความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยนจึงเป็นเครื่องมือสำคัญในการบริหารความเสี่ยงจากดังกล่าว ซึ่งทำได้ดังต่อไปนี้</p> <ul style="list-style-type: none"> ● ป้องกันความเสี่ยงทั้งหมดหรือเกือบทั้งหมด : ผู้ลงทุนไม่มีความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน ● ป้องกันความเสี่ยงบางส่วน โดยต้องระบุสัดส่วนการป้องกันความเสี่ยงไว้อย่างชัดเจน : ผู้ลงทุนอาจมีความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน ● อาจป้องกันความเสี่ยงตามดุลยพินิจของผู้จัดการกองทุนรวม : ผู้ลงทุนอาจมีความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน เนื่องจากการป้องกันความเสี่ยงขึ้นอยู่กับดุลยพินิจของผู้จัดการกองทุนรวมในการพิจารณาว่าจะป้องกัน ความเสี่ยงหรือไม่ ● ไม่ป้องกันความเสี่ยงเลย : ผู้ลงทุนมีความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน 	ความเสี่ยงจากการเปลี่ยนแปลงของอัตราแลกเปลี่ยน (exchange rate risk)	พิจารณาจากนโยบายการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยนของกองทุนรวม	การป้องกันความเสี่ยง fx	<table border="1" style="width:100%; text-align:center;"> <tr> <td>ต่ำ</td> <td>ทั้งหมด/เกือบทั้งหมด</td> <td>บางส่วน</td> <td>ดูลยพินิจ</td> <td>ไม่ป้องกัน</td> <td>สูง</td> </tr> </table>	ต่ำ	ทั้งหมด/เกือบทั้งหมด	บางส่วน	ดูลยพินิจ	ไม่ป้องกัน	สูง
ความเสี่ยงจากการเปลี่ยนแปลงของอัตราแลกเปลี่ยน (exchange rate risk)	พิจารณาจากนโยบายการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยนของกองทุนรวม											
การป้องกันความเสี่ยง fx	<table border="1" style="width:100%; text-align:center;"> <tr> <td>ต่ำ</td> <td>ทั้งหมด/เกือบทั้งหมด</td> <td>บางส่วน</td> <td>ดูลยพินิจ</td> <td>ไม่ป้องกัน</td> <td>สูง</td> </tr> </table>	ต่ำ	ทั้งหมด/เกือบทั้งหมด	บางส่วน	ดูลยพินิจ	ไม่ป้องกัน	สูง					
ต่ำ	ทั้งหมด/เกือบทั้งหมด	บางส่วน	ดูลยพินิจ	ไม่ป้องกัน	สูง							
3	ความเสี่ยงจากการลงทุนกระจุกตัว (High concentration risk) - ความเสี่ยงจากการลงทุนกระจุกตัวในผู้ออกตราสารรายใดรายหนึ่ง (High issuer concentration)	<p>ความเสี่ยงจากการลงทุนกระจุกตัว (High concentration risk) แบ่งเป็นความเสี่ยงแบบต่างๆ ดังต่อไปนี้</p> <table border="1" data-bbox="719 1682 1533 1787"> <tr> <td data-bbox="719 1682 879 1787">การลงทุนกระจุกตัวในผู้ออกตราสารรวม</td> <td data-bbox="879 1682 1038 1787">ต่ำ</td> <td data-bbox="1038 1682 1198 1787">สูง</td> </tr> <tr> <td></td> <td style="text-align:center;">≤ 10%</td> <td style="text-align:center;">10-20%</td> <td style="text-align:center;">20-50%</td> <td style="text-align:center;">50-80%</td> <td style="text-align:center;">> 80%</td> </tr> </table> <p>พิจารณาจากการลงทุนแบบกระจุกตัวในตราสารของผู้ออกตราสาร คู่สัญญา หรือบุคคลอื่นที่มีภาระผูกพันตามตราสารหรือสัญญานั้น รายใดรายหนึ่งมากกว่า 10% ของ NAV รวมกัน</p> <p>ทั้งนี้ การลงทุนแบบกระจุกตัวไม่รวมถึงกรณีการลงทุนในทรัพย์สินดังนี้</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. ตราสารหนี้ภาครัฐไทย 2. ตราสารภาครัฐต่างประเทศที่มีการจัดอันดับความน่าเชื่อถืออยู่ในอันดับที่สามารถลงทุนได้ 	การลงทุนกระจุกตัวในผู้ออกตราสารรวม	ต่ำ	สูง		≤ 10%	10-20%	20-50%	50-80%	> 80%	
การลงทุนกระจุกตัวในผู้ออกตราสารรวม	ต่ำ	สูง										
	≤ 10%	10-20%	20-50%	50-80%	> 80%							

	หัวข้อ	การเปิดเผยข้อมูล												
	<p>risk)</p> <p>- ความเสี่ยงจากการลงทุนกระจุกตัวในหมวดอุตสาหกรรมใดอุตสาหกรรมหนึ่ง (High sector concentration risk)</p> <p>- ความเสี่ยงจากการลงทุนกระจุกตัวในประเทศใดประเทศหนึ่ง (High country concentration risk)</p>	<p>3. เงินฝากหรือตราสารเทียบเท่าเงินฝากที่ผู้รับฝากหรือผู้ออกตราสารที่มีการจัดอันดับความน่าเชื่อถืออยู่ในอันดับที่สามารถลงทุนได้</p> <table border="1" data-bbox="722 257 1541 349"> <tr> <td style="text-align: center;">ต่ำ</td> <td style="text-align: center;">สูง</td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">≤ 20%</td> <td style="text-align: center;">20-50%</td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">50-80%</td> <td style="text-align: center;">> 80%</td> </tr> </table> <p>การลงทุนกระจุกตัวในหมวดอุตสาหกรรมรวม หมายเหตุ: กองทุนรวมมีการลงทุนกระจุกตัวในหมวดอุตสาหกรรม...</p> <p>พิจารณาจากการลงทุนกระจุกตัวในหมวดอุตสาหกรรมใดอุตสาหกรรมหนึ่งมากกว่า 20% ของ NAV รวมกัน ทั้งนี้ไม่รวมถึงกรณีการลงทุนในทรัพย์สินดังนี้ ตราสารหนี้ภาครัฐไทย และต่างประเทศ</p> <p>เงินฝากหรือตราสารเทียบเท่าเงินฝาก</p> <table border="1" data-bbox="722 645 1541 736"> <tr> <td style="text-align: center;">ต่ำ</td> <td style="text-align: center;">สูง</td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">≤ 20%</td> <td style="text-align: center;">20-50%</td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">50-80%</td> <td style="text-align: center;">> 80%</td> </tr> </table> <p>การลงทุนกระจุกตัวรายประเทศรวม หมายเหตุ: กองทุนรวมมีการลงทุนกระจุกตัวในประเทศ</p> <p>พิจารณาจากการลงทุนแบบกระจุกตัวในประเทศใดประเทศหนึ่งมากกว่า 20% ของ NAV รวมกัน ทั้งนี้ไม่รวมถึงการลงทุนในตราสารที่ผู้ออกเสนอขายอยู่ในประเทศไทย</p>	ต่ำ	สูง	≤ 20%	20-50%	50-80%	> 80%	ต่ำ	สูง	≤ 20%	20-50%	50-80%	> 80%
ต่ำ	สูง													
≤ 20%	20-50%													
50-80%	> 80%													
ต่ำ	สูง													
≤ 20%	20-50%													
50-80%	> 80%													
4	<p>ผลขาดทุนสูงสุดที่เกิดขึ้นจริง 5 ปี (Maximum Drawdown)</p>	$\text{Drawdown}_{(t)} = \frac{\text{มูลค่าหน่วยลงทุน}_{(t)} - \text{มูลค่าหน่วยลงทุนสูงสุด}^*}{\text{มูลค่าหน่วยลงทุนสูงสุด}^*}$ $\text{Maximum Drawdown} = \min(\text{Drawdown}_{(t)})$ <p>หมายเหตุ : * มูลค่าหน่วยลงทุนสูงสุด คือ มูลค่าหน่วยลงทุนสูงสุดของระยะเวลาก่อนหน้าจนถึงวันที่คำนวณ (t)</p> <p>ผลขาดทุนสะสมสูงสุดที่เกิดจากการลงทุนจริงของกองทุนรวมย้อนหลังเป็นระยะเวลาอย่างน้อย 5 ปี นับแต่วันที่รายงาน (หรือตั้งแต่จัดตั้งกองทุนรวมกรณียังไม่ครบ 5 ปี) โดยมีวิธีการคำนวณดังนี้</p>												
5	<p>ค่าความผันผวนของผลการดำเนินงาน (Standard Deviation : SD)</p>	<p>คือความผันผวนของผลตอบแทนกองทุน (Standard Deviation of Fund) คำนวณจากผลตอบแทนของกองทุนรวมซึ่งมีวิธีการคำนวณเป็นไปตามหลักเกณฑ์ของสมาคมบริษัทจัดการลงทุนว่าด้วยมาตรฐานการวัดและนำเสนอผลการดำเนินงานของกองทุนรวม ใช้การเปิดเผยค่า SD ของกองทุนรวมย้อนหลังเป็นระยะเวลา 5 ปี นับแต่วันที่รายงาน แสดงเป็น % ต่อปี</p>												
6	<p>ค่าความผันผวนของส่วนต่างของผลตอบแทนเฉลี่ยของกองทุนรวมและผลตอบแทนของดัชนีชี้วัด (Tracking Error)</p>	<p>Tracking Error คือ ความผันผวนของส่วนต่างของผลตอบแทนเฉลี่ยของกองทุนรวมและผลตอบแทนของดัชนีชี้วัด ซึ่งสะท้อนให้เห็นถึงประสิทธิภาพในการเลียนแบบดัชนีชี้วัดของกองทุนรวมว่ามีการเบี่ยงเบนออกไปจากดัชนีชี้วัดมากน้อยเพียงใด เช่น หากกองทุนรวมมีค่า TE ต่ำ แสดงว่า อัตราผลตอบแทนของกองทุนมีการเบี่ยงเบนออกไปจาก ดัชนีชี้วัดในอัตราที่ต่ำ ดังนั้น กองทุนรวมนี้จึงมีประสิทธิภาพในการเลียนแบบดัชนีชี้วัด อ้างอิง ในขณะที่กองทุนรวมที่มีค่า TE สูง แสดงว่าอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมมีการเบี่ยงเบนออกจากดัชนีชี้วัดในอัตราที่สูง ดังนั้น โอกาสที่ผลตอบแทน การลงทุนจะเป็นไปตามผลตอบแทนของ benchmark ก็จะลดน้อยลง เป็นต้น</p> <p>ใช้พิจารณากับกองทุนรวมที่มีนโยบายการบริหารกองทุนแบบ passive fund/ Index tracking เช่น กองทุนรวมดัชนี หรือกองทุนรวมอียูเอฟ เป็นต้น</p>												

	หัวข้อ	การเปิดเผยข้อมูล
7	อัตราส่วน หมุนเวียนการ ลงทุนของกองทุน รวม (Portfolio Turnover Ratio : PTR)	<div style="border: 1px solid black; padding: 10px; margin-bottom: 10px; width: fit-content; margin-left: auto; margin-right: auto;"> $PTR = \frac{\text{Min (ซื้อหุ้น , ขายหุ้น)}}{\text{Avg. NAV}}$ </div> <p>เพื่อให้ผู้ลงทุน ทราบถึงปริมาณการซื้อขายทรัพย์สินของกองทุน และช่วยสะท้อนกลยุทธ์การลงทุนของ ผู้จัดการกองทุน ได้ดียิ่งขึ้น โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อขายทรัพย์สินกับผลรวม ของมูลค่าการขายทรัพย์สินที่กองทุนรวมลงทุนในรอบระยะเวลาผ่านมาย้อนหลัง 1 ปี หารด้วยมูลค่าทรัพย์สิน สุทธิเฉลี่ยของกองทุนรวมในรอบระยะเวลาเดียวกัน</p>