

กองทุนเปิดเค หุ่นกู้ ชนิดผู้ลงทุนทั่วไป

K-CBOND-A

ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

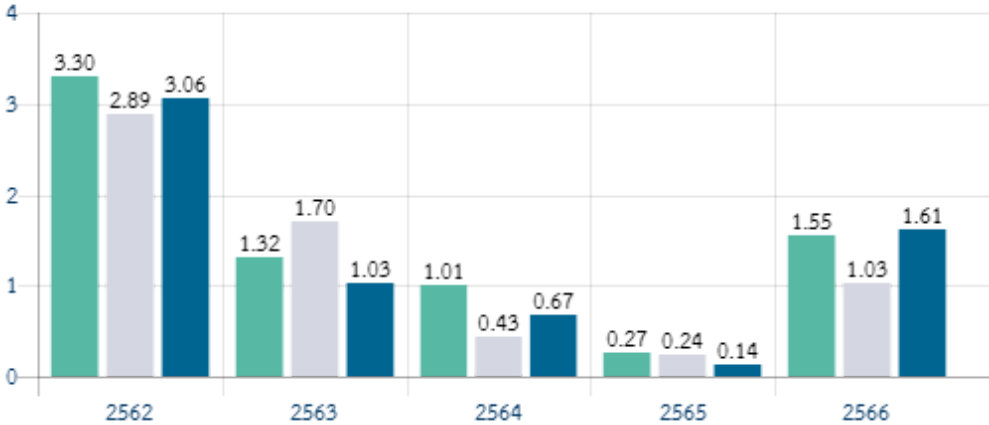
- กองทุนรวมตราสารหนี้
- กลุ่ม Mid Term General Bond

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- ลงทุนในตราสารหนี้ที่ออกโดยบริษัทเอกชนและหรือรัฐวิสาหกิจในประเทศ ซึ่งคาดว่าจะให้ผลตอบแทนจากดอกเบี้ยและหรือกำไรส่วนเกินทุนในระดับสูง
- อาจลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเพื่อการเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน (Efficient Portfolio Management)
- มุ่งหวังให้ผลประกอบการเคลื่อนไหวตามดัชนีชี้วัด และในบางโอกาสอาจสร้างผลตอบแทนสูงกว่าดัชนีชี้วัด

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (% ต่อปี)

กองทุน ดัชนีชี้วัด ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน



ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปีหมุน (%)

	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี *
กองทุน	1.28	0.40	1.28	2.49
ดัชนีชี้วัด	1.04	0.27	1.04	1.90
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	1.30	0.47	1.30	2.47
ความผันผวนกองทุน	0.50	0.60	0.50	0.52
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	0.39	0.46	0.39	0.36
	3 ปี *	5 ปี *	10 ปี *	ตั้งแต่จัดตั้ง *
กองทุน	1.12	1.43	1.91	2.60
ดัชนีชี้วัด	0.81	1.22	1.91	3.05
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	1.03	1.31	1.69	N/A
ความผันผวนกองทุน	0.59	0.64	0.54	0.92
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	0.46	0.57	0.76	1.80

หมายเหตุ : * % ต่อปี

ระดับความเสี่ยง

ต่ำ 1 2 3 4 5 6 7 8 สูง

ความเสี่ยงปานกลางค่อนข้างต่ำ

ลงทุนในพันธบัตรรัฐบาล และตราสารหนี้เอกชน โดยมีตราสาร non-investment grade/unrated ไม่เกิน 20% ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน	22 พ.ย. 42
วันเริ่มต้น class	22 พ.ย. 42
นโยบายการจ่ายเงินปันผล	ไม่จ่าย
อายุกองทุน	ไม่กำหนด

ผู้จัดการกองทุนรวม

น.ส. จริยา พิมลไพบุลย์ (ตั้งแต่ 1 ก.พ. 67)

ดัชนีชี้วัด :

- อัตราดอกเบี้ยเงินฝากประจำ 1 ปี วงเงินน้อยกว่า 5 ล้านบาท เฉลี่ยของ 3 ธนาคารพาณิชย์ขนาดใหญ่ ได้แก่ ธนาคารกรุงเทพ ธนาคารกสิกรไทย และธนาคารไทยพาณิชย์ หลังหักภาษี (25.00%)
 - ผลตอบแทนรวมสุทธิของดัชนีตราสารหนี้ภาคเอกชน Mark-to-Market ที่มีอันดับความน่าเชื่อถือของผู้ออกตราสารอยู่ในระดับ A- ขึ้นไป อายุ 1 - 3 ปี ของสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย (25.00%)
 - ผลตอบแทนรวมสุทธิของดัชนีพันธบัตรรัฐบาลอายุ 1 - 3 ปี ของสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย (50.00%)
- วัตถุประสงค์ในการอ้างอิงดัชนีชี้วัด : เพื่อใช้เป็นตัวแทนองค์ประกอบของพอร์ตโฟลิโอและเปรียบเทียบผลการดำเนินงานของกองทุน

คำเตือน:

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวม มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต : ได้รับการรับรองจาก CAC

อันดับกองทุน Morningstar

★★★★

Morningstar Overall Rating™

Thailand Fund Short Term Bond

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

ผู้ลงทุนสามารถศึกษา
เครื่องมือบริหารความเสี่ยง
ด้านสภาพคล่องได้ใน
หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



www.kasikornasset.com

การซื้อขายหน่วยลงทุน	การขายคืนหน่วยลงทุน
วันทำการซื้อ : ทุกวันทำการ	วันทำการขายคืน : ทุกวันทำการ
เวลาทำการ : 08:30 น. - 15:30 น.	เวลาทำการ : 08:30 น. - 15:30 น.
การซื้อขายครั้งแรกขั้นต่ำ : 500 บาท	การขายคืนขั้นต่ำ : 500 บาท
การซื้อขายครั้งถัดไปขั้นต่ำ : 500 บาท	ยอดคงเหลือขั้นต่ำ : 50 บาท
	ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน : T+2
	(ประกาศ NAV T+1)
หมายเหตุ :	

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)		
ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	0.8025	0.4280
รวมค่าใช้จ่าย	2.0758	0.7811
หมายเหตุ : ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะ หรือภาษีอื่นใดแล้ว		
• บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริง เพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ		

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)		
ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การขาย	0.50	ยกเว้น
การรับซื้อคืน	0.50	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
หุ้นกู้	74.67	พันธบัตร (CBF25512A)	7.40
พันธบัตร	24.47	พันธบัตร (LB27NA)	3.51
เงินฝาก	1.06	หุ้นกู้ (TLT268B)	3.19
อื่นๆ	-0.19	พันธบัตร (CBF25428A)	3.17
		หุ้นกู้ (TBEV26NA)	2.81

ข้อมูลเชิงสถิติ	
Maximum Drawdown	-1.78 %
Recovering Period	6.41 เดือน
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน	1.00 เท่า
อายุเฉลี่ยของตราสารหนี้	2 ปี 2.40 เดือน
Yield to Maturity	2.93% ต่อปี

การจัดสรรการลงทุนในผู้ออกตราสาร 5 อันดับแรก		
	ผู้ออก	% NAV
ธ.แห่งประเทศไทย		
		13.56
กระทรวงการคลัง		
		10.91
บมจ.เงินดีดล้อ		
		6.63
บมจ.ศุภาลัย		
		5.22
บมจ. ซีพี ออลล์		
		4.68

การจัดสรรการลงทุนตามอันดับความน่าเชื่อถือ (%)			
	ในประเทศ	National	International
Gov Bond/AAA	34.62		
AA	10.50		
A	46.78		
BBB	8.25		

คำอธิบาย

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

Recovering Period ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาดังแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลานานเท่าใด

FX Hedging เพอร์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตกองทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลาหนึ่ง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์กับผลรวมของมูลค่าการขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 1 ปีหารด้วยมูลค่า NAV ของกองทุนรวมเฉลี่ยในรอบระยะเวลาเดียวกัน กองทุนรวมที่มีค่าอัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุนสูง 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 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

๑. สวงสิทธิ์ 2024 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 กลีกรไทย จำกัด
ที่อยู่ : 400/22 อาคารธนาคารกลีกรไทย ชั้น 6 และ 12 ถนนพหลโยธิน
แขวงสามเสนใน เขตพญาไท กรุงเทพฯ 10400
โทรศัพท์ : 0 - 2673 - 3888
website : www.kasikornasset.com
email : ka.customer@kasikornasset.com

กองทุนเปิดเค หุ่นกู้ ชนิดผู้ลงทุนสถาบันพิเศษ

K-CBOND-Z

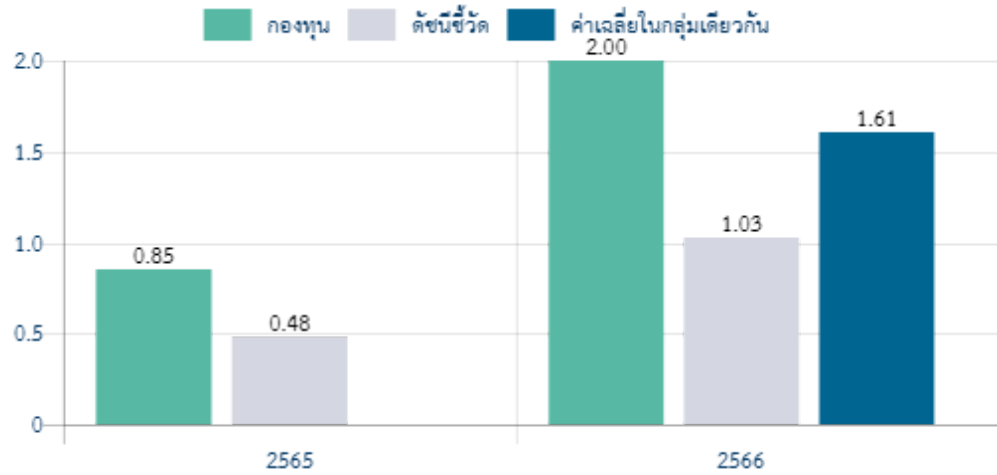
ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมตราสารหนี้
- กลุ่ม Mid Term General Bond

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- ลงทุนในตราสารหนี้ที่ออกโดยบริษัทเอกชนและหรือรัฐวิสาหกิจในประเทศ ซึ่งคาดว่าจะให้ผลตอบแทนจากดอกเบี้ยและหรือกำไรส่วนเกินทุนในระดับสูง
- อาจลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเพื่อการเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน (Efficient Portfolio Management)
- มุ่งหวังให้ผลประกอบการเคลื่อนไหวตามดัชนีชี้วัด และในบางโอกาสอาจสร้างผลตอบแทนสูงกว่าดัชนีชี้วัด

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (% ต่อปี)



ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปีหมุน (%)

	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี *
กองทุน	1.51	0.51	1.51	2.95
ดัชนีชี้วัด	1.04	0.27	1.04	1.90
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	1.30	0.47	1.30	2.47
ความผันผวนกองทุน	0.51	0.60	0.51	0.52
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	0.39	0.46	0.39	0.36
	3 ปี *	5 ปี *	10 ปี *	ตั้งแต่จัดตั้ง *
กองทุน	N/A	N/A	N/A	1.93
ดัชนีชี้วัด	N/A	N/A	N/A	1.14
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	N/A	N/A	N/A	N/A
ความผันผวนกองทุน	N/A	N/A	N/A	0.61
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	N/A	N/A	N/A	0.50

หมายเหตุ : * % ต่อปี

ระดับความเสี่ยง

ต่ำ 1 2 3 4 5 6 7 8 สูง

ความเสี่ยงปานกลางค่อนข้างต่ำ

ลงทุนในพันธบัตรรัฐบาล และตราสารหนี้เอกชน โดยมีตราสาร non-investment grade/unrated ไม่เกิน 20% ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน	22 พ.ย. 42
วันเริ่มต้น class	29 มี.ค. 65
นโยบายการจ่ายเงินปันผล	ไม่จ่าย
อายุกองทุน	ไม่กำหนด

ผู้จัดการกองทุนรวม

น.ส. จริยา พิมพ์ไพบุลย์ (ตั้งแต่ 1 ก.พ. 67)

ดัชนีชี้วัด :

- อัตราดอกเบี้ยเงินฝากประจำ 1 ปี วงเงินน้อยกว่า 5 ล้านบาท เฉลี่ยของ 3 ธนาคารพาณิชย์ขนาดใหญ่ ได้แก่ ธนาคารกรุงเทพ ธนาคารกสิกรไทย และธนาคารไทยพาณิชย์ หลังหักภาษี (25.00%)
 - ผลตอบแทนรวมสุทธิของดัชนีตราสารหนี้ภาคเอกชน Mark-to-Market ที่มีอันดับความน่าเชื่อถือของผู้ออกตราสารอยู่ในระดับ A- ขึ้นไป อายุ 1 - 3 ปี ของสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย (25.00%)
 - ผลตอบแทนรวมสุทธิของดัชนีพันธบัตรรัฐบาลอายุ 1 - 3 ปี ของสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย (50.00%)
- วัตถุประสงค์ในการอ้างอิงดัชนีชี้วัด : เพื่อใช้เป็นตัวแทนองค์ประกอบของพอร์ตโฟลิโอและเปรียบเทียบผลการดำเนินงานของกองทุน

คำเตือน:

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวม มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต : ได้รับการรับรองจาก CAC

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

ผู้ลงทุนสามารถศึกษา
เครื่องมือบริหารความเสี่ยง
ด้านสภาพคล่องได้ใน
หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



www.kasikornasset.com

การซื้อขายหน่วยลงทุน	การขายคืนหน่วยลงทุน
วันทำการซื้อ : ทุกวันทำการ	วันทำการขายคืน : ทุกวันทำการ
เวลาทำการ : 08:30 น. - 15:30 น.	เวลาทำการ : 08:30 น. - 16:00 น.
การซื้อขายครั้งแรกขั้นต่ำ : 500 บาท	การขายคืนขั้นต่ำ : 500 บาท
การซื้อขายครั้งถัดไปขั้นต่ำ : 500 บาท	ยอดคงเหลือขั้นต่ำ : 50 บาท
	ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน : T+2
	(ประกาศ NAV T+1)
หมายเหตุ :	

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)		
ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	0.8025	ยกเว้น
รวมค่าใช้จ่าย	2.0758	0.3531
หมายเหตุ : ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะ หรือภาษีอื่นใดแล้ว		
• บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริง เพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ		

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)		
ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การขาย	0.50	ยกเว้น
การรับซื้อคืน	0.50	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
หุ้นกู้	74.67	พันธบัตร (CBF25512A)	7.40
พันธบัตร	24.47	พันธบัตร (LB27NA)	3.51
เงินฝาก	1.06	หุ้นกู้ (TLT268B)	3.19
อื่นๆ	-0.19	พันธบัตร (CBF25428A)	3.17
		หุ้นกู้ (TBEV26NA)	2.81

ข้อมูลเชิงสถิติ	
Maximum Drawdown	-1.13 %
Recovering Period	2.99 เดือน
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน	1.00 เท่า
อายุเฉลี่ยของตราสารหนี้	2 ปี 2.40 เดือน
Yield to Maturity	2.93% ต่อปี

การจัดสรรการลงทุนในผู้ออกตราสาร 5 อันดับแรก	
ผู้ออก	% NAV
ธ.แห่งประเทศไทย	13.56
กระทรวงการคลัง	10.91
บมจ.เงินดีดล้อ	6.63
บมจ.ศุภาลัย	5.22
บมจ. ซีพี ออลล์	4.68

การจัดสรรการลงทุนตามอันดับความน่าเชื่อถือ (%)			
	ในประเทศ	National	International
Gov Bond/AAA	34.62		
AA	10.50		
A	46.78		
BBB	8.25		

คำอธิบาย

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

Recovering Period ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาดังแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลานานเท่าใด

FX Hedging เพอร์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตกองทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลาหนึ่ง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์กับผลรวมของมูลค่าการขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 1 ปีหารด้วยมูลค่า NAV ของกองทุนรวมเฉลี่ยในรอบระยะเวลาเดียวกัน กองทุนรวมที่มีค่าอัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุนสูง 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 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

๑ สงวนสิทธิ์ 2024 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 กลีกรไทย จำกัด
ที่อยู่ : 400/22 อาคารธนาคารกลีกรไทย ชั้น 6 และ 12 ถนนพหลโยธิน
แขวงสามเสนใน เขตพญาไท กรุงเทพฯ 10400
โทรศัพท์ : 0 - 2673 - 3888
website : www.kasikornasset.com
email : ka.customer@kasikornasset.com