

กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ตราสารหนี้ตลาดเกิดใหม่

ชนิดจ่ายเงินปันผล SCBEMBOND

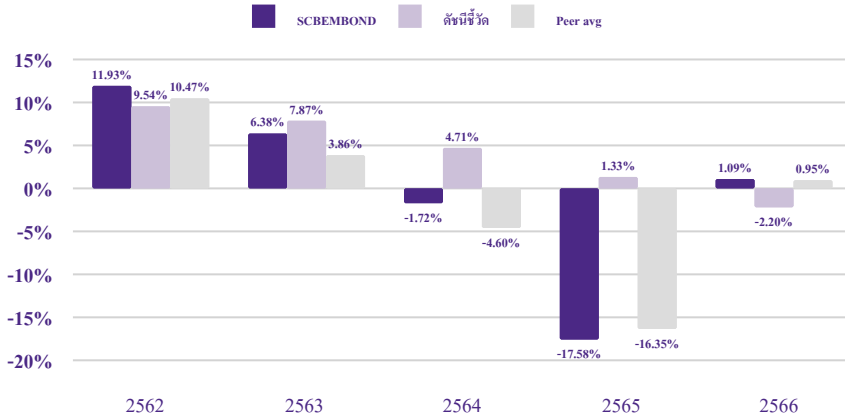
ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- ประเภทกองทุนรวม: กองทุนรวมตราสารหนี้/กองทุนรวมฟีดเดอร์ (Feeder Fund)/กองทุนรวมที่เน้นลงทุนแบบมีความเสี่ยงต่างประเทศ
- กลุ่มกองทุนรวม: Emerging Market Bond Discretionary F/X Hedge or Unhedge

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- เน้นลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมต่างประเทศเพียงกองทุนเดียว (Feeder Fund) ได้แก่ JPMorgan Funds – Emerging Markets Investment Grade Bond Fund (กองทุนหลัก) Class C (acc) สกุลเงิน USD กองทุนหลักลงทุนในตราสารหนี้ที่ได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือในระดับที่สามารถลงทุนได้ (Investment grade) ในกลุ่มประเทศตลาดเกิดใหม่
- ชื่อ บล.ที่บริหารจัดการกองทุนหลัก: J.P. Morgan Asset Management
- กองทุนอาจลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) เพื่อเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน (Efficient portfolio management) และ/หรือการบริหารความเสี่ยง โดยป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน (Hedging) ตามดุลยพินิจของผู้จัดการกองทุน
- กลยุทธ์ในการบริหารกองทุนรวม: กองทุนไทยมุ่งหวังให้ผลประกอบการเคลื่อนไหวตามกองทุนหลัก ส่วนกองทุนหลักมุ่งหวังให้ผลประกอบการสูงกว่าดัชนีชี้วัด (Active Management)

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (% ต่อปี)



หมายเหตุ: ในปีที่กองทุนจดทะเบียน ผลการดำเนินงานจะแสดงตั้งแต่วันที่จดทะเบียนกองทุนจนถึงสิ้นปีปฏิทิน

ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปีกลม

	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี ¹	3 ปี ¹	5 ปี ¹	10 ปี ¹	ตั้งแต่จัดตั้ง ¹
SCBEMBOND	2.63	3.08	3.08	8.03	-5.16	-2.11	-0.92	-1.50
ดัชนีชี้วัด	-4.14	-6.78	-6.73	-7.57	-1.74	1.44	-0.01	-0.50
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน ²	6.78	1.71	2.87	10.93	-3.65	-2.11	-0.28	N/A
ความผันผวนของกองทุน	2.93	1.36	2.46	3.99	5.24	5.91	6.36	6.86
ความผันผวนของดัชนีชี้วัด	3.40	2.08	2.68	4.28	4.41	4.84	6.75	7.22

หมายเหตุ: ¹ % ต่อปี

² ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน ตามการจัดกลุ่มกองทุนรวมของ AIMC category

ระดับความเสี่ยง

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

4 : เสี่ยงปานกลางค่อนข้างต่ำ

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

ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน 7 มีนาคม 2556

วันเริ่มต้น Class 7 มีนาคม 2556

นโยบายการจ่ายเงินปันผล จ่าย

อายุกองทุน ไม่กำหนดอายุโครงการ

ผู้จัดการกองทุนรวม

นายวิจักขณ์ ณ เชียงใหม่ 9 เมษายน 2566

น.ส.นรินทรา ดิณรัตน์สกุลชัย 2 พฤศจิกายน 2564

ดัชนีชี้วัด

(1) ดัชนี J.P. Morgan Emerging Markets Bond Index Global Diversified Investment Grade (Total Return Gross) 50% (2) ดัชนี J.P. Morgan Corporate Emerging Markets Bond Index Broad Diversified Investment Grade (Total Return Gross) 50% ปรับด้วยต้นทุนการป้องกันความเสี่ยงอัตราแลกเปลี่ยนในช่วงระยะเวลาที่คำนวณผลตอบแทนของดัชนีชี้วัดเพื่อคำนวณผลตอบแทนเป็นสกุลเงินบาทในอัตราส่วน 50% และปรับด้วยอัตราแลกเปลี่ยน เพื่อคำนวณผลตอบแทนเป็นสกุลเงินบาทในอัตราส่วน 50%

คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวม มิได้เป็นสัญญาณถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต

ได้รับการรับรองจาก CAC

การจัดอันดับกองทุน Morningstar

Overall Rating 4 ดาว จาก Morningstar ประเภท Emerging Market Bond , ณ 30 ก.ย. 2567



หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือบริหารความเสี่ยง ด้านสภาพคล่องได้ที่หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

www.scbam.com

การซื้อขายหน่วยลงทุน	การขายคืนหน่วยลงทุน
วันทำการซื้อ: ทุกวันทำการ	วันทำการขายคืน: ทุกวันทำการ
เวลาทำการ: เปิดทำการ ถึง 15.00 น. SCB EASY APP ถึง 15.00 น.	เวลาทำการ: เปิดทำการ ถึง 15.00 น. SCB EASY APP ถึง 15.00 น.
มูลค่าขั้นต่ำในการซื้อขายครั้งแรก: 1 บาท	มูลค่าขั้นต่ำในการขายคืน: 1 บาท
มูลค่าขั้นต่ำในการซื้อขายครั้งถัดไป: 1 บาท	ยอดคงเหลือขั้นต่ำ: 1 บาท
	ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน: T+5 คือ 5 วันทำการ หลังจากวันทำการขายคืน
	(ขอสงวนสิทธิ์เปลี่ยนแปลงระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืนจริงซึ่งอาจเร็วขึ้นหรือช้าลงกว่าเดิมได้ ทั้งนี้ ไม่เกิน 7 วันทำการนับจากวันทำการขายคืน)

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV รวม VAT)		
ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	2.68	0.91
รวมค่าใช้จ่าย	3.21	1.06

หมายเหตุ: - บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย รวม VAT)		
ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การขาย	0.54	0.54
การรับซื้อคืน	0.54	ยกเว้นไม่เรียกเก็บ
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า	0.54	0.54
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก	0.54	ยกเว้นไม่เรียกเก็บ
การโอนหน่วย	10 บาท ต่อ 1,000 หน่วย	10 บาท ต่อ 1,000 หน่วย

หมายเหตุ: - บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ
- ค่าใช้จ่ายในการซื้อขายหลักทรัพย์ เมื่อสั่งซื้อ/สั่งขาย/สับเปลี่ยนหน่วยลงทุน ไม่เกินร้อยละ 0.75 ของมูลค่าหน่วยลงทุน (ยกเว้นไม่เรียกเก็บ)

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน		ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก	
ประเภททรัพย์สิน	% NAV	ชื่อทรัพย์สิน	% NAV
หน่วยลงทุน	95.80	หน่วยลงทุน JPMORGAN FUNDS - EMERGING MARKETS INVESTMENT GRADE BOND	95.80
เงินฝาก	3.75		
ตราสารอนุพันธ์	2.89		
อื่น ๆ	-2.44		

ข้อมูลเชิงสถิติ	
Maximum Drawdown	-24.92%
Recovering Period	N/A
FX Hedging	-
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน	0.44 เท่า
Sharpe ratio	-
Alpha	-
Beta	-
Tracking Error	-

ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรกของกองทุนหลัก	
ชื่อทรัพย์สิน	% NAV
Government of Indonesia	1.10
Government of Morocco	0.80
KazMunayGas	0.80
Alfa Transmisora de Energia	0.80
KazMunayGas	0.80

การจัดสรรการลงทุนในต่างประเทศของกองทุนหลัก	
ประเทศ	% NAV
เม็กซิโก	8.70
ชิลี	7.90
ซาอุดีอาระเบีย	7.80
สหรัฐอเมริกาบริติช	7.40
เกาหลีใต้	6.10

การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรมของกองทุนหลัก	
กลุ่มอุตสาหกรรม (Sector)	% NAV
Government	26.60
Financial	24.60
Oil & Gas	11.90
Utilities	8.50
Industrial	5.00
อื่น ๆ	23.40

หมายเหตุ: ข้อมูลกองทุนหลักเป็นข้อมูล ณ วันที่ 30 กันยายน 2567

การลงทุนในกองทุนรวมอื่นเกินกว่า 20% ของ NAV

ชื่อกองทุน: JPMORGAN FUNDS - EMERGING MARKETS INVESTMENT GRADE BOND

ISIN code: LU0562246453

Bloomberg code: JPEIGBU LX

คำอธิบาย

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

Recovering Period ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาดังแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลาสั้นเท่าใด

FX Hedging เปรอ์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน (Portfolio Turnover) ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตของกองทุนรวมในช่วงเวลาใดช่วงเวลานึง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์กับผลรวมของมูลค่าการขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 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 สูงกว่าจะเป็นกองทุนรวมที่มีประสิทธิภาพในการบริหารจัดการลงทุนที่ดีกว่า เนื่องจากได้รับผลตอบแทนส่วนเพิ่มที่สูงกว่าภายใต้ระดับความเสี่ยงเดียวกัน

Alpha ผลตอบแทนส่วนเกินของกองทุนรวมเมื่อเปรียบเทียบกับดัชนีชี้วัด (benchmark) โดยค่า Alpha ที่สูง หมายถึง กองทุนรวมสามารถสร้างผลตอบแทนได้สูงกว่าดัชนีชี้วัด ซึ่งเป็นผลจากประสิทธิภาพของผู้จัดการกองทุนรวมในการคัดเลือกหรือหาจังหวะเข้าลงทุนในหลักทรัพย์ได้อย่างเหมาะสม

Beta ระดับและทิศทางการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุน โดยเปรียบเทียบกับอัตราการเปลี่ยนแปลงของตลาด Beta น้อยกว่า 1 แสดงว่า หลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนน้อยกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด Beta มากกว่า 1 แสดงว่า หลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนมากกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด

Tracking Error อัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมมีประสิทธิภาพในการเลียนแบบดัชนีชี้วัด โดยหาก Tracking Error ต่ำ หมายถึงกองทุนรวมมีประสิทธิภาพในการสร้างผลตอบแทนให้ใกล้เคียงกับดัชนีชี้วัด กองทุนรวมที่มีค่า Tracking Error สูง จะมีอัตราผลตอบแทนโดยเฉลี่ยห่างจากดัชนีชี้วัดมากขึ้น

Yield to Maturity อัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในตราสารหนี้โดยถือจนครบกำหนดอายุ ซึ่งคำนวณจากดอกเบี้ยที่จะได้รับในอนาคตตลอดอายุตราสารและเงินต้นที่จะได้รับคืนนำมาคิดลดเป็นมูลค่าปัจจุบัน โดยใช้ตัวอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมตราสารหนี้ คำนวณจากค่าเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักของ Yield to Maturity ของตราสารหนี้แต่ละตัวที่กองทุนรวมมีการลงทุน และเนื่องจาก Yield to Maturity มีหน่วยมาตรฐานเป็นเปอร์เซ็นต์ต่อปี จึงสามารถนำไปใช้เปรียบเทียบอัตราผลตอบแทนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีนโยบายถือครองตราสารหนี้จนครบกำหนดอายุและมีลักษณะการลงทุนที่ใกล้เคียงกันได้

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด

โทรศัพท์ : 0-2949-1500 หรือ 0-2777-7777 website: www.scbam.com

ที่อยู่ : ชั้น 7 – 8 อาคาร 1 ไทยพาณิชย์ ปาร์ค พลาซ่า เลขที่ 18 ถนนรัชดาภิเษก

แขวงจตุจักร เขตจตุจักร กรุงเทพฯ 10900