

กองทุนเปิดกรุงไทยหุ้นระยะยาว

The Krung Thai Long -Term Equity Fund

KTLF-D

ชนิดจ่ายเงินปันผล

ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมตราสารทุน
- กองทุนรวมหุ้นระยะยาว (Long Term Equity Fund : LTF)
- กองทุนที่ลงทุนแบบไม่มีความเสี่ยงต่างประเทศ
- กลุ่ม Equity General

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- ลงทุนในหุ้นสามัญที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ ที่มีปัจจัยพื้นฐานดี และ/หรือตราสารทุนซึ่งผลตอบแทนของตราสารดังกล่าวอ้างอิงกับผลตอบแทนของหุ้นหรือกลุ่มหุ้นของบริษัทจดทะเบียน แต่ไม่รวมการลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ที่มีสินค้าอ้างอิงเป็นหุ้น/ดัชนีหุ้นของบริษัทจดทะเบียน โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่า 65% ของ NAV
- กองทุนมุ่งหวังให้ผลประกอบการสูงกว่าดัชนีชี้วัด (active management)

ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด

| | YTD | 3 เดือน | 6 เดือน | 1 ปี* | 3 ปี* | 5 ปี* | 10 ปี* | ตั้งแต่ จัดตั้ง |
|--|-----|---------|---------|-------|-------|-------|--------|--------------------|
|--|-----|---------|---------|-------|-------|-------|--------|--------------------|

กองทุน

ดัชนีชี้วัด

ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน

ความผันผวนกองทุน

ความผันผวนดัชนีชี้วัด

หมายเหตุ : * % ต่อปี

ระดับความเสี่ยง

ต่ำ

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|

 สูง

เสี่ยงสูง

กองทุน LTF ที่มี net exposure ในตราสารทุนโดยเฉลี่ยรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่า 65% ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน 15/11/47

วันเริ่มต้น class 01/07/63

นโยบายการจ่ายเงินปันผล มี

อายุกองทุน ไม่กำหนดอายุโครงการ

ผู้จัดการกองทุนรวม

นาย ยืนยง เทพจางค์ ตั้งแต่ 19/01/60

ดัชนีชี้วัด

ดัชนีผลตอบแทนรวมตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET TRI)

คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวม มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต : ได้รับการรับรองจาก CAC

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

www.ktam.co.th

ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือบริหาร

ความเสี่ยงด้านสภาพคล่องได้ในหนังสือชี้

ชวนฉบับเต็ม

| การซื้อหน่วยลงทุน | การขายคืนหน่วยลงทุน |
|------------------------------------|---|
| วันทำการซื้อ : ทุกวันทำการ | วันทำการขายคืน : ทุกวันทำการ |
| เวลาทำการ : 08.30-15.30 น. | เวลาทำการ : 08.30-15.30 น. |
| การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ : 500 บาท | การขายคืนขั้นต่ำ : ไม่กำหนด |
| การซื้อครั้งถัดไปขั้นต่ำ : 500 บาท | ยอดคงเหลือขั้นต่ำ : ไม่กำหนด |
| | ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน : T+3 คือ 3 วันทำการหลังจากวันทำการขายคืน |

หมายเหตุ : การลงทุนในกองทุนรวมหุ้นระยะยาว ตั้งแต่วันที่ 1 มกราคม 2563 เป็นต้นไป จะไม่ได้รับสิทธิประโยชน์ทางภาษี

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)

| ค่าธรรมเนียม | สูงสุดไม่เกิน | เก็บจริง |
|---------------|---------------|----------|
| การจัดการ | 2.1400 | 1.6050 |
| รวมค่าใช้จ่าย | 3.7450 | 1.7620 |

หมายเหตุ : * เป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะ หรือภาษีอื่นใดในทำนองเดียวกัน

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)

| ค่าธรรมเนียม | สูงสุดไม่เกิน | เก็บจริง |
|-----------------------------|---------------------|---------------------|
| การขาย | 3.000 | ยังไม่เรียกเก็บ |
| การรับซื้อคืน | 3.000 | ยังไม่เรียกเก็บ |
| การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า | 3.000 | ยังไม่เรียกเก็บ |
| การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก | 3.000 | ยังไม่เรียกเก็บ |
| การโอนหน่วย | ดูหมายเหตุเพิ่มเติม | ดูหมายเหตุเพิ่มเติม |

หมายเหตุ : * ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว ** ค่าธรรมเนียมการโอนหน่วยลงทุน ตามที่นายทะเบียนเรียกเก็บ

ข้อมูลเชิงสถิติ

| | |
|----------------------------|-----------|
| Maximum Drawdown | N/A |
| Recovering Period | N/A |
| FX Hedging | N/A |
| อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน | 0.91 เท่า |
| Sharpe Ratio | N/A |
| Alpha | N/A |
| Beta | N/A |

การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม

| กลุ่มอุตสาหกรรม | % NAV |
|----------------------------|-------|
| บริการ | 28.09 |
| ทรัพยากร | 18.94 |
| เทคโนโลยี | 16.62 |
| ธุรกิจการเงิน | 13.52 |
| อสังหาริมทรัพย์และก่อสร้าง | 7.69 |

หมายเหตุ :

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน

| ทรัพย์สิน | % NAV |
|--------------------------|-------|
| หุ้นสามัญ | 91.46 |
| เงินฝากธนาคาร | 7.95 |
| สินทรัพย์และหนี้สินอื่นๆ | 0.59 |

หมายเหตุ :

ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก

| ทรัพย์สิน | % NAV |
|--|-------|
| บมจ. กัลป์ เอ็นเนอร์จี้ ดีเวลลอปเม้นท์ | 5.77 |
| บมจ. ปตท. | 5.65 |
| บมจ. แอดวานซ์ อินโฟร์ เซอร์วิส | 5.56 |
| บมจ. เดลต้า อิเลคโทรนิคส์ (ประเทศไทย) | 5.50 |
| บมจ. ท่าอากาศยานไทย | 5.26 |

หมายเหตุ :

คำอธิบาย

Maximum Drawdown เปรอ์เซ็นต์ผลขาดทุนสูงสุดของกองทุนรวมในระยะเวลา 5 ปีย้อนหลัง (หรือตั้งแต่จัดตั้งกองทุนกรณีที่ยังไม่ครบ 5 ปี) โดยวัดจากระดับ NAV ต่อหน่วยที่จุดสูงสุด ไปจนถึงจุดต่ำสุดในช่วงที่ NAV ต่อหน่วยปรับตัวลดลงค่า Maximum Drawdown เป็นข้อมูลที่ช่วยให้ทราบถึงความเสี่ยงที่อาจขาดทุนจากการลงทุนในกองทุนรวม

Recovering Period ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาตั้งแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้เวลานานเท่าใด

FX Hedging เปรอ์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตลงทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลานึง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์กับ ผลรวมของมูลค่าการขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 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 สูงกว่าจะเป็นกองทุนที่มีประสิทธิภาพในการบริหารจัดการลงทุนที่ดีกว่า เนื่องจากได้รับผลตอบแทนส่วนเพิ่มที่สูงกว่าภายใต้ระดับความเสี่ยงเดียวกัน

Alpha ผลตอบแทนส่วนเกินของกองทุนรวมเมื่อเปรียบเทียบกับดัชนีชี้วัด (benchmark) โดยค่า Alpha ที่สูง หมายถึง กองทุนสามารถสร้างผลตอบแทนได้สูงกว่าดัชนีชี้วัด ซึ่งเป็นผลจากประสิทธิภาพของผู้จัดการกองทุนในการคัดเลือกหรือหาจังหวะเข้าลงทุนในหลักทรัพย์ได้อย่างเหมาะสม

Beta ระดับและทิศทางการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุน โดยเปรียบเทียบกับอัตราการเปลี่ยนแปลงของตลาด Beta น้อยกว่า 1 แสดงว่า หลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนน้อยกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด Beta มากกว่า 1 แสดงว่า หลักทรัพย์ ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนมากกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด

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

Yield to Maturity อัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในตราสารหนี้โดยถือจนครบกำหนดอายุ ซึ่งคำนวณจากดอกเบี้ยที่ได้รับในอนาคตตลอดอายุตราสารและเงินต้นที่จะได้รับคืน นำมาคิดลดเป็นมูลค่าปัจจุบัน โดยใช้วัดอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมตราสารหนี้ คำนวณจากค่าเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักของ Yield to Maturity ของตราสารหนี้แต่ละตัวที่กองทุนมีการลงทุน และเนื่องจาก Yield to Maturity มีหน่วยมาตรฐานเป็นเปอร์เซ็นต์ต่อปีจึงสามารถนำไปใช้เปรียบเทียบอัตราผลตอบแทนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีนโยบายถือครอง ตราสารหนี้จนครบกำหนดอายุและมีลักษณะการลงทุนที่ใกล้เคียงกันได้

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงไทย จำกัด (มหาชน)

โทรศัพท์ 0-2686-6100 แฟกซ์ 0-2670-0430 www.ktam.co.th

เลขที่ 1 อาคารเอ็มไพร์ทาวเวอร์ ชั้น 32 ถนนสาทรใต้ แขวงยานนาวา เขตสาทร กรุงเทพมหานคร 10120

กองทุนเปิดกรุงไทยหุ้นระยะยาว

The Krung Thai Long -Term Equity Fund

KTLF-L

ชนิด LTF

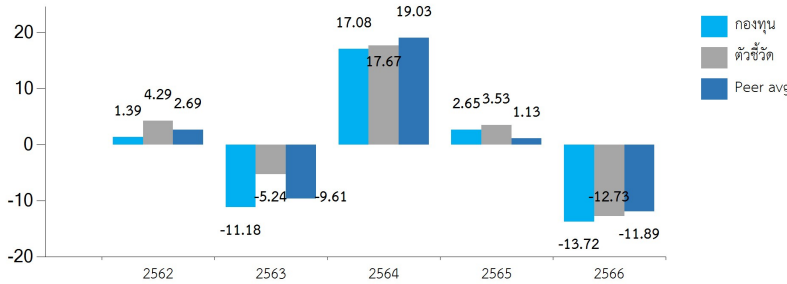
ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมตราสารทุน
- กองทุนรวมหุ้นระยะยาว (Long Term Equity Fund : LTF)
- กองทุนที่ลงทุนแบบไม่มีความเสี่ยงต่างประเทศ
- กลุ่ม Equity General

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- ลงทุนในหุ้นสามัญที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ ที่มีปัจจัยพื้นฐานดี และ/หรือตราสารทุนซึ่งผลตอบแทนของตราสารดังกล่าวอ้างอิงกับผลตอบแทนของหุ้นหรือกลุ่มหุ้นของบริษัทจดทะเบียน แต่ไม่รวมการลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ที่มีสินค้าอ้างอิงเป็นหุ้น/ดัชนีหุ้นของบริษัทจดทะเบียน โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่า 65% ของ NAV
- กองทุนมุ่งหวังให้ผลประกอบการสูงกว่าดัชนีชี้วัด (active management)

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (%ต่อปี)



ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด

| | YTD | 3 เดือน | 6 เดือน | 1 ปี* | 3 ปี* | 5 ปี* | 10 ปี* | ตั้งแต่จัดตั้ง* |
|--------------------------|-------|---------|---------|--------|-------|-------|--------|-----------------|
| กองทุน | -5.85 | -3.80 | -5.85 | -10.25 | -4.19 | -4.34 | 0.24 | 5.63 |
| ดัชนีชี้วัด | -6.07 | -4.53 | -6.07 | -10.60 | -3.58 | -2.62 | 1.78 | 7.52 |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน | -6.39 | -4.67 | -6.39 | -10.13 | -4.17 | -3.51 | 0.54 | |
| ความผันผวนกองทุน | 9.54 | 9.77 | 9.54 | 10.08 | 10.50 | 16.02 | 14.14 | 18.23 |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด | 10.14 | 10.38 | 10.14 | 10.95 | 11.13 | 16.76 | 14.41 | 18.35 |

หมายเหตุ : * % ต่อปี

ระดับความเสี่ยง

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

เสี่ยงสูง

กองทุน LTF ที่มี net exposure ในตราสารทุนโดยเฉลี่ยรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่า 65% ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน 15/11/47

วันเริ่มต้น class 15/11/47

นโยบายการจ่ายเงินปันผล มี

อายุกองทุน ไม่กำหนดอายุโครงการ

ผู้จัดการกองทุนรวม

นาย ยืนยง เทพจางค์ ตั้งแต่ 19/01/60

ดัชนีชี้วัด

ดัชนีผลตอบแทนรวมตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET TRI)

คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวม มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต : ได้รับการรับรองจาก CAC

จัดอันดับกองทุน



Morningstar® Sustainability Rating™



ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือบริหาร

ความเสี่ยงด้านสภาพคล่องได้ในหนังสือชี้

ชวนฉบับเต็ม

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม


www.ktam.co.th

| การซื้อหน่วยลงทุน | การขายคืนหน่วยลงทุน |
|---|---|
| วันทำการซื้อ : บริษัทจัดการจะไม่เปิดเสนอขายหน่วยลงทุนชนิดนี้ตั้งแต่วันที่ 1 มกราคม 2563 เป็นต้นไป | วันทำการขายคืน : ทุกวันทำการ |
| เวลาทำการ : 08.30 - 15.30 น. | เวลาทำการ : 08.30-15.30 น. |
| การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ : 500 บาท | การขายคืนขั้นต่ำ : ไม่กำหนด |
| การซื้อครั้งถัดไปขั้นต่ำ : 500 บาท | ยอดคงเหลือขั้นต่ำ : ไม่กำหนด |
| | ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน : T+3 คือ 3 วันทำการหลังจากวันทำการขายคืน |

หมายเหตุ : การลงทุนในกองทุนรวมหุ้นระยะยาว ตั้งแต่วันที่ 1 มกราคม 2563 เป็นต้นไป จะไม่ได้รับสิทธิประโยชน์ทางภาษี

| ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV) | | |
|---|---------------|----------|
| ค่าธรรมเนียม | สูงสุดไม่เกิน | เก็บจริง |
| การจัดการ | 1.6050 | 1.6050 |
| รวมค่าใช้จ่าย | 3.7450 | 1.7620 |

หมายเหตุ : * เป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะ หรือภาษีอื่นใดในทำนองเดียวกัน ** รวมค่าใช้จ่าย (เก็บจริง) เป็นของรอบปีบัญชีที่ผ่านมา

| ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย) | | |
|---|---------------------|---------------------|
| ค่าธรรมเนียม | สูงสุดไม่เกิน | เก็บจริง |
| การขาย | 0.250 | ยังไม่เรียกเก็บ |
| การรับซื้อคืน | 0.250 | ยังไม่เรียกเก็บ |
| การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า | ดูหมายเหตุเพิ่มเติม | ยังไม่เรียกเก็บ |
| การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก | ดูหมายเหตุเพิ่มเติม | ดูหมายเหตุเพิ่มเติม |
| การโอนหน่วย | ดูหมายเหตุเพิ่มเติม | ดูหมายเหตุเพิ่มเติม |

หมายเหตุ : * ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว ** ค่าธรรมเนียมการสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า เรียกเก็บสูงสุดไม่เกิน 200 บาทต่อรายการ (ปัจจุบันยังไม่เรียกเก็บ) *** ค่าธรรมเนียมการสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก เรียกเก็บสูงสุดไม่เกิน 200 บาทต่อรายการ (ปัจจุบันยังไม่เรียกเก็บ เว้นแต่กรณีสับเปลี่ยนออกไปยัง บลจ.อื่น เรียกเก็บ 200 บาทต่อรายการ) **** ค่าธรรมเนียมการโอนหน่วยลงทุน ตามที่นายทะเบียนเรียกเก็บ อย่างไรก็ตาม ผู้ถือหน่วยลงทุนชนิด LTF ไม่สามารถนำหน่วยลงทุนไปจำหน่าย จ่ายโอน จำนำ หรือนำไปเป็นประกันได้

| ข้อมูลเชิงสถิติ | |
|----------------------------|-----------|
| Maximum Drawdown | -37.22 % |
| Recovering Period | N/A |
| FX Hedging | N/A |
| อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน | 0.91 เท่า |
| Sharpe Ratio | -0.49 |
| Alpha | -0.61 |
| Beta | 0.92 |

| การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม | |
|------------------------------------|-------|
| กลุ่มอุตสาหกรรม | % NAV |
| บริการ | 28.09 |
| ทรัพยากร | 18.94 |
| เทคโนโลยี | 16.62 |
| ธุรกิจการเงิน | 13.52 |
| อสังหาริมทรัพย์และก่อสร้าง | 7.69 |

หมายเหตุ :

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน

| ทรัพย์สิน | % NAV |
|--------------------------|-------|
| หุ้นสามัญ | 91.46 |
| เงินฝากธนาคาร | 7.95 |
| สินทรัพย์และหนี้สินอื่นๆ | 0.59 |

หมายเหตุ :

ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก

| ทรัพย์สิน | % NAV |
|---------------------------------------|-------|
| บมจ. กัลฟ์ เอ็นเนอร์จี ดีเวลลอปเม้นท์ | 5.77 |
| บมจ. ปตท. | 5.65 |
| บมจ. แอดวานซ์ อินโฟร์ เซอร์วิส | 5.56 |
| บมจ. เดลต้า อิเลคโทรนิคส์ (ประเทศไทย) | 5.50 |
| บมจ. ท่าอากาศยานไทย | 5.26 |

หมายเหตุ :

คำอธิบาย

Maximum Drawdown เปรอ์เซ็นต์ผลขาดทุนสูงสุดของกองทุนรวมในระยะเวลา 5 ปีย้อนหลัง (หรือตั้งแต่จัดตั้งกองทุนกรณีที่ยังไม่ครบ 5 ปี) โดยวัดจากระดับ NAV ต่อหน่วยที่จุดสูงสุด ไปจนถึงจุดต่ำสุดในช่วงที่ NAV ต่อหน่วยปรับตัวลดลงค่า Maximum Drawdownเป็นข้อมูลที่ช่วยให้ทราบถึงความเสี่ยงที่อาจขาดทุนจากการลงทุนในกองทุนรวม

Recovering Period ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาดังแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลานานเท่าใด

FX Hedging เปรอ์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลาหนึ่ง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์กับ ผลรวมของมูลค่าการขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 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 สูงกว่าจะเป็นกองทุนที่มีประสิทธิภาพในการบริหารจัดการลงทุนที่ดีกว่า เนื่องจากได้รับผลตอบแทนส่วนเพิ่มที่สูงกว่าภายใต้ระดับความเสี่ยงเดียวกัน

Alpha ผลตอบแทนส่วนเกินของกองทุนรวมเมื่อเปรียบเทียบกับดัชนีชี้วัด (benchmark) โดยค่า Alpha ที่สูง หมายถึง กองทุนสามารถสร้างผลตอบแทนได้สูงกว่าดัชนีชี้วัด ซึ่งเป็นผลจากประสิทธิภาพของผู้จัดการกองทุนในการคัดเลือกหรือหาจังหวะเข้าลงทุนในหลักทรัพย์ได้อย่างเหมาะสม

Beta ระดับและทิศทางการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุน โดยเปรียบเทียบกับอัตราการเปลี่ยนแปลงของตลาด Beta น้อยกว่า 1 แสดงว่า หลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนน้อยกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด Beta มากกว่า 1 แสดงว่า หลักทรัพย์ ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนมากกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด

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 มีหน่วยมาตรฐานเป็นเปอร์เซ็นต์ต่อปีจึงสามารถนำไปใช้เปรียบเทียบอัตราผลตอบแทนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีนโยบายถือครอง ตราสารหนี้จนครบกำหนดอายุและมีลักษณะการลงทุนที่ใกล้เคียงกันได้

ข้อมูล Morningstar Rating ณ วันที่ 30/06/2567

ข้อมูล Morningstar Sustainability Rating ณ วันที่ 31/05/2567

© สงวนลิขสิทธิ์ 2566 บริษัท มอร์นิ่งสตาร์ รีเสิร์ช ประเทศไทย ข้อมูลนี้ (1) เป็นกรรมสิทธิ์ของบริษัทมอร์นิ่งสตาร์ และ/หรือ ผู้ให้บริการข้อมูล (2) ขอสงวนสิทธิ์ในการลอกเลียน หรือเผยแพร่ (3) ขอสงวนสิทธิ์ที่จะไม่รับผิดชอบต่อความถูกต้อง ครบถ้วน และความเสียหายต่างๆ ที่เกิดขึ้นทุกกรณีจากการนำข้อมูลไปใช้อ้างอิง, ผลการดำเนินงานในอดีตมิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต.

คะแนนในส่วนของ Corporate Sustainability Score, Sovereign Sustainability Score และสโตร์การลงทุนเป็นข้อมูล ณ วันที่ 31/05/2567

มอร์นิ่งสตาร์ได้มีการนำข้อมูลความยั่งยืนของบริษัทหรือประเทศที่วิเคราะห์โดย Sustainalytics มาใช้ในการคำนวณ Sustainability Score

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงไทย จำกัด (มหาชน)

โทรศัพท์ 0-2686-6100 แฟกซ์ 0-2670-0430 www.ktam.co.th

เลขที่ 1 อาคารเอ็มไพร์ทาวเวอร์ ชั้น 32 ถนนสาทรใต้ แขวงยานนาวา เขตสาทร กรุงเทพมหานคร 10120