

กองทุนเปิดกรุงไทย SET50 เพื่อการเลี้ยงชีพ

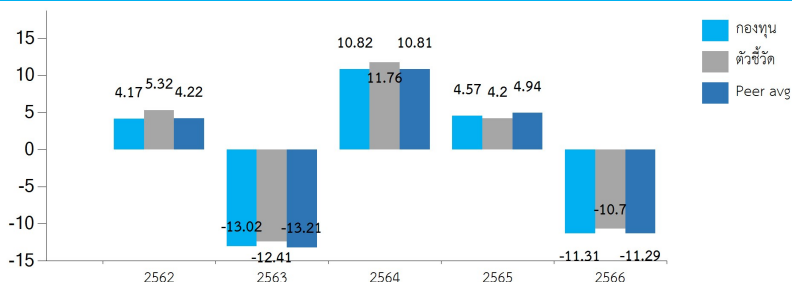
Krung Thai SET50 RMF

KTSET50RMF
ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมตราสารทุน, กองทุนรวมดัชนี, กองทุนรวมเพื่อการเลี้ยงชีพ
- กลุ่ม SET 50 Index Fund

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- เน้นลงทุนในหลักทรัพย์ที่เป็นส่วนประกอบของดัชนีราคา SET50 ซึ่งรวมถึงหลักทรัพย์ที่อยู่ระหว่างการเข้าหรือออกจากกรเป็นส่วนประกอบของดัชนีราคา SET50 ด้วย โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของ NAV เพื่อสร้างอัตราผลตอบแทนก่อนหักค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายให้ใกล้เคียงกับอัตราผลตอบแทนของดัชนีผลตอบแทนรวม SET50 (Index Tracking) อย่างไรก็ดี ในขณะใดขณะหนึ่งกองทุนอาจไม่ได้ลงทุนในหุ้นซึ่งประกอบเป็นดัชนีราคา SET50 ครบทั้ง 50 หุ้น
- ในสภาวะปกติ กองทุนจะพยายามดำรงค่าความผันผวนของผลตอบแทนของกองทุน (หลังหักค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่าย) เมื่อเทียบกับอัตราผลตอบแทนของดัชนีผลตอบแทนรวม SET50 (tracking error) ไม่เกินร้อยละ 1.50 ต่อปี
- มุ่งหวังให้ผลประโยชน์เคลื่อนไหวตามดัชนีชี้วัด (passive management/index tracking)

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (%ต่อปี)

ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด

	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี*	3 ปี*	5 ปี*	10 ปี*	ตั้งแต่จัดตั้ง*
กองทุน	-4.77	-2.74	-13.17	-14.41	-0.89	-3.25		0.11
ดัชนีชี้วัด	-4.71	-2.56	-12.86	-13.84	-0.51	-2.71		1.10
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	-4.75	-2.71	-13.07	-14.29	-0.77	-3.29		
ความผันผวนกองทุน	11.68	11.56	12.32	12.72	12.08	18.54		16.56
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	11.73	11.60	12.37	12.80	12.16	18.72		16.76

หมายเหตุ : * % ต่อปี

ระดับความเสี่ยง


เสี่ยงสูง

กองทุนรวมตราสารทุนที่มี net exposure ในตราสารทุนเป็นหลักโดยเฉลี่ยรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม
วันจดทะเบียนกองทุน 22/12/59

วันเริ่มต้น class N/A

นโยบายการจ่ายเงินปันผล ไม่มี

อายุกองทุน ไม่กำหนดอายุโครงการ

ผู้จัดการกองทุนรวม
นาย ชนิต คงพัฒนศิริ ตั้งแต่ 05/10/61

น.ส. ชัชชนก ศรีปราโมช ตั้งแต่ 02/11/63

ดัชนีชี้วัด

ดัชนีผลตอบแทนรวม SET 50 (SET50 TRI) สัดส่วน 100%

คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวม มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต : ได้รับการรับรองจาก CAC

จัดอันดับกองทุน



Morningstar® Sustainability Rating™



ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือบริหาร

ความเสี่ยงด้านสภาพคล่องได้ในหนังสือชี้

ชวนฉบับเต็ม

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม


www.ktam.co.th

การซื้อขายหน่วยลงทุน	การขายคืนหน่วยลงทุน
วันทำการซื้อ : ทุกวันทำการ	วันทำการขายคืน : ทุกวันทำการ
เวลาทำการ : 8:30 - 15:30	เวลาทำการ : 8:30 - 15:30
การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ : 500 บาท	การขายคืนขั้นต่ำ : ไม่กำหนด
การซื้อครั้งถัดไปขั้นต่ำ : 500 บาท	ยอดคงเหลือขั้นต่ำ : ไม่กำหนด
	ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน : T+3 คือ 3 วันทำการหลังจากวันทำรายการขายคืน

หมายเหตุ :

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)		
ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	2.1400	0.5300
รวมค่าใช้จ่าย	3.7450	0.8000

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

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)		
ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การขาย	3.00	ยังไม่เรียกเก็บ
การรับซื้อคืน	3.00	ยังไม่เรียกเก็บ
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า	3.00	ยังไม่เรียกเก็บ
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก	ดูหมายเหตุเพิ่มเติม	ดูหมายเหตุเพิ่มเติม
การโอนหน่วย	ไม่มี	ไม่มี

หมายเหตุ : *ค่าธรรมเนียมข้างต้นเป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะ หรือภาษีอื่นใดในตนเองเดียวกัน ** กรณีสับเปลี่ยนออกไปยังกองทุนภายใต้การบริหารของบริษัทจัดการ เรียกเก็บสูงสุดไม่เกิน 3.00 (ปัจจุบันยังไม่เรียกเก็บ), กรณีสับเปลี่ยนออกไปยังกองทุนรวมเพื่อการเลี้ยงชีพ ของ บลจ.อื่นจะเรียกเก็บด้วยวิธีการใดวิธีการหนึ่ง ดังต่อไปนี้ ในอัตราไม่เกิน 3.00 ของมูลค่าหน่วยลงทุนของวันทำการก่อนหน้าวันทำการซื้อขายหน่วยลงทุน ขั้นต่ำ 200 บาท หรือ 200 บาทต่อรายการ (ปัจจุบันเรียกเก็บ 200 บาทต่อรายการ)

ข้อมูลเชิงสถิติ	
Maximum Drawdown	-40.20 %
Recovering Period	N/A
FX Hedging	N/A
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน	0.07 เท่า
Sharpe Ratio	-0.09
Alpha	-0.38
Beta	N/A
Tracking Error	0.11 %

การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม	
กลุ่มอุตสาหกรรม	% NAV
ทรัพยากร	26.00
บริการ	24.89
เทคโนโลยี	18.70
ธุรกิจการเงิน	15.19
อสังหาริมทรัพย์และก่อสร้าง	7.93

หมายเหตุ :

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน

ทรัพย์สิน	% NAV
หุ้นสามัญ	99.59
เงินฝากธนาคาร	0.47
สินทรัพย์และหนี้สินอื่นๆ	-0.06

หมายเหตุ :

ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก

ทรัพย์สิน	% NAV
บมจ. เติลต้า อิเลคโทรนิคส์ (ประเทศไทย)	8.62
บมจ. ปตท.	8.46
บมจ. ท่าอากาศยานไทย	7.49
บมจ. แอดวานซ์ อินโฟร์ เซอร์วิส	5.71
บมจ. ปตท.สำรวจและผลิตปิโตรเลียม	5.23

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 ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตลงทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลาหนึ่ง 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

ข้อมูล Morningstar Rating ณ วันที่ 31/01/2567

ข้อมูล Morningstar Sustainability Rating ณ วันที่ 31/12/2566

© 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 31/12/2566

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