

กองทุนเปิดเคแอม Nasdaq Equity Premium Income

KTAM Nasdaq Equity Premium Income Fund

KT-JEPQ

ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมตราสารทุน, กองทุนรวมฟีดเดอร์ (Feeder Fund)
- กองทุนรวมที่เน้นลงทุนแบบมีความเสี่ยงต่างประเทศ
- กลุ่ม US Equity

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- กองทุนมีนโยบายเน้นลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุน JPMorgan ETFs (Ireland) ICAV - Nasdaq Equity Premium Income Active UCITS ETF (กองทุนหลัก) ในสกุลเงินดอลลาร์สหรัฐ โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของ NAV โดยกองทุนหลักจัดตั้งและจดทะเบียนภายใต้กฎหมายประเทศไอร์แลนด์ อยู่ภายใต้การกำกับดูแลของ Central Bank of Ireland ทั้งนี้ กองทุนหลักมีวัตถุประสงค์เพื่อสร้างรายได้ และการเติบโตของเงินทุนในระยะยาว โดยใช้กลยุทธ์การลงทุนแบบเชิงรุก ผ่านการลงทุนในตราสารทุนของบริษัทที่มีมูลค่าเพิ่ม หรือดำเนินกิจกรรมทางเศรษฐกิจส่วนใหญ่อยู่ในประเทศสหรัฐอเมริกาเป็นหลัก และสร้างรายได้เพิ่มเติมจากการขายสัญญาสิทธิซื้อหลักทรัพย์ (Equity Call Options) และ/หรือสัญญาสิทธิซื้อดัชนีหลักทรัพย์ (Equity Index Call Options) เพื่อรับค่าเบี้ยประกันออปชั่น (Option Premium) และสร้างกระแสรายได้เพิ่มเติมให้แก่กองทุนหลัก
- บลจ.ที่บริหารจัดการกองทุนหลัก : JPMorgan Asset Management (Europe) S.a r.l.
- กองทุนจะไม่ลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเพื่อการลดความเสี่ยง (Hedging) และเพื่อเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน
- กองทุนไทยมุ่งหวังให้ผลประโยชน์จากการเคลื่อนไหวตามกองทุนหลัก ส่วนกองทุนหลักมุ่งหวังให้ผลประโยชน์จากการสูงกว่าดัชนีชี้วัด (active management)

ระดับความเสี่ยง

ต่ำ 1 2 3 4 5 6 7 8 สูง

เสี่ยงสูง

ความเสี่ยงของกองทุน ระดับ 6 หมายถึง กองทุนรวมตราสารทุน ที่มี net exposure ในตราสารทุนเป็นหลัก โดยเฉลี่ยรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน 09/09/69 (ประมาณการ)

วันเริ่มต้น class N/A

นโยบายการจ่ายเงินปันผล ไม่มี

อายุกองทุน ไม่กำหนดอายุโครงการ

การป้องกันความเสี่ยงด้าน FX ไม่ป้องกัน

การเรียกเก็บค่าธรรมเนียมตามผลการดำเนินงาน ไม่มี

ผู้จัดการกองทุนรวม

นาย พิรพงศ์ กิจจาการ ตั้งแต่ 09/09/69

น.ส. วรกมล ลีวานิชย์ ตั้งแต่ 09/09/69

ดัชนีชี้วัด

ผลการดำเนินงานของกองทุนรวมหลัก ในสกุลเงินดอลลาร์สหรัฐ ปรับด้วยอัตราแลกเปลี่ยนเพื่อเทียบค่าสกุลเงินบาท ณ วันที่คำนวณผลตอบแทน

คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวม มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านฟองสบู่ : ได้รับการรับรองจาก CAC

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือบริหาร

ความเสี่ยงด้านสภาพคล่องได้ในหนังสือชี้

ชวนฉบับเต็ม

www.ktam.co.th

การซื้อขายหน่วยลงทุน	การขายคืนหน่วยลงทุน
วันทำการซื้อ : IPO ระหว่างวันที่ 1-8 กันยายน 2569 ในระหว่างเวลาเริ่มเปิดทำการ – 15.30 น. ภายหลัง IPO เปิดเสนอขายตั้งแต่วันที่ 10 กันยายน 2569 เป็นต้นไป หากกรณีวันดังกล่าวตรงกับวันหยุดให้เลื่อนเป็นวันทำการซื้อขายถัดไป โดยผู้ถือหน่วยลงทุนสามารถทำการสั่งซื้อหน่วยลงทุนได้ที่บริษัทจัดการหรือผู้สนับสนุนการขายหรือรับซื้อคืน (ถ้ามี) ได้ทุกวันทำการซื้อขายหน่วยลงทุน	วันทำการขายคืน : กรณีแบบดุลยพินิจ: เปิดรับคำสั่งขายคืนหน่วยลงทุนตั้งแต่วันที่ 10 กันยายน 2569 เป็นต้นไป โดยผู้ถือหน่วยลงทุนสามารถสั่งขายคืนได้ทุกวันทำการผ่านบริษัทจัดการหรือผู้สนับสนุนการขายหรือรับซื้อคืน (ถ้ามี) กรณีแบบอัตโนมัติ: รับซื้อคืนหน่วยลงทุนอัตโนมัติปีละไม่เกิน 12 ครั้ง ตามอัตราที่บริษัทจัดการเห็นสมควร และชำระเงินค่ารับซื้อคืนให้แก่ผู้ถือหน่วยลงทุนตามวิธีการที่ผู้ถือหน่วยลงทุนระบุไว้ในใบคำขอเปิดบัญชีผู้ถือหน่วยลงทุน
เวลาทำการ : 08.30 - 15.30 น.	เวลาทำการ : 08.30 - 15.30 น.
การซื้อขายครั้งแรกขั้นต่ำ : 1 บาท	การขายคืนขั้นต่ำ : ไม่กำหนด
การซื้อขายครั้งถัดไปขั้นต่ำ : 1 บาท	ยอดคงเหลือขั้นต่ำ : ไม่กำหนด
	ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน : T+3 คือ 3 วันทำการหลังจากวันทำรายการขายคืน

หมายเหตุ : ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืนจะไม่เกิน 5 วันทำการนับจากวันคำนวณ NAV โดยมีให้นับรวมวันหยุดทำการในต่างประเทศ

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)

ค่าธรรมเนียมต่อไปนี้จะส่งผลกระทบต่อผู้ลงทุน เนื่องจากจะทำให้ผลตอบแทนจากการลงทุนลดลง ดังนั้น ผู้ลงทุนควรตรวจสอบทุกครั้งก่อนตัดสินใจลงทุน

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	2.1400	0.8025

ค่าตอบแทนแก่ตัวแทนขายหน่วยลงทุน
ของกองทุนรวม (trailer fee) : มี

รวมค่าใช้จ่าย	5.3500	0.9416
---------------	--------	--------

หมายเหตุ : * เป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะ หรือภาษีอื่นใดในทำนองเดียวกัน ** ค่าตอบแทนที่ได้รับจากบริษัทจัดการต่างประเทศ (Rebate fee) คือ 0.00% (ในกรณีที่กองทุนหลักคืนเงินค่าธรรมเนียมการจัดการบางส่วนเพื่อเป็นค่าตอบแทนเนื่องจากการที่กองทุนนำเงินไปลงทุนในกองทุนรวมต่างประเทศ (rebate) บริษัทจัดการจะดำเนินการให้เงินจำนวนดังกล่าวตกเป็นทรัพย์สินของกองทุน)

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย) ผู้ลงทุนจะถูกเรียกเก็บค่าธรรมเนียมต่อไปนี้อย่างตรงทุกครั้งที่เมื่อทำรายการซื้อขายหรือสับเปลี่ยนหน่วยลงทุน

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การขาย	3.210	ดูหมายเหตุเพิ่มเติม
การรับซื้อคืน	3.210	ยังไม่เรียกเก็บ
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า	3.210	ดูหมายเหตุเพิ่มเติม
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก	3.210	ยังไม่เรียกเก็บ
การโอนหน่วย	ดูหมายเหตุเพิ่มเติม	ดูหมายเหตุเพิ่มเติม

หมายเหตุ : * ค่าธรรมเนียมข้างต้นเป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะ หรือภาษีอื่นใดในทำนองเดียวกัน ** ค่าธรรมเนียมการโอนหน่วยลงทุน ตามที่นายทะเบียนเรียกเก็บ *** ค่าธรรมเนียมการขายและ/หรือสับเปลี่ยนเข้า ช่วง IPO: ยังไม่เรียกเก็บ / หลัง IPO เรียกเก็บ: 0.321 **** ค่าธรรมเนียมซื้อขายหลักทรัพย์ สูงสุดไม่เกิน 0.535% (ปัจจุบันยังไม่เรียกเก็บ)

ข้อมูลเชิงสถิติ	
Maximum Drawdown	N/A
Recovering Period	N/A
FX Hedging	N/A
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน	N/A
Sharpe Ratio	N/A
Alpha	N/A
Beta	N/A

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน		ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก	
ทรัพย์สิน	% NAV	ทรัพย์สิน	% NAV
หน่วยลงทุนของกองทุนรวมตราสารทุน	80.00	หน่วยลงทุน JPMorgan ETFs (Ireland) ICAV - Nasdaq Equity Premium Income Active UCITS ETF	80.00
อื่นๆ	20.00	อื่นๆ	20.00
หมายเหตุ : ข้อมูลดังกล่าวข้างต้นเป็นเพียงการประมาณการเท่านั้น ซึ่งเปลี่ยนแปลงได้ตามการลงทุนจริง		หมายเหตุ : ข้อมูลดังกล่าวข้างต้นเป็นเพียงการประมาณการเท่านั้น ซึ่งเปลี่ยนแปลงได้ตามการลงทุนจริง	

การลงทุนในกองทุนอื่นเกินกว่า 20% (กองในประเทศ และหรือกองต่างประเทศ)

ชื่อกองทุน : JPMorgan ETFs (Ireland) ICAV - Nasdaq Equity Premium Income Active UCITS ETF ISIN code : IE000U9J8HX9

Bloomberg code : JEPQ LN

ข้อมูลอื่นๆ

ข้อมูลการลงทุนของกองทุน : JPMorgan ETFs (Ireland) ICAV - Nasdaq Equity Premium Income Active UCITS ETF (กองทุนหลัก)

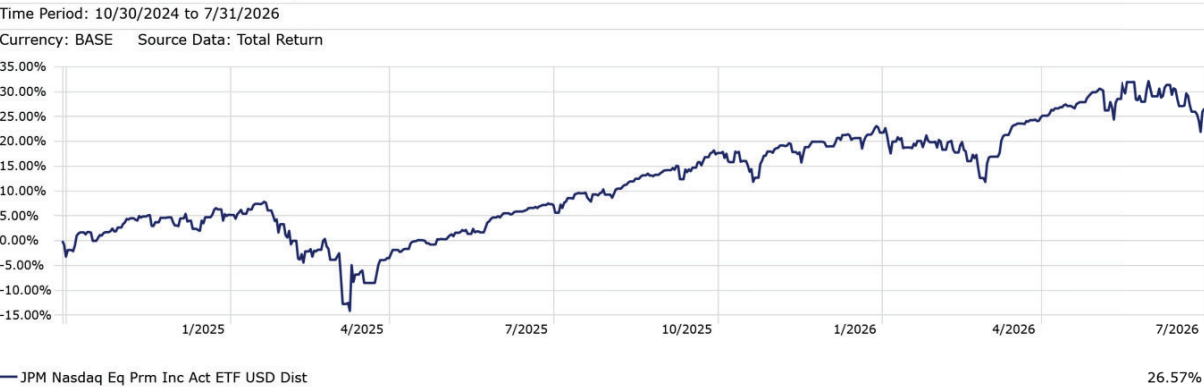
Holdings

Top 10	% of assets
Nvidia	7.9
Apple	6.8
Micron Technology	6.6
Alphabet	5.9
Microsoft	4.6
Advanced Micro Devices	4.5
Amazon.com	4.3
Lam Research	3.4
Tesla	2.8
Meta Platforms	2.8

หมายเหตุ : ข้อมูลจาก factsheet กองทุนหลัก ณ วันที่ 30 มิถุนายน 2569

ผลการดำเนินงานย้อนหลังของกองทุนหลัก

ผลตอบแทนย้อนหลังตั้งแต่จัดตั้งกองทุน



ผลตอบแทนย้อนหลังรายปี

Data Point: Return	YTD	2025	2024	2023	2022	2021
JPM Nasdaq Eq Prm Inc Act ETF USD Dist	6.39	15.40	—	—	—	—

ผลตอบแทนย้อนหลัง (*ผลตอบแทนย้อนหลัง 3 ปี และ 5 ปี เป็นผลตอบแทนโดยเฉลี่ยต่อปี)

Data Point: Return	YTD	3 Months	6 Months	1 Year	3 Years*	5 Years*
JPM Nasdaq Eq Prm Inc Act ETF USD Dist	6.39	1.44	3.96	18.07	—	—

Source: Morningstar Direct

หมายเหตุ : ข้อมูลจาก Morningstar Direct ณ วันที่ 31 กรกฎาคม 2569

- ผลการดำเนินงานในอดีต มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

ข้อจำกัดความรับผิดชอบ

เอกสารส่งเสริมการขายฉบับนี้จัดทำและเผยแพร่โดย บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทย จำกัด (มหาชน) ("KTAM") ซึ่งเกี่ยวข้องกับ กองทุนเปิดเคแอม Nasdaq Equity Premium Income (KT-JEPQ) และเนื้อหาในเอกสารฉบับนี้ได้รับการตรวจสอบความถูกต้องโดย KTAM แล้ว

เอกสารส่งเสริมการขายฉบับนี้ไม่ได้จัดทำ ออก หรือเผยแพร่โดย J.P. Morgan Asset Management ("JPMAM"), บริษัทในเครือของ JPMAM หรือ JPMorgan Nasdaq Equity Premium Income ETF ("JPM ETF") และไม่ได้มีวัตถุประสงค์เกี่ยวกับการลงทุนโดยตรงใน JPM ETF

JPMAM บริษัทในเครือของ JPMAM และ JPM ETF ไม่ได้ตรวจสอบหรือพิจารณาเนื้อหาในเอกสารส่งเสริมการขายฉบับนี้ และดังนั้นบุคคลหรือหน่วยงานดังกล่าวจึงไม่รับผิดชอบต่อความถูกต้อง ความครบถ้วนของข้อมูล หรือความรับผิดชอบใด ๆ อันเกิดจากข้อความ การแสดงข้อมูล การให้ข้อมูลที่คลาดเคลื่อน หรือการละเว้นข้อมูลใด ๆ ที่ปรากฏอยู่ในเอกสารฉบับนี้

การลงทุนในกองทุนเปิดเคแอม Nasdaq Equity Premium Income (KT-JEPQ) เป็นการลงทุนในกองทุนที่จัดตั้ง เสนอขาย และบริหารจัดการโดย KTAM และ/หรือบริษัทในเครือ โดยผู้ลงทุนมิได้ลงทุนโดยตรงใน JPM ETF ดังนั้น ผู้ลงทุนจึงไม่มีความสัมพันธ์ตามสัญญา กับ JPMAM บริษัทในเครือของ JPMAM หรือ JPM ETF อันเนื่องมาจากการลงทุนดังกล่าว

“JEPQ” เป็นชื่อย่อหลักทรัพย์ (Ticker) ของกองทุน JPMorgan Nasdaq Equity Premium Income ETF (ซึ่งเป็นหลักทรัพย์ที่กองทุนเปิดเคแอม Nasdaq Equity Premium Income ลงทุน) และคำว่า “J.P. Morgan” และ “JPMorgan” เป็นเครื่องหมายการค้าจดทะเบียนของ J.P. Morgan Chase Bank, N.A. ("JPMC") ซึ่งบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทย จำกัด (มหาชน) ได้รับอนุญาตให้ใช้งานได้ กองทุนเปิดเคแอม Nasdaq Equity Premium Income มิได้รับการสนับสนุน รับรอง หรือส่งเสริมโดย JPMC และ JPMC มิได้ให้การรับรองหรือแสดงความเห็นใด ๆ เกี่ยวกับความเหมาะสมในการลงทุนในกองทุนเปิดเคแอม Nasdaq Equity Premium Income

ข้อจำกัดความรับผิดชอบ

ผลิตภัณฑ์นี้ไม่ได้รับการสนับสนุน รับรอง ขาย หรือส่งเสริมโดย Nasdaq, Inc. หรือบริษัทในเครือ (เรียกรวมกันว่า "บริษัท") และบริษัท ไม่ได้มีการพิจารณาถึงความถูกต้องตามกฎหมาย หรือความเหมาะสมของผลิตภัณฑ์ หรือความถูกต้องหรือความเพียงพอของคำอธิบาย และการเปิดเผยข้อมูลที่เกี่ยวข้องกับผลิตภัณฑ์ บริษัท ไม่ได้เป็นตัวแทนหรือไม่ได้เป็นผู้รับประกัน ไม่ว่าจะโดยชัดแจ้งหรือโดยนัย ต่อเจ้าของผลิตภัณฑ์หรือกลุ่มบุคคลสาธารณะใด ๆ เกี่ยวกับความเหมาะสมในการลงทุนในหลักทรัพย์โดยทั่วไป หรือในผลิตภัณฑ์โดยเฉพาะ หรือความสามารถของดัชนี Nasdaq-100 Index® ในการติดตามผลการดำเนินงานของตลาดหุ้นโดยทั่วไป ความสัมพันธ์เพียงอย่างเดียวของบริษัท กับบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงไทย จำกัด (มหาชน) ("ผู้ได้รับอนุญาต") คือการอนุญาตให้ใช้เครื่องหมายการค้า Nasdaq® และชื่อทางการค้าบางอย่างของบริษัท และการใช้ดัชนี Nasdaq-100 Index® ซึ่งถูกกำหนด รวบรวม และคำนวณโดย Nasdaq โดยไม่คำนึงถึงผู้ได้รับอนุญาตหรือผลิตภัณฑ์ Nasdaq, Inc. ไม่มีข้อผูกพันในการพิจารณาความต้องการของผู้ได้รับอนุญาต หรือเจ้าของผลิตภัณฑ์ ในการกำหนด รวบรวม หรือคำนวณดัชนี Nasdaq-100 Index® และบริษัท ไม่รับผิดชอบและไม่มีส่วนร่วมในการกำหนดเวลา ราคา หรือปริมาณของผลิตภัณฑ์ที่จะออก หรือในการกำหนดหรือคำนวณสมการที่ผลิตภัณฑ์จะถูกแปลงเป็นเงินสด บริษัท ไม่มีความรับผิดชอบเกี่ยวกับการบริหาร การตลาด หรือการซื้อขายผลิตภัณฑ์

บริษัท ไม่ได้รับประกันความถูกต้องและ/หรือการคำนวณดัชนี Nasdaq-100 Index® ที่ต่อเนื่องหรือข้อมูลใด ๆ ที่ถูกรวมอยู่ บริษัท ไม่มีการรับประกัน ไม่ว่าจะโดยชัดแจ้งหรือโดยนัย เกี่ยวกับผลลัพธ์ที่จะได้รับจากผู้ได้รับอนุญาต เจ้าของผลิตภัณฑ์ หรือบุคคลหรือหน่วยงานอื่นใด จากการใช้ดัชนี Nasdaq-100 Index® หรือข้อมูลใด ๆ ที่ถูกรวมอยู่ บริษัท ไม่มีการรับประกัน ไม่ว่าจะโดยชัดแจ้งหรือโดยนัย และปฏิเสธการรับประกันทั้งหมดเกี่ยวกับการใช้ประโยชน์ตามวิสัยของการใช้งานทั่วไปใด ๆ หรือความเหมาะสมในการใช้งานสำหรับวัตถุประสงค์อย่างใดเป็นการเฉพาะเกี่ยวกับดัชนี Nasdaq-100 Index® หรือข้อมูลใด ๆ ที่ถูกรวมอยู่ ทั้งนี้ นอกเหนือจากสิ่งที่ได้ระบุไว้ข้างต้น บริษัท จะไม่รับผิดชอบต่อความสูญเสียหรือขาดทุน หรือความเสียหายพิเศษ ความเสียหายโดยบังเอิญ ความเสียหายเชิงลงโทษ ความเสียหายทางอ้อม หรือความเสียหายต่อเนื่อง ถึงแม้ว่าจะได้รับการแจ้งเตือนเกี่ยวกับความเป็นไปได้ของความเสียหายดังกล่าวแล้วก็ตาม

Nasdaq®, Nasdaq-100 Index®, Nasdaq-100® และ NDX® เป็นเครื่องหมายการค้าจดทะเบียนของ Nasdaq, Inc. (เรียกรวมกันกับบริษัทในเครือว่า "บริษัท") และได้รับอนุญาตให้ใช้โดยบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงไทย จำกัด (มหาชน) ("ผู้ได้รับอนุญาต") โดยผลิตภัณฑ์นี้ บริษัท ไม่ได้ตรวจสอบเกี่ยวกับความถูกต้องตามกฎหมายหรือความเหมาะสม และผลิตภัณฑ์นี้ไม่ได้ออก รับรอง ขาย หรือส่งเสริมโดยบริษัท และบริษัท ไม่มีการรับประกันและไม่มีความรับผิดชอบเกี่ยวกับผลิตภัณฑ์นี้

คำอธิบาย

Maximum Drawdown เพอร์เซ็นต์ผลขาดทุนสูงสุดของกองทุนรวมในระยะเวลา 5 ปีย้อนหลัง (หรือตั้งแต่จัดตั้งกองทุนกรณีที่ยังไม่ครบ 5 ปี) โดยวัดจากระดับ NAV ต่อหน่วยที่จุดสูงสุด ไปจนถึงจุดต่ำสุดในช่วงที่ NAV ต่อหน่วยปรับตัวลดลงค่า Maximum Drawdownเป็นข้อมูลที่ช่วยให้ทราบถึงความเสี่ยงที่อาจจะขาดทุนจากการลงทุนในกองทุนรวม

Recovering Period ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาดังแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลานานเท่าใด

FX Hedging เพอร์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตกองทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลาหนึ่ง 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

ข้อจำกัดความรับผิดชอบ

* บริษัทจัดการมีการเก็บรวบรวมข้อมูล จากแหล่งข้อมูลที่มีการเผยแพร่ข้อมูลแบบเป็นการทั่วไป และได้รับข้อมูลดังกล่าวมาจาก Morningstar ที่มีการเก็บข้อมูลมาจากกองทุนรวมหลัก โดยข้อมูลที่ปรากฏในเอกสารนี้นำมาจากแหล่งข้อมูลของบริษัทเห็นว่ามีความน่าเชื่อถือ แต่ไม่อยู่ในวิสัยที่จะสามารถตรวจสอบความถูกต้องได้โดยอิสระ บริษัทจัดการไม่สามารถให้การรับประกันความถูกต้องหรือสมบูรณ์ของข้อมูลดังกล่าว และไม่อาจรับผิดชอบในความผิดพลาดในการแสดงข้อเท็จจริงรวมทั้งไม่สามารถรับผิดชอบต่อความเสียหายอันอาจเกิดขึ้นจากการใช้ข้อมูลนี้ของผู้หนึ่งผู้ใด

ผู้ลงทุนไม่ควรตัดสินใจลงทุนโดยอาศัยเอกสารนี้เพียงอย่างเดียว ผู้ลงทุนควรศึกษารายละเอียดในหนังสือชี้ชวนส่วนข้อมูลกองทุนรวม และปัจจัยความเสี่ยงต่างๆ ของกองทุนควบคู่กันไปด้วย