

กองทุนเปิดแคแทม Catastrophe Bond ห้ามขายผู้ลงทุนรายย่อย
KTAM Catastrophe Bond Fund Not for Retail Investors

KT-CATBOND-UI

ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมฟิตเตอร์, กองทุนรวมที่มีนโยบายลงทุนในกองทุนรวมอื่นภายใต้ บลจ. เดียวกัน
- กองทุนรวมอื่นๆ (ลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนต่างประเทศ ผ่านการลงทุนในหลักทรัพย์ที่เชื่อมโยงกับประกันภัย (Insurance linked securities))
- กองทุนรวมที่เน้นลงทุนแบบมีความเสี่ยงต่างประเทศ
- กลุ่ม Miscellaneous

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- เน้นลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุน Schroder Investment Fund – Flexible Cat Bond (กองทุนหลัก) ในหน่วยลงทุนชนิด Class IF Accumulation USD เพียงกองเดียว โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV ทั้งนี้ กองทุนหลักเน้นลงทุนในตราสารหนี้ภัยพิบัติทั่วโลก ("Catastrophe bonds หรือ CAT Bonds") ซึ่งเป็นหลักทรัพย์ที่มีมูลค่าเชื่อมโยงกับเหตุการณ์ความเสียหายจากการประกันภัย (หลักทรัพย์ที่เชื่อมโยงกับการประกันภัย (insurance-linked securities)) ที่เกี่ยวข้องกับภัยพิบัติต่างๆ เช่น พายุเฮอริเคนและแผ่นดินไหว รวมถึงอาจลงทุนในหลักทรัพย์ที่เชื่อมโยงกับประกันภัยประเภทอื่น ๆ
- กองทุนอาจลงทุนในกองทุนรวมอื่นซึ่งอยู่ภายใต้การบริหารจัดการของบริษัทจัดการเดียวกัน ได้ไม่เกิน 20% ของ NAV
- กองทุนอาจพิจารณาลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) เพื่อลดความเสี่ยง (Hedging) หรือเพื่อเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน (Efficient Portfolio Management) ทั้งนี้ กองทุนอาจพิจารณาป้องกันความเสี่ยงด้านอัตราแลกเปลี่ยน โดยขึ้นอยู่กับดุลยพินิจของผู้จัดการกองทุน รวมถึงกองทุนอาจกู้ยืมเงินหรือทำธุรกรรมการขายโดยมีสัญญาซื้อคืน (Repo) เพื่อประโยชน์ในการจัดการลงทุนของกองทุน ไม่เกิน 50% ของ NAV
- บลจ. ที่บริหารจัดการกองทุนหลัก : Schroder Investment Management (Europe) S.A.
- กองทุนไทยมุ่งหวังให้ผลประโยชน์จากการเคลื่อนไหวตามกองทุนหลัก ส่วนกองทุนหลักบริหารแบบ active management

ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปึกมุด

	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี*	3 ปี*	5 ปี*	10 ปี*	ตั้งแต่จัดตั้ง
กองทุน								-0.11

ดัชนีชี้วัด

ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน

ความผันผวนกองทุน

ความผันผวนดัชนีชี้วัด

หมายเหตุ : * % ต่อปี

ระดับความเสี่ยง

ต่ำ 1 2 3 4 5 6 7 8 8+ สูง

เสี่ยงสูงมากอย่างมีนัยสำคัญ

เน้นลงทุนในหลักทรัพย์ที่เชื่อมโยงกับประกันภัย (Insurance linked securities) ทั่วโลก

ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน 27/10/68 (ประมาณการ)

วันเริ่มต้น class N/A

นโยบายการจ่ายเงินปันผล ไม่มี

อายุกองทุน ไม่กำหนดอายุโครงการ

ผู้จัดการกองทุนรวม

นาย พีรพงศ์ กิจจาการ ตั้งแต่ 27/10/68

น.ส. วรกมล ลีวานิชย์ ตั้งแต่ 27/10/68

ดัชนีชี้วัด

ไม่มี เนื่องจากกองทุนนี้เป็น Feeder Fund โดยลงทุนทั้งหมดหรือเกือบทั้งหมดในกองทุนหลัก คือ Schroder Investment Fund – Flexible Cat Bond ซึ่งไม่มีดัชนีชี้วัด (Benchmark)

คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวม มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต
- กองทุนเน้นลงทุนในตราสารหนี้ภัยพิบัติ ซึ่งมีลักษณะและความเสี่ยงที่แตกต่างจากตราสารทางการเงินทั่วไป ผู้ลงทุนต้องศึกษาทำความเข้าใจและรับความเสี่ยงจากการลงทุนได้

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต : ได้รับการรับรองจาก CAC

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



www.ktam.co.th

ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือบริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่องได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

การซื้อขายหน่วยลงทุน		ข้อมูลเชิงสถิติ	
วันทำการซื้อ : บลจ.จะกำหนดวันทำการซื้อหน่วยลงทุนไม่เกินเดือนละ 2 ครั้ง โดยผู้ถือหน่วยลงทุนต้องส่งคำสั่งล่วงหน้าตามวันที่บลจ.กำหนด ทั้งนี้ บลจ.จะกำหนดวันรับคำสั่งซื้อหน่วยลงทุนล่วงหน้า และวันทำการซื้อขายหน่วยลงทุน โดยจะแจ้งให้ผู้ลงทุนทราบล่วงหน้าบนเว็บไซต์ของ บลจ.	วันทำการขายคืน : เดือนละ ไม่เกิน 2 ครั้ง ตามที่ บลจ.กำหนด โดยผู้ถือหน่วยลงทุนจะต้องส่งคำสั่งล่วงหน้า อย่างน้อย 9 วันทำการก่อนวันทำการรับซื้อคืนหน่วยลงทุนของกองทุนหรือตามที่ บลจ.กำหนด ซึ่งอาจแตกต่างกันได้ในแต่ละรอบ การรับซื้อคืนหน่วยลงทุน อนึ่ง บลจ.จะกำหนดวันรับคำสั่งขายคืนหน่วยลงทุนล่วงหน้า และวันทำการซื้อขายหน่วยลงทุน โดยแจ้งให้ผู้ลงทุนทราบล่วงหน้าบนเว็บไซต์ของบลจ.	Maximum Drawdown0.00 %	
		Recovering PeriodN/A	
		FX HedgingN/A	
		อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน0.00 เท่า	
เวลาทำการ : 08.30 น.- 15.30 น.	เวลาทำการ : 08.30 น.- 15.30 น.		
การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ : 10,000 บาท	การขายคืนขั้นต่ำ : ไม่กำหนด		
การซื้อครั้งถัดไปขั้นต่ำ : 1 บาท	ยอดคงเหลือขั้นต่ำ : ไม่กำหนด		
		ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน : T+5 คือ 5 วันทำการหลังจากวันทำการขายคืน	

หมายเหตุ : *ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืนข้างต้นมิให้นับรวมวันหยุดทำการในต่างประเทศ

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	2.1400	0.6206
รวมค่าใช้จ่าย	5.3500	0.7597

หมายเหตุ : *เป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะ หรือภาษีอื่นใดในทำนองเดียวกัน **ค่าตอบแทนที่ได้รับจากบริษัทจัดการต่างประเทศ (Rebate fee) = 0.25% (ทั้งนี้ ในกรณีที่กองทุนหลัก คืนเงินค่าธรรมเนียมการจัดการบางส่วนเพื่อเป็นค่าตอบแทนเนื่องจากการที่กองทุนนำเงินไปลงทุนในกองทุนรวมต่างประเทศ (rebate) บลจ.จะดำเนินการให้เงินจำนวนดังกล่าวตกเป็นทรัพย์สินของกองทุน) ***หากกองทุนลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมภายใต้การจัดการเดียวกัน (กองทุนปลายทาง) บลจ.จะไม่เรียกเก็บค่าธรรมเนียมการจัดการซ้ำซ้อนกับกองทุนปลายทาง

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การขาย	3.210	1.500
การรับซื้อคืน	3.210	ยังไม่เรียกเก็บ
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า	3.210	1.500
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก	3.210	ยังไม่เรียกเก็บ
การโอนหน่วย	ดูหมายเหตุเพิ่มเติม	ดูหมายเหตุเพิ่มเติม

หมายเหตุ : *ค่าธรรมเนียมข้างต้นเป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะ หรือภาษีอื่นใดในทำนองเดียวกัน **ค่าธรรมเนียมการโอนหน่วยลงทุน ตามที่นายทะเบียนเรียกเก็บ ***ค่าธรรมเนียมซื้อขายหลักทรัพย์ สูงสุดไม่เกิน 0.535% (ปัจจุบัน ยังไม่เรียกเก็บ) **** หากกองทุนลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมภายใต้การจัดการเดียวกัน (กองทุนปลายทาง) บลจ.จะไม่เรียกเก็บค่าธรรมเนียมการขาย และการรับซื้อคืนหน่วยลงทุนซ้ำซ้อนกับกองทุนปลายทาง

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน		ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก
ทรัพย์สิน	% NAV	หมายเหตุ : กองทุนนี้จัดทะเบียนกองทุน เมื่อวันที่ 27 ตุลาคม 2568 และยังไม่มีหลักทรัพย์สินที่ลงทุน ทำให้ รายงาน top 5 ยังไม่มีข้อมูลหลักทรัพย์สิน
ทรัพย์สินอื่นและหนี้สินอื่น	96.74	
เงินฝาก หรือตราสารหนี้ที่สถาบันการเงินเป็นผู้ออก	3.26	

หมายเหตุ :

การลงทุนในกองทุนอื่นเกินกว่า 20% (กองในประเทศ และหรือกองต่างประเทศ)

ข้อมูลอื่นๆ

สรุปสาระสำคัญของกองทุน Schroder Investment Fund – Flexible Cat Bond (กองทุนหลัก)

ชื่อ	Schroder Investment Fund – Flexible Cat Bond
Class & currency	IF Accumulation USD
Fund launch date	31 มีนาคม 2558
อายุกองทุน	ไม่กำหนด
ประเทศที่จดทะเบียน	ลักเซมเบิร์ก (LUXEMBOURG)
ISIN	LU1196277534
Management Company	Schroder Investment Management (Europe) S.A.
Investment Manager	Schroder Investment Management (Switzerland) AG
Depository and Fund Administrator	J.P. Morgan SE, Luxembourg Branch
วัตถุประสงค์การลงทุน	กองทุนนี้มีเป้าหมายเพื่อสร้างการเติบโตของเงินทุนและรายได้ ผ่านการลงทุนในหลักทรัพย์ที่เชื่อมโยงกับประกันภัย (Insurance linked securities) ทั่วโลกที่สอดคล้องไปตามเกณฑ์ความยั่งยืนของผู้จัดการการลงทุน <u>หมายเหตุ</u> Insurance linked securities คือ เครื่องมือทางการเงินที่ช่วยให้สามารถโอนย้ายความเสี่ยงด้านการประกันภัยจากบริษัทประกันภัย (และรับประกันภัยต่อ) ไปยังนักลงทุนในตลาดทุนได้ โดยแลกกับเบี้ยประกันความเสี่ยง
นโยบายการลงทุน	กองทุนเน้นลงทุนในตราสารหนี้ภัยพิบัติทั่วโลก (Catastrophe bonds หรือ CAT Bonds) ซึ่งเป็นหลักทรัพย์ที่มีมูลค่าเชื่อมโยงกับเหตุการณ์ความเสียหายจากการประกันภัย (หลักทรัพย์ที่เชื่อมโยงกับการประกันภัย (insurance-linked securities)) ที่เกี่ยวข้องกับภัยพิบัติต่างๆ เช่น พายุเฮอริเคนและแผ่นดินไหว กองทุนอาจลงทุนในหลักทรัพย์ที่เชื่อมโยงกับประกันภัยประเภทอื่น ๆ เช่น ความเสี่ยงประกันชีวิต ความเสี่ยงด้านสุขภาพ หรือความเสี่ยงด้านยานยนต์ กองทุนลงทุน: - อย่างน้อยร้อยละ 80 ของสินทรัพย์ของกองทุนในการลงทุนที่เชื่อมโยงกับภัยพิบัติทางธรรมชาติ (natural catastrophe risk) และ/หรือ ความเสี่ยงด้านชีวิต (life risk) ที่มีจุดมุ่งหมายในการลดผลกระทบเชิงลบจากเหตุการณ์ดังกล่าว และช่วยในการฟื้นฟูเศรษฐกิจและสังคมภายหลังจากผลกระทบที่เกิดขึ้นนั้น ซึ่งจะช่วยให้เศรษฐกิจและสังคมมีภูมิคุ้มกันที่ดีขึ้นในระยะข้างหน้า - อย่างน้อยร้อยละ 50 ของสินทรัพย์ของกองทุนในการลงทุนที่เชื่อมโยงกับความเสี่ยงด้านอุตุนิยมวิทยา (meteorological risks) ที่มีจุดมุ่งหมายในการลดผลกระทบเชิงลบจากเหตุการณ์ดังกล่าว และช่วยในการฟื้นฟูเศรษฐกิจและสังคมภายหลังจากผลกระทบที่เกิดขึ้นนั้น ซึ่งจะช่วยให้เศรษฐกิจและสังคมมีภูมิคุ้มกันที่ดีขึ้นในระยะข้างหน้า รวมถึงบรรเทาผลกระทบเชิงลบจากการเปลี่ยนแปลงด้านสภาพภูมิอากาศด้วยเช่นกัน - อย่างน้อยร้อยละ 5 ของสินทรัพย์ของกองทุน ในการลงทุนที่ออกแบบมาเพื่อแก้ไขปัญหาความขาดแคลนของสัญญาประกันภัยราคาที่เหมาะสมเพื่อคุ้มครองภัยพิบัติทางธรรมชาติ (หรือที่เรียกว่า protection gap)

	กองทุนจะไม่ลงทุนในหลักทรัพย์ที่เชื่อมโยงกับการขายผลประโยชน์จากกรมธรรม์ประกันชีวิต (Life settlement) กองทุนจะไม่ลงทุนในหน่วย CIS เกินร้อยละ 10 ของสินทรัพย์ของกองทุน กองทุนมุ่งเน้นในการรักษาคะแนนด้านความยั่งยืนในระดับบวก โดยคำนวณตามระบบการให้คะแนนของผู้จัดการกองทุน กองทุนจะไม่ลงทุนโดยตรงในกลุ่มสินทรัพย์ กิจกรรม อุตสาหกรรมหรือ กลุ่มผู้ออกหลักทรัพย์บางประเภท ที่มีความเสี่ยงที่เกินกว่าข้อกำหนดที่ระบุไว้ในหัวข้อ “Sustainability-Related Disclosure” ในเว็บไซต์ของกองทุนหลัก กองทุนลงทุนในตราสารที่ออกโดยผู้ออกตราสารที่มีแนวปฏิบัติด้านธรรมาภิบาลที่ดี ที่ถูกกำหนดโดยหลักเกณฑ์การให้คะแนนของผู้จัดการกองทุน (โปรดดูหนังสือชี้ชวนของกองทุนหลักเพิ่มเติมสำหรับรายละเอียด) ผู้จัดการกองทุนหลักอาจเข้าไปมีส่วนร่วมกับผู้ออกตราสารหรือผู้สนับสนุนการทำธุรกรรมที่กองทุนถือครองอยู่ เพื่อตั้งคำถามต่อประเด็นด้านความยั่งยืนที่ยังเป็นจุดอ่อน โดยรายละเอียดเพิ่มเติมสำหรับแนวทางของผู้จัดการกองทุนในด้านความยั่งยืน และการมีส่วนร่วมกับบริษัทนั้น จะถูกระบุอยู่ในเว็บไซต์ของกองทุนหลัก กองทุนอาจใช้เครื่องมือด้านอนุพันธ์ด้านการเงินเพื่อสร้างผลตอบแทนจากการลงทุน เพื่อลดความเสี่ยง หรือเพื่อเพิ่มประสิทธิภาพในการบริหารจัดการกองทุน กองทุนอาจลงทุนในตราสารตลาดเงินและถ้อยเงินสด โดยกองทุนอาจถือครองเงินสดได้สูงสุดถึงร้อยละ 100 ของสินทรัพย์ของกองทุนในบางสถานการณ์และเป็นการชั่วคราวเท่านั้น ซึ่งในสถานการณ์ดังกล่าว กองทุนอาจไม่ปฏิบัติตามข้อกำหนดการลงทุนขั้นต่ำที่ระบุไว้ข้างต้น กองทุนอาจใช้ธุรกรรม total return swap สัญญาการซื้อขายส่วนต่าง (contract for difference) ธุรกรรมการขายโดยมีสัญญาซื้อคืน (repurchase) หรือธุรกรรมการซื้อโดยมีสัญญาขายคืน (Reverse repurchase) การกู้ยืม (Leverage) เป็นวิธีหนึ่งที่กองทุนจะใช้เพื่อเพิ่มการเปิดรับความเสี่ยง โดยทำการกู้ยืมเงินสดหรือหลักทรัพย์ และ/หรือผ่านการใช้ตราสารอนุพันธ์ทางการเงิน โดย Leverage จะแสดงเป็นอัตราส่วน (Leverage ratio) ระหว่างระดับการเปิดรับความเสี่ยงของกองทุนต่อมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน Leverage ratio จะถูกคำนวณให้สอดคล้องไปตาม 2 วิธีการเพื่อสำหรับการคำนวณการเปิดรับความเสี่ยงของกองทุน ได้แก่ gross method และ commitment method โดยมีรายละเอียดดังนี้ <table><tr><th>Leverage ratio</th><th>Leverage ratio สูงสุด</th></tr><tr><td>Gross leverage ratio</td><td>2</td></tr><tr><td>Commitment leverage ratio</td><td>1.3</td></tr></table>	Leverage ratio	Leverage ratio สูงสุด	Gross leverage ratio	2	Commitment leverage ratio	1.3
Leverage ratio	Leverage ratio สูงสุด						
Gross leverage ratio	2						
Commitment leverage ratio	1.3						
การจ่ายเงินปันผล	ไม่จ่ายเงินปันผล						
ดัชนีชี้วัด	ไม่มี						
การสั่งซื้อหน่วยลงทุน	ส่งคำสั่ง 3 วันทำการก่อนวันทำการซื้อขาย						
การขายคืนหน่วยลงทุน	ส่งคำสั่ง 7 วันทำการก่อนวันทำการซื้อขาย						
มูลค่าขั้นต่ำการสั่งซื้อครั้งแรก (Minimum Initial Subscription)	USD 1,000,000						

มูลค่าขั้นต่ำการสั่งซื้อครั้งถัดไป (Minimum Additional Subscription)	USD 500,000
วันทำการซื้อขาย	วันศุกร์ที่สองของเดือน (หรือวันทำการถัดไปหากวันศุกร์ไม่ใช่วันทำการ) และวันทำการสุดท้ายของแต่ละเดือน
วันประกาศมูลค่าสินทรัพย์สุทธิ	วันทำการถัดจากวันศุกร์ของแต่ละสัปดาห์ และในวันทำการแรกของแต่ละเดือน
วันรับเงินค่าขายคืน หน่วยลงทุน	ภายใน 3 วันทำการนับจากวันทำการซื้อขาย
ข้อจำกัดการขายคืนหน่วยลงทุน	ไม่เกินร้อยละ 10 ของมูลค่ารวมของหน่วยลงทุนทั้งหมดในวันทำการซื้อขายนั้น

คำอธิบาย

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

Recovering Period ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาตั้งแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลานานเท่าใด

FX Hedging เพอร์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

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

ข้อความจำกัดความรับผิด

* บริษัทจัดการมีการเก็บรวบรวมข้อมูล จากแหล่งข้อมูลที่มีการเผยแพร่ข้อมูลแบบเป็นการทั่วไป และได้รับข้อมูลดังกล่าวมาจาก Morningstar ที่มีการเก็บข้อมูลมาจากกองทุนรวมหลัก โดยข้อมูลที่ปรากฏในเอกสารนี้ นำมาจากแหล่งข้อมูลของบริษัทเห็นว่ามีความน่าเชื่อถือ แต่ไม่อยู่ในวิสัยที่จะสามารถตรวจสอบความถูกต้องได้โดยอิสระ บริษัทจัดการไม่สามารถให้การรับประกันความถูกต้องหรือสมบูรณ์ของข้อมูลดังกล่าว และไม่อาจรับผิดชอบในความผิดพลาดในการแสดงข้อเท็จจริงรวมทั้งไม่สามารถรับผิดชอบต่อความเสียหายอันอาจเกิดขึ้นจากการใช้ข้อมูลนี้ของผู้หนึ่งผู้ใด

ผู้ลงทุนไม่ควรตัดสินใจลงทุนโดยอาศัยเอกสารนี้เพียงอย่างเดียว ผู้ลงทุนควรศึกษารายละเอียดในหนังสือชี้ชวนส่วนข้อมูลกองทุนรวม และปัจจัยความเสี่ยงต่างๆ ของกองทุนควบคู่กันไปด้วย

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