



กองทุนเปิดกรุงไทย อีควิตี้ พลัส 70/30 ไทยเพื่อความยั่งยืนแบบพิเศษ
Krungthai Equity Plus 70/30 Thailand ESG Extra Fund

KTEQ70PLUSX-D
ชนิดเงินลงทุนใหม่แบบ
ปันผล

ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมผสม,กองทุนรวมไทยเพื่อความยั่งยืนแบบพิเศษ (Thai ESGX)
- กองทุนรวมเพื่อความยั่งยืน (SRI Fund), Cross Investing Fund
- กองทุนที่ลงทุนแบบความเสี่ยงทั้งในและต่างประเทศ
- กลุ่ม Aggressive Allocation

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- ลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินดังต่อไปนี้ โดยมี net exposure โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV (1) หุ้นที่มีความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อม (environment) หรือด้านความยั่งยืน (ESG) และ/หรือหุ้นที่มีการเปิดเผยข้อมูล แผนการจัดการ และการตั้งเป้าหมายเพื่อให้บรรลุเป้าหมายในการลดปริมาณการปล่อยก๊าซเรือนกระจก และ/หรือหุ้นที่มีธรรมาภิบาล (Governance) (2) ตราสารเพื่อการอนุรักษ์สิ่งแวดล้อม (green bond) และ/หรือตราสารเพื่อความยั่งยืน (sustainability bond) และ/หรือตราสารส่งเสริมความยั่งยืน (sustainability-linked bond) ทั้งนี้ กองทุนจะกำหนดกรอบการลงทุนในตราสารทุน โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชี ไม่น้อยกว่า 70% ของ NAV และตราสารหนี้ โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่เกินกว่า 30% ของ NAV
- กองทุนอาจลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมอื่น ซึ่งอยู่ภายใต้การจัดการของบริษัทจัดการ สัดส่วนโดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่เกิน 20% ของ NAV
- กองทุนอาจพิจารณาลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งตราสารที่มีสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแฝง และ/หรือสัญญาซื้อขายล่วงหน้า เพื่อลดความเสี่ยง หรือเพื่อเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน
- กลยุทธ์การลงทุนมุ่งหวังให้ผลประกอบการสูงกว่าดัชนีชี้วัด (active management)
- ผู้ลงทุนสามารถศึกษาข้อมูลด้านความยั่งยืนเพิ่มเติมได้ที่ ข้อมูลอื่นๆ หรือหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด

	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี*	3 ปี*	5 ปี*	10 ปี*	ตั้งแต่ จัดตั้ง
กองทุน		1.96						4.11
ดัชนีชี้วัด		1.86						5.34
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน		3.42						
ความผันผวนกองทุน		11.18						12.60
ความผันผวนดัชนีชี้วัด		9.59						11.71

หมายเหตุ : * % ต่อปี

ระดับความเสี่ยง

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

เสี่ยงปานกลางค่อนข้างสูง

ความเสี่ยงของกองทุน ระดับ 5 หมายถึง กองทุนรวมผสมที่มี net exposure ได้ทั้งในตราสารทุน ตราสารหนี้ และ/หรือทรัพย์สินทางเลือก

ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน 09/05/68

วันเริ่มต้น class 09/05/68

นโยบายการจ่ายเงินปันผล มี

อายุกองทุน ไม่กำหนดอายุโครงการ

ผู้จัดการกองทุนรวม

น.ส. กุลณัฐฐา อภิปรกติชัย ตั้งแต่ 09/05/68

น.ส. อรพรรณ เกียรติพิศาลสกุล ตั้งแต่ 09/05/68

ดัชนีชี้วัด

1. SET ESG Total Return Index (70%)
2. ThaiBMA Government Bond ESG Index Net Total Return (30%)

วัตถุประสงค์ในการอ้างอิงดัชนีชี้วัด เพื่อเปรียบเทียบกับผลการดำเนินงานของกองทุนรวม (Performance Objective)

คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวม มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต : ได้รับการรับรองจาก CAC

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



www.ktam.co.th

ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือบริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่องได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

การซื้อขายหน่วยลงทุน	การขายคืนหน่วยลงทุน
วันทำการซื้อ : ไม่เปิดเสนอขายภายหลังวันที่ 30 มิถุนายน 2568	วันทำการขายคืน : ผู้ถือหน่วยลงทุนสามารถทำการสั่งขายคืนหน่วยลงทุนได้ทุกวันทำการ
เวลาทำการ : 08.30-15.30 น.	เวลาทำการ : 08.30-15.30 น.
การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ : ไม่กำหนด	การขายคืนขั้นต่ำ : ไม่กำหนด
การซื้อครั้งถัดไปขั้นต่ำ : ไม่กำหนด	ยอดคงเหลือขั้นต่ำ : ไม่กำหนด
ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน : T+2 คือ 2 วันทำการหลังจากวันทำรายการขายคืน	

หมายเหตุ : ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืนจะไม่เกิน 5 วันทำการนับตั้งแต่วันที่ถัดจากวันรับซื้อคืนหน่วยลงทุน

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)		
ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	2.1400	1.6050
รวมค่าใช้จ่าย	5.3500	1.7912

หมายเหตุ : * เป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะ หรือภาษีอื่นใดในทำนองเดียวกัน ** หากกองทุนลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมภายใต้การจัดการเดียวกัน (กองทุนปลายทาง) บริษัทจัดการจะไม่เรียกเก็บค่าธรรมเนียมการจัดการซ้ำซ้อนกับกองทุนปลายทาง

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)		
ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การขาย	3.210	ยังไม่เรียกเก็บ
การรับซื้อคืน	3.210	ยังไม่เรียกเก็บ
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า	3.210	ยังไม่เรียกเก็บ
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก	3.210	ดูหมายเหตุเพิ่มเติม
การโอนหน่วย	ไม่มี	ไม่มี

หมายเหตุ : * เป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะ หรือภาษีอื่นใดในทำนองเดียวกัน ** กรณีสับเปลี่ยนออกภายใน บลจ.เรียกเก็บสูงสุดไม่เกิน 3.21% (ปัจจุบันยังไม่เรียกเก็บ), กรณีสับเปลี่ยนออกไปยัง บลจ.อื่น เรียกเก็บสูงสุดไม่เกิน 3.21% ของมูลค่าหน่วยลงทุนของวันทำการก่อนหน้าวันทำการซื้อขายหน่วยลงทุน ขั้นต่ำ 200 บาท หรือ 200 บาทต่อรายการ (ปัจจุบันเรียกเก็บ 1.07% ขั้นต่ำ 200 บาท) *** ค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายที่เกี่ยวข้องกับการซื้อหรือขายหลักทรัพย์สูงสุดไม่เกิน 0.535% (ปัจจุบันยังไม่เรียกเก็บ) **** หากกองทุนลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมภายใต้การจัดการเดียวกัน (กองทุนปลายทาง) บริษัทจะไม่เรียกเก็บค่าธรรมเนียมการขายและ/หรือการรับซื้อคืนหน่วยลงทุนซ้ำซ้อนกับกองทุนปลายทาง

ข้อมูลเชิงสถิติ	
Maximum Drawdown	-8.91 %
Recovering Period	N/A
FX Hedging	N/A
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน	1.57 เท่า

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน		ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก	
ทรัพย์สิน	% NAV	ทรัพย์สิน	% NAV
หุ้นสามัญ	70.75	พันธบัตรรัฐบาลส่งเสริมความยั่งยืน ในปีงบประมาณ พ.ศ. 2568 17/06/2040	15.26
พันธบัตรรัฐบาล	24.77	พันธบัตรรัฐบาล ในปีงบประมาณ พ.ศ. 2568 17/06/2045	9.22
ใบสำคัญแสดงสิทธิในผลประโยชน์ที่เกิดจากหลัก ทรัพย์สินอ้างอิงที่เป็นตราสารแห่งทุน	3.48	หุ้นสามัญ บมจ. แอดวานซ์ อินโฟร์ เซอร์วิส	6.33
เงินฝากธนาคาร	1.79	หุ้นสามัญ บมจ. เอลต้า อิเลคโทรนิคส์ (ประเทศไทย)	6.23
หุ้นกู้	0.45	หุ้นสามัญ บมจ. กัลฟ์ ดีเวลลอปเม้นท์	5.74
สินทรัพย์และหนี้สินอื่นๆ	-1.24	หมายเหตุ :	
หมายเหตุ :			

ข้อมูลอื่นๆ

นโยบายการลงทุนด้านความยั่งยืนเพิ่มเติม

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

ลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินดังต่อไปนี้ โดยมี net exposure โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV

- (1) หุ้นที่เป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนใน SET และ/หรือ mai ซึ่งผ่านกระบวนการวิเคราะห์การลงทุนแบบ ESG Integration โดยจะเน้นลงทุนในบริษัทที่มีความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อม หรือด้านความยั่งยืน (Environmental, Social and Governance: ESG) ที่ผ่านการคัดเลือกและได้รับการประกาศผลประเมินหุ้นยั่งยืน จาก SET และ/หรือหุ้นที่มีการเปิดเผยข้อมูลเกี่ยวกับการปล่อยก๊าซเรือนกระจก แผนการจัดการและการตั้งเป้าหมายเพื่อให้บรรลุเป้าหมายในการลดปริมาณการปล่อยก๊าซเรือนกระจกของประเทศไทย และ/หรือหุ้นของบริษัทจดทะเบียนที่มีธรรมาภิบาล (Governance) ที่มีลักษณะตามประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุนกำหนด
- (2) ตราสารอย่างใดอย่างหนึ่ง หรือหลายอย่าง ดังนี้
 - (2.1) ตราสารเพื่ออนุรักษ์สิ่งแวดล้อม (green bond) ตราสารเพื่อความยั่งยืน (sustainability bond) หรือตราสารส่งเสริมความยั่งยืน (sustainability - linked bond)
 - (2.2) พันธบัตรรัฐบาล พันธบัตรที่กระทรวงการคลังค้ำประกันต้นเงินและดอกเบี้ย หรือหุ้นกู้ที่กระทรวงการคลังค้ำประกันต้นเงินและดอกเบี้ยแต่ไม่รวมถึงหุ้นกู้แปลงสภาพ ซึ่งเป็นพันธบัตรหรือหุ้นกู้เพื่ออนุรักษ์สิ่งแวดล้อม (green bond) พันธบัตรหรือหุ้นกู้เพื่อความยั่งยืน (sustainability bond) หรือพันธบัตรหรือหุ้นกู้ส่งเสริมความยั่งยืน (sustainability - linked bond)

วัตถุประสงค์การลงทุนที่เกี่ยวกับความยั่งยืน

กองทุนจะลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินดังต่อไปนี้ โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน

1. หุ้นที่เป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET) และ/หรือตลาดหลักทรัพย์เอ็ม เอ ไอ (mai) โดยจะเน้นลงทุนใน :
 - 1.1 หุ้นของบริษัทที่มีความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน (Environmental, Social and Governance: ESG) ซึ่งผ่านการวิเคราะห์การลงทุนโดยวิธี Positive Screening ที่ผ่านการคัดเลือกและได้รับการประกาศผลประเมินหุ้นยั่งยืน จากตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย และใช้การวิเคราะห์ภายในของบริษัทจัดการในการวิเคราะห์ ESG Integration เพิ่มเติมอีกชั้นหนึ่ง เพื่อวิเคราะห์ปัจจัยเชิงคุณภาพทั้งในแง่ของความยั่งยืน ความรับผิดชอบต่อสิ่งแวดล้อมและสังคม และ/หรือ
 - 1.2 หุ้นที่มีการเปิดเผยข้อมูลเกี่ยวกับการปล่อยก๊าซเรือนกระจก แผนการจัดการ และการตั้งเป้าหมายเพื่อให้บรรลุเป้าหมายในการลดปริมาณการปล่อยก๊าซเรือนกระจกของประเทศไทย รวมทั้งจัดให้มีการทวนสอบการวัดคาร์บอนฟุตพริ้นท์โดยผู้ทวนสอบที่สำนักงานยอมรับ และ/หรือ
 - 1.3 หุ้นที่มีลักษณะดังนี้
 - 1.3.1 เป็นหุ้นของบริษัทจดทะเบียนที่มีธรรมาภิบาล (Governance) โดยได้รับการประเมินการกำกับดูแลกิจการบริษัทจดทะเบียน (Corporate Governance Report of Thai Listed Companies: CGR) จากสมาคมส่งเสริมสถาบันกรรมการบริษัทไทย ตั้งแต่ 90 คะแนนขึ้นไป หรือเทียบเท่า
 - 1.3.2 มีการเปิดเผยเป้าหมายและแผนในเรื่องดังนี้ และรายงานความคืบหน้า การปฏิบัติตามเป้าหมายหรือแผน ผ่านช่องทางของ ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET) ซึ่งจัดไว้สำหรับการเปิดเผยข้อมูลดังกล่าวโดยเฉพาะ ทั้งนี้ สำนักงานอาจประกาศกำหนดรายละเอียดเพิ่มเติมของข้อมูลในแต่ละหัวข้อด้วยก็ได้
 - 1.3.2.1 การมีเป้าหมายและแผนธุรกิจที่เกี่ยวข้องกับการเพิ่มมูลค่าของกิจการ (corporate value up plan)
 - 1.3.2.2 การมีเป้าหมายและแผนการยกระดับการดำเนินงานในเรื่องใดเรื่องหนึ่ง ดังนี้ โดยต้องตั้งเป้าหมายเพื่อดำเนินการให้เป็นไปตามแผนการยกระดับดังกล่าวให้แล้วเสร็จภายใน 2 ปีนับแต่วันที่เปิดเผยเป้าหมายและแผนการยกระดับ
- (1) แผนดำเนินการที่ชัดเจนเพื่อเข้ารับการประเมินจาก ผู้ประเมินผลการดำเนินงานด้านความยั่งยืนตามมาตรฐานสากลตามประกาศการลงทุนของสำนักงาน ก.ล.ต.
- (2) เป้าหมายและแผนดำเนินการเพื่อลดปริมาณการปล่อยก๊าซเรือนกระจกของประเทศตามประกาศการลงทุนของสำนักงาน ก.ล.ต.
- 1.3.3 มีการเพิ่มประสิทธิภาพการสื่อสารกับผู้ลงทุน ตามที่ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET) กำหนด และรวมถึงลงทุนใน

2. ตราสารอย่างใดอย่างหนึ่ง หรือหลายอย่าง ดังนี้

2.1 พันธบัตรรัฐบาล หรือ 2.2 พันธบัตรที่กระทรวงการคลังค้ำประกันต้นเงินและดอกเบี้ย หรือ 2.3 หุ้นกู้ที่กระทรวงการคลังค้ำประกันต้นเงินและดอกเบี้ยแต่ไม่รวมถึงหุ้นกู้แปลงสภาพ หรือ 2.4 ตราสารหนี้อื่นๆ โดยทั้ง 4 ประเภท ต้องเป็นพันธบัตร/หุ้นกู้/ตราสารเพื่ออนุรักษ์สิ่งแวดล้อม (green Bond) หรือพันธบัตร/หุ้นกู้/ตราสารเพื่อความยั่งยืน (sustainability bond) หรือพันธบัตร/หุ้นกู้/ตราสารเพื่อส่งเสริมความยั่งยืน (sustainability-linked bond) โดยเป็นไปตามหลักเกณฑ์ที่คณะกรรมการกำกับตลาดทุน คณะกรรมการ ก.ล.ด. หรือสำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ด. ประกาศกำหนด

เป้าหมายที่กองทุนรวมต้องการบรรลุ (ถ้ามี)

กองทุนมุ่งเน้นลงทุนในบริษัทที่มีการดำเนินงานด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน (Environmental, Social and Governance: ESG) โดดเด่น เพื่อสร้างผลตอบแทนอย่างยั่งยืนให้กับผู้ลงทุน และเป็นแรงสนับสนุนให้กิจกรรมที่มุ่งเน้นการดำเนินงานที่คำนึงถึงปัจจัยด้าน ESG ให้มากขึ้น ส่งผลให้เศรษฐกิจไทยสามารถเติบโตได้อย่างยั่งยืน และยังเป็นอีกกลไกหนึ่งที่ช่วยสนับสนุนบริษัทจดทะเบียนฯ และประเทศไทยให้บรรลุเป้าหมายการพัฒนาที่ยั่งยืน (Sustainable Development Goals: SDGs) ขององค์การสหประชาชาติ รวมถึงช่วยสนับสนุนบริษัทจดทะเบียนที่มีการบริหารจัดการและดำเนินงานด้าน ESG ที่ดี และยังเป็นการส่งเสริมให้บริษัทอื่นๆ ให้ความสำคัญด้าน ESG มากยิ่งขึ้นหรือพัฒนาปรับปรุงองค์กรทางด้าน ESG เพื่อให้ได้รับ ESG Ratings ที่ดีขึ้น

กรอบการลงทุน (Investment Universe)

กองทุนจะลงทุนในบริษัทจดทะเบียนฯ ที่ได้รับการประกาศผลประเมินหุ้นยั่งยืน SET ESG Ratings ของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย ที่มีความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน (Environmental, Social and Governance: ESG) โดยจะพิจารณาผนวกปัจจัยด้าน ESG ในกระบวนการตัดสินใจลงทุน (ESG Integration) และ/หรือหุ้นของบริษัทจดทะเบียนฯ ที่มีการดำเนินงานเกี่ยวกับการลดการปล่อยก๊าซเรือนกระจก และ/หรือหุ้นของบริษัทจดทะเบียนฯ ที่มีธรรมาภิบาล (Governance) ที่มีลักษณะตามหัวข้อ “วัตถุประสงค์การลงทุนที่เกี่ยวกับความยั่งยืน” ข้อ 1.3 และลงทุนใน (1) พันธบัตรรัฐบาล หรือ (2) พันธบัตรที่กระทรวงการคลังค้ำประกันต้นเงินและดอกเบี้ย หรือ (3) หุ้นกู้ที่กระทรวงการคลังค้ำประกันต้นเงินและดอกเบี้ยแต่ไม่รวมถึงหุ้นกู้แปลงสภาพ หรือ (4) ตราสารหนี้อื่นๆ โดยทั้ง 4 ประเภท ต้องเป็นพันธบัตร/หุ้นกู้/ตราสารที่ผู้ออกตราสารต้องการระดมทุนเพื่อนำเงินไปลงทุนหรือชำระคืนหนี้สินเดิม (Re-financing) ในโครงการที่เกี่ยวข้องกับการ อนุรักษ์สิ่งแวดล้อม (green Bond) หรือเพื่อโครงการที่เกี่ยวข้องกับความยั่งยืนของประเทศไทย (sustainability bond) หรือโครงการเพื่อส่งเสริมความยั่งยืน (sustainability-linked bond) โดยเป็นไปตามหลักเกณฑ์ที่คณะกรรมการกำกับตลาดทุน คณะกรรมการ ก.ล.ด. หรือสำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ด. ประกาศกำหนด และมีอันดับความน่าเชื่อถือของตราสารหรือผู้ออกตราสารอยู่ในอันดับที่สามารถลงทุนได้ (Investment Grade) โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน

การอ้างอิงดัชนีชี้วัดที่เกี่ยวกับความยั่งยืน (investment benchmark)

ดัชนีผลตอบแทนรวม SET ESG Index (SETESG TRI) สัดส่วน 70.00% ซึ่งเป็นดัชนีที่มีองค์ประกอบของบริษัทที่มีผลการประเมิน SET ESG Ratings ปีล่าสุดซึ่งจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ และเป็นหลักทรัพย์ที่มีการซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ไม่น้อยกว่า 6 เดือน และมีมูลค่าหลักทรัพย์ตามราคาตลาดไม่น้อยกว่า 5,000 ล้านบาท และมีสัดส่วนผู้ถือหลักทรัพย์รายย่อย (Free-Float) ไม่น้อยกว่าร้อยละ 20 ของทุนจดทะเบียนชำระแล้ว และมีจำนวนหุ้นซื้อขายไม่น้อยกว่าร้อยละ 0.5 ของจำนวนหุ้นจดทะเบียนของบริษัท เป็นเวลาไม่ต่ำกว่า 9 ใน 12 เดือน โดยผู้ลงทุนสามารถศึกษาวิธีการจัดทำ ESG Ratings ได้จาก <https://setsustainability.com/ESG-ratings> และดัชนี ThaiBMA Government Bond ESG Index Net Total Return สัดส่วน 30% เนื่องจากเป็นดัชนีที่รวมตราสารหนี้ภาครัฐ ESG ที่ขึ้นทะเบียนกับ ThaiBMA

ทั้งนี้ บริษัทจัดการจะเปลี่ยนแปลง Benchmark ของกองทุนตามข้างต้น ที่จัดทำโดยตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เมื่อตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยมีการจัดทำดัชนี TRI ที่นำสัดส่วนผู้ถือหลักทรัพย์รายย่อยของแต่ละหลักทรัพย์ (free float) มาถ่วงน้ำหนักในการคำนวณดัชนี (ดัชนี free float TRI) เพื่อให้เป็นไปตามหลักเกณฑ์ที่คณะกรรมการกำกับตลาดทุนประกาศกำหนด

ทั้งนี้ ผู้ลงทุนสามารถศึกษาข้อมูลด้านความยั่งยืนเพิ่มเติมได้ที่หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

คำอธิบาย

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

Recovering Period ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาดังแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินลงทุนเริ่มต้นใช้เวลานานเท่าใด

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 ระดับและทิศทาง การเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุน 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

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