



กองทุนเปิดกรุงไทย หุ้นปันผล ไทยเพื่อความยั่งยืนแบบพิเศษ
Krungthai Dividend Equity Thailand ESG Extra Fund

KTEQDIVX-L

ชนิดเงินลงทุนเดิมแบบ
ปันผล

ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมตราสารทุน, กองทุนรวมไทยเพื่อความยั่งยืนแบบพิเศษ (Thai ESGX)
- กองทุนรวมเพื่อความยั่งยืน (SRI Fund), Cross Investing Fund
- กองทุนที่ลงทุนแบบไม่มีความเสี่ยงต่างประเทศ
- กลุ่ม Equity General

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- กองทุนมีนโยบายลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งหุ้นที่เป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนใน SET และ/หรือ mai ที่มีปัจจัยพื้นฐาน ผลการดำเนินงานที่ดี มีประวัติการจ่ายเงินปันผลที่ดี สม่าเสมอ และ/หรือ มีศักยภาพในการจ่ายเงินปันผลในอนาคต โดยจะเน้นลงทุนในบริษัทที่มีความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน (Environmental, Social and Governance: ESG) ที่ผ่านการคัดเลือกและได้รับการประกาศผลประเมินหุ้นยั่งยืน จาก SET และผ่านกระบวนการวิเคราะห์การลงทุนแบบ ESG Integration ของบริษัทจัดการ และ/หรือหุ้นที่มีการเปิดเผยข้อมูลเกี่ยวกับการปล่อยก๊าซเรือนกระจก แผนการจัดการและการตั้งเป้าหมายเพื่อให้บรรลุเป้าหมายในการลดปริมาณการปล่อยก๊าซเรือนกระจกของประเทศไทย และ/หรือหุ้นของบริษัทจดทะเบียนที่มีธรรมาภิบาล (Governance) ที่มีลักษณะตามประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุนกำหนด โดยมี net exposure ในหุ้นดังกล่าว โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV
- กองทุนอาจลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมอื่น ซึ่งอยู่ภายใต้การจัดการของบริษัทจัดการ สัดส่วนโดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่เกิน 20% ของ NAV
- กองทุนอาจพิจารณาลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งตราสารที่มีสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแฝง และ/หรือสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเพื่อลดความเสี่ยง หรือเพื่อเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน
- กลยุทธ์การลงทุนมุ่งหวังให้ผลประกอบการสูงกว่าดัชนีชี้วัด (active management)
- ผู้ลงทุนสามารถศึกษาข้อมูลด้านความยั่งยืนเพิ่มเติมได้ที่ ข้อมูลอื่นๆ หรือหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปึกหมุด

	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี*	3 ปี*	5 ปี*	10 ปี*	ตั้งแต่จัดตั้ง
กองทุน		5.58						8.73
ดัชนีชี้วัด		5.47						10.71
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน		3.46						
ความผันผวนกองทุน		11.66						12.74
ความผันผวนดัชนีชี้วัด		11.79						13.24

หมายเหตุ : * % ต่อปี

ระดับความเสี่ยง

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

เสี่ยงสูง

ความเสี่ยงของกองทุน ระดับ 6 หมายถึง กองทุนรวมตราสารทุนที่มี net exposure ในตราสารทุนเป็นหลัก โดยเฉลี่ยรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน 09/05/68

วันเริ่มต้น class 09/05/68

นโยบายการจ่ายเงินปันผล มี

อายุกองทุน ไม่กำหนดอายุโครงการ

ผู้จัดการกองทุนรวม

น.ส. ชัชชนก ศรีปราโมช ตั้งแต่ 09/05/68

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

ดัชนีชี้วัด

SET High Dividend 30 (SETHD TRI)

วัตถุประสงค์ในการอ้างอิงดัชนีชี้วัด : เพื่อเปรียบเทียบกับผลการดำเนินงานของกองทุนรวม (Performance Objective)

คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่อการฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวม มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต : ได้รับการรับรองจาก CAC

Morningstar® Sustainability Rating™



หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



www.ktam.co.th

ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือบริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่องได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

การซื้อหน่วยลงทุน	การขายคืนหน่วยลงทุน
วันทำการซื้อ : บริษัทจัดการจะเปิดให้บริการเฉพาะเป็นการสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนจากกองทุนรวมหุ้นระยะยาวมายังหน่วยลงทุนชนิดนี้เท่านั้น โดยมีระยะเวลาการส่งคำสั่งตามช่วงวันที่เปิดรับคำสั่งสับเปลี่ยน และวันทำการตามที่บริษัทจัดการกำหนด โดยส่งคำสั่งระหว่างวันที่ 13 พ.ค. จนถึงวันที่ 30 มิ.ย. 2568 เท่านั้น ผู้ลงทุนสามารถศึกษาข้อมูลเพิ่มเติมได้ที่หัวข้อ “ข้อมูลอื่นๆ”	วันทำการขายคืน : เปิดรับคำสั่งขายคืนตั้งแต่วันที่ 13 พฤษภาคม 2568 เป็นต้นไป หากกรณีวันดังกล่าวตรงกับวันหยุดให้เลื่อนเป็นวันทำการซื้อขายถัดไป โดยผู้ถือหน่วยลงทุนสามารถทำการส่งขายคืนหน่วยลงทุนได้ทุกวันทำการ

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 วันทำการหลังจากวันทำการขายคืน

หมายเหตุ : ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืนจะไม่เกิน 5 วันทำการนับตั้งแต่วันถัดจากวันรับซื้อคืนหน่วยลงทุน

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)		
ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	2.1400	1.0700
รวมค่าใช้จ่าย	5.3500	1.2562

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), กรณีสับเปลี่ยนออกไปยังบลจ.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	-7.04 %
Recovering Period	N/A
FX Hedging	N/A
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน	0.63 เท่า
Sharpe Ratio	N/A
Alpha	N/A
Beta	N/A

การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม	
กลุ่มอุตสาหกรรม	% NAV
ธุรกิจการเงิน	56.30
ทรัพยากร	23.94
อสังหาริมทรัพย์และก่อสร้าง	8.77
บริการ	5.25
เกษตรและอุตสาหกรรมอาหาร	3.69

หมายเหตุ :

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน		ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก	
ทรัพย์สิน	% NAV	ทรัพย์สิน	% NAV
ตราสารทุน	99.09	หุ้นสามัญ ธนาคารกสิกรไทย	10.95
เงินฝาก หรือตราสารหนี้ที่สถาบันการเงินเป็นผู้ออก	1.01	หุ้นสามัญ ธนาคารกรุงไทย	10.82
ทรัพย์สินอื่นและหนี้สินอื่น	-0.10	หุ้นสามัญ บมจ. เอสซีบี เอกซ์	10.03
หมายเหตุ :		หุ้นสามัญ ธนาคารกรุงเทพ	9.51
		หุ้นสามัญ บมจ. ปตท.สำรวจและผลิตปิโตรเลียม	9.12
		หมายเหตุ :	

ข้อมูลอื่นๆ

การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนจากกองทุนรวมหุ้นระยะยาว (LTF) ภายใต้การจัดการของบริษัท

บริษัทจัดการจะเปิดรับคำสั่งสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า ระหว่างวันที่ 13 พฤษภาคม จนถึงวันที่ 30 มิถุนายน 2568 โดยผู้ถือหน่วยลงทุนสามารถส่งคำสั่งสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนตามช่วงวันที่เปิดรับคำสั่งสับเปลี่ยนหน่วยลงทุน ได้ทุกวันทำการ ในระหว่างเวลาเริ่มเปิดทำการ – 15.30 น. (ยังไม่ถือว่าเป็นวันทำการซื้อขาย หรือวันที่ลงทุน) ทั้งนี้ บริษัทจัดการจะทำรายการสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนดังกล่าว เป็นรายสัปดาห์ โดยกำหนดให้ตรงกับวันทำการสุดท้ายของแต่ละสัปดาห์ และไม่เกินวันที่ 30 มิถุนายน 2568 โดยมีรายละเอียดวันทำการซื้อขายตามตารางด้านล่างนี้

ช่วงวันที่รับคำสั่งสับเปลี่ยนหน่วยลงทุน	วันทำการสับเปลี่ยนหน่วยลงทุน (ทำการสุดท้ายของสัปดาห์) Trade date
วันที่ 13-16 พฤษภาคม 2568	วันที่ 16 พฤษภาคม 2568
วันที่ 19-23 พฤษภาคม 2568	วันที่ 23 พฤษภาคม 2568
วันที่ 26-30 พฤษภาคม 2568	วันที่ 30 พฤษภาคม 2568
วันที่ 2-6 มิถุนายน 2568	วันที่ 6 มิถุนายน 2568
วันที่ 9-13 มิถุนายน 2568	วันที่ 13 มิถุนายน 2568
วันที่ 16-20 มิถุนายน 2568	วันที่ 20 มิถุนายน 2568
วันที่ 23-27 มิถุนายน 2568	วันที่ 27 มิถุนายน 2568
วันที่ 30 มิถุนายน 2568	วันที่ 30 มิถุนายน 2568

ทั้งนี้ หากผู้ถือหน่วยลงทุนส่งคำสั่งหลังจากช่วงวันที่รับคำสั่งสับเปลี่ยนหน่วยลงทุน จะถือว่ารายการดังกล่าวเป็นของวันทำการสับเปลี่ยนของสัปดาห์ถัดไป

อย่างไรก็ตาม บริษัทจัดการขอสงวนสิทธิในการแก้ไข เปลี่ยนแปลง ปรับปรุง หรือเพิ่มความถี่ของช่วงวันที่รับคำสั่งสับเปลี่ยนหน่วยลงทุน และ/หรือวันทำการสับเปลี่ยนหน่วยลงทุน (Trade date) ได้ หากบริษัทจัดการพิจารณาเห็นสมควรแล้วว่าจะเป็นประโยชน์ต่อกองทุนหรือต่อผู้ถือหน่วยลงทุน

นโยบายการลงทุนด้านความยั่งยืนเพิ่มเติม

วัตถุประสงค์การลงทุนที่เกี่ยวกับความยั่งยืน

กองทุนจะลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งหุ้นที่เป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET) และ/หรือตลาดหลักทรัพย์เอ็ม เอ ไอ (mai) โดยจะเน้นลงทุนใน

1. หุ้นของบริษัทที่มีความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน (Environmental, Social and Governance: ESG) ซึ่งผ่านการวิเคราะห์การลงทุนโดยวิธี Positive Screening ที่ผ่านการคัดเลือกและได้รับการประกาศผลประเมินหุ้นยั่งยืน จากตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย และใช้การวิเคราะห์ภายในของบริษัทจัดการในการวิเคราะห์ ESG Integration เพิ่มเติมอีกชั้นหนึ่ง เพื่อวิเคราะห์ปัจจัยเชิงคุณภาพทั้งในแง่ของความยั่งยืน ความรับผิดชอบต่อสิ่งแวดล้อมและสังคม และ/หรือ
2. หุ้นที่มีการเปิดเผยข้อมูลเกี่ยวกับการปล่อยก๊าซเรือนกระจก แผนการจัดการ และการตั้งเป้าหมายเพื่อให้บรรลุเป้าหมายในการลดปริมาณการปล่อยก๊าซเรือนกระจกของประเทศไทย รวมทั้งจัดให้มีการทวนสอบการจัดทำคาร์บอนฟุตพริ้นท์โดยผู้ทวนสอบที่สำนักงานยอมรับ และ/หรือ
3. หุ้นที่มีลักษณะดังนี้
 - 3.1 เป็นหุ้นของบริษัทจดทะเบียนที่มีธรรมาภิบาล (Governance) โดยได้รับการประเมินการกำกับดูแลกิจการบริษัทจดทะเบียน (Corporate Governance Report of Thai Listed Companies: CGR) จากสมาคมส่งเสริมสถาบันกรรมการบริษัทไทย ตั้งแต่ 90 คะแนนขึ้นไป หรือเทียบเท่า
 - 3.2 มีการเปิดเผยเป้าหมายและแผนในเรื่องดังนี้ และรายงานความคืบหน้า การปฏิบัติตามเป้าหมายหรือแผน ผ่านช่องทางของ ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET) ซึ่งจัดไว้สำหรับการเปิดเผยข้อมูลดังกล่าวโดยเฉพาะ ทั้งนี้ สำนักงานอาจประกาศกำหนดรายละเอียดเพิ่มเติมของข้อมูลในแต่ละหัวข้อด้วยก็ได้
 - 3.2.1 การมีเป้าหมายและแผนธุรกิจที่เกี่ยวข้องกับการเพิ่มมูลค่าของกิจการ (corporate value up plan)
 - 3.2.2 การมีเป้าหมายและแผนการยกระดับการดำเนินงานในเรื่องใดเรื่องหนึ่ง ดังนี้ โดยต้องตั้งเป้าหมายเพื่อดำเนินการให้เป็นไปตามแผนการยกระดับดังกล่าวให้แล้วเสร็จภายใน 2 ปีนับแต่วันที่เปิดเผยเป้าหมายและแผนการยกระดับ

- (1) แผนดำเนินการที่ชัดเจนเพื่อเข้ารับการประเมินจาก ผู้ประเมินผลการดำเนินงานด้านความยั่งยืนตามมาตรฐานสากลตามประกาศการลงทุนของสำนักงาน ก.ล.ต.
- (2) เป้าหมายและแผนดำเนินการเพื่อลดปริมาณการปล่อยก๊าซเรือนกระจกของประเทศตามประกาศการลงทุนของสำนักงาน ก.ล.ต.
- 3.3 มีการเพิ่มประสิทธิภาพการสื่อสารกับผู้ลงทุน ตามที่ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET) กำหนด

ทั้งนี้ กองทุนจะลงทุนในหุ้นข้างต้น โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน

นอกจากนี้ หุ้นที่เป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนจะพิจารณาจากปัจจัยพื้นฐาน ผลการดำเนินงานที่ดี มีประวัติการจ่ายเงินปันผลที่ดี สม่ำเสมอ และ/หรือ มีศักยภาพในการจ่ายเงินปันผลในอนาคต โดยรอบการพิจารณาคัดเลือกหลักทรัพย์โดยจะประเมินจากปัจจัยที่เกี่ยวข้อง ดังนี้

- (1) ประวัติและอัตราการจ่ายเงินปันผลในอดีต พิจารณาจากอัตราผลตอบแทนจากปันผล (dividend yield) ความสม่ำเสมอในจ่ายเงินปันผลรวมถึงการเปรียบเทียบกับค่าเฉลี่ยของตลาดฯ และ/หรือ
- (2) แนวโน้มการจ่ายเงินปันผลของบริษัทที่คาดการณ์ในอนาคต พิจารณาจากโครงสร้างการเงิน ศักยภาพการจ่ายเงินปันผล นโยบายการจ่ายเงินปันผลของบริษัท และ/หรือ
- (3) สถานะการเงิน ผลประกอบการ และกระแสเงินสดทั้งในปัจจุบันและอนาคตของบริษัท

เป้าหมายที่กองทุนรวมต้องการบรรลุ (ถ้ามี)

กองทุนมุ่งเน้นลงทุนในบริษัทที่มีการดำเนินงานด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน (Environmental, Social and Governance: ESG) โดดเด่น เพื่อสร้างผลตอบแทนอย่างยั่งยืนให้กับผู้ลงทุน และเป็นแรงสนับสนุนให้บริษัทที่มุ่งเน้นการดำเนินงานที่คำนึงถึงปัจจัยด้าน ESG ให้มากขึ้น ส่งผลให้เศรษฐกิจไทยสามารถเติบโตได้อย่างยั่งยืน และยังเป็นอีกกลไกหนึ่งที่ช่วยสนับสนุนบริษัทจดทะเบียน 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 3. โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน

การอ้างอิงดัชนีชี้วัดที่เกี่ยวกับความยั่งยืน (investment benchmark)

ดัชนีผลตอบแทนรวม SET High Dividend 30 (SETHD TRI) สัดส่วน 100.00% ซึ่งเป็นดัชนีที่มีองค์ประกอบของหลักทรัพย์ที่มีอัตราการจ่ายเงินปันผลสูงสุดจำนวน 30 หลักทรัพย์ ในดัชนี SET100 ซึ่งมีการจ่ายปันผลต่อเนื่อง 3 ปี และมี Dividend payout ratio ไม่เกินร้อยละ 100 และมีการจำกัดน้ำหนักของแต่ละหลักทรัพย์ที่เป็นองค์ประกอบในดัชนีไม่เกินร้อยละ 10 ทุกไตรมาส

ซึ่งผู้ลงทุนสามารถศึกษาวิธีการจัดทำได้จาก <https://www.set.or.th/th/market/index/sethd/profile>

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 เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาดังแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้เวลานานเท่าใด

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 ซึ่งเป็นผลมาจากประสิทธิภาพของผู้จัดการกองทุนในการคัดเลือกหรือหาจังหวะเข้าลงทุนในหลักทรัพย์ได้อย่างเหมาะสม

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 Sustainability Rating ณ วันที่ 30/09/2568

© สงวนลิขสิทธิ์ 2568 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 30/09/2568

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