

## หนังสือชี้ชวนส่วนสรุปข้อมูลสำคัญ



**krungsri**  
Asset Management

เครือ MUFG หนึ่งในสถาบันการเงินที่ใหญ่ที่สุดของโลก

**บลจ.กรุงศรี จำกัด**  
ซึ่งได้รับการรับรองโดย CAC\*

(\*โครงการแนวร่วมปฏิบัติของภาคเอกชนไทยในการต่อต้านการทุจริตของสมาคมส่งเสริมสถาบันกรรมการบริษัทไทย)

กองทุนเปิดกรุงศรี  
ไทยสมอล-มิดแคปอัครวิทย์  
[KFTHAISM]  
กองทุนตราสารทุน

กองทุนรวมที่เน้นลงทุนแบบไม่มีความเสี่ยงในต่างประเทศ



คุณกำลังจะลงทุนอะไร?



กองทุนรวมนี้เหมาะกับใคร?



คุณต้องระวังอะไรเป็นพิเศษ?



สัดส่วนของประเภททรัพย์สินที่ลงทุน



ค่าธรรมเนียม



ผลการดำเนินงานในอดีต



ข้อมูลอื่นๆ

การลงทุนในกองทุนรวม **ไม่ใช่** การฝากเงิน



## คุณกำลังจะลงทุนอะไร?

### • นโยบายการลงทุน

- ลงทุนในตราสารแห่งทุนของบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย และ/หรือตลาดหลักทรัพย์ MAI ที่มีปัจจัยพื้นฐานดี และ/หรือมีแนวโน้มการเจริญเติบโตทางธุรกิจ โดยเน้นลงทุนในตราสารแห่งทุนของบริษัทขนาดกลางและขนาดเล็ก โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV บริษัทขนาดกลางและขนาดเล็กสำหรับกองทุนนี้ ให้หมายถึงบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยซึ่งไม่ได้ประกอบอยู่ในดัชนี SET50 บริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ MAI รวมถึงการจองซื้อหุ้นที่เสนอขายแก่ประชาชนทั่วไปเป็นครั้งแรก (IPO) ณ วันที่กองทุนลงทุน
- ส่วนที่เหลือจะลงทุนในตราสารแห่งทุนนอกเหนือจากที่กล่าวข้างต้น ตราสารแห่งหนี้ ตราสารกึ่งหนี้กึ่งทุน ตราสารทางการเงิน หรือเงินฝาก ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ เป็นต้น

### • กลยุทธ์ในการบริหารจัดการลงทุน

มุ่งหวังให้ผลตอบแทนสูงกว่าดัชนีชี้วัด (Active Management)



## กองทุนรวมนี้เหมาะกับใคร?

- ผู้ลงทุนที่สามารถรับความผันผวนของราคาหุ้นขนาดกลางถึงเล็กที่กองทุนรวมไปลงทุน ซึ่งอาจจะปรับตัวเพิ่มสูงขึ้นหรือลดลงจนต่ำกว่ามูลค่าที่ลงทุนและทำให้ขาดทุนได้
- ผู้ที่สามารถลงทุนในระยะกลางถึงระยะยาว โดยคาดหวังผลตอบแทนในระยะยาวที่ดีกว่าการลงทุนในตราสารหนี้ทั่วไป

## กองทุนรวมนี้ไม่เหมาะกับใคร

ผู้ลงทุนที่เน้นการได้รับผลตอบแทนในจำนวนเงินที่แน่นอน หรือรักษาเงินต้นให้อยู่ครบ



ทำอย่างไรหากยังไม่เข้าใจนโยบาย และความเสี่ยงของกองทุนนี้

- อ่านหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม หรือสอบถามผู้สนับสนุนการขายและบริษัทจัดการ  
อย่าลงทุนหากไม่เข้าใจลักษณะและความเสี่ยงของกองทุนรวมนี้ดีพอ

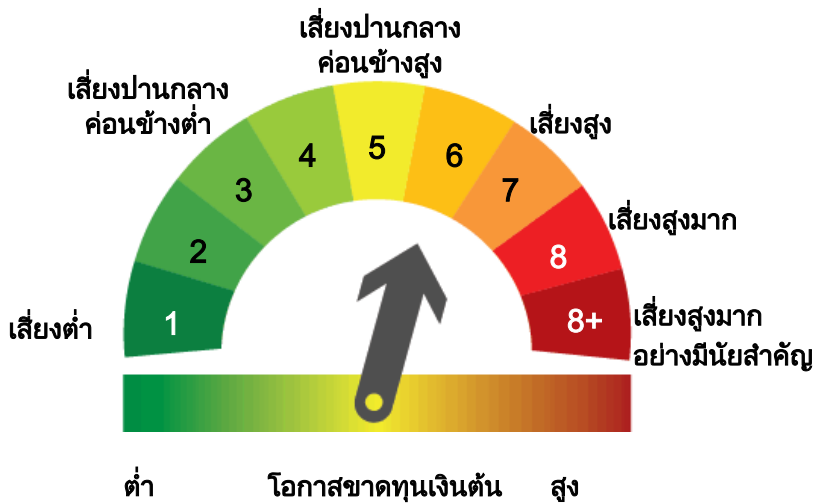


**คุณต้องระวังอะไรเป็นพิเศษ?**

**• ค่าเตือนที่สำคัญ**

- กองทุนลงทุนในหุ้นสามัญของบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ ซึ่งมีความเสี่ยงจากภาวะตลาด (Market risk) จากสถานการณ์ต่างๆ เช่น เศรษฐกิจ การเมืองหรือสังคม ซึ่งส่งผลกระทบต่อภาคธุรกิจจนทำให้ภาวะตลาดเปลี่ยนแปลงไปจนมีผลกระทบต่อราคาหุ้น
- กองทุนนี้มีนโยบายการลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเพื่อประสิทธิภาพในการบริหารการลงทุน จึงอาจมีความเสี่ยงมากกว่ากองทุนรวมที่ลงทุนในหลักทรัพย์อ้างอิงโดยตรง เนื่องจากใช้เงินลงทุนในจำนวนที่น้อยกว่าจึงมีกำไร/ขาดทุนสูงกว่าการลงทุนในหลักทรัพย์อ้างอิงโดยตรง

**แผนภาพแสดงตำแหน่งความเสี่ยงของกองทุนรวม**



**ปัจจัยความเสี่ยงที่สำคัญ**

**1. ความเสี่ยงจากความผันผวนของมูลค่าหน่วยลงทุน (Market Risk)**

	ต่ำ			สูง	
ความผันผวนของผลการดำเนินงาน (SD)	< 5%	5-10%	10 - 15%	15 - 25%	> 25%
กลุ่มหุ้นในประเทศที่ลงทุน	General	Large Cap	Mid/Small	Sector	

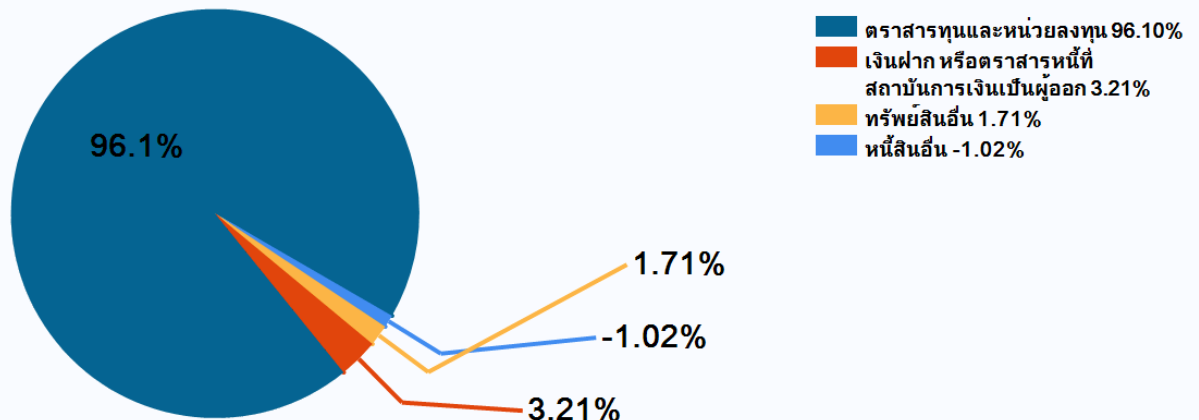
\*ค่า SD แสดงความผันผวนของกองทุนย้อนหลัง 5 ปี (หรือตั้งแต่จัดตั้งกองทุนกรณียังไม่ครบ 5 ปี)

**2. ความเสี่ยงจากการกระจุกตัวลงทุนในผู้ออกรายใดรายหนึ่ง (High issuer concentration risk)**

	ต่ำ			สูง	
การกระจุกตัวลงทุนในผู้ออกตราสาร	≤ 10%	10-20%	20-50%	50-80%	> 80%



## สัดส่วนของประเภททรัพย์สินที่ลงทุน



### 5 หมวดหลักทรัพย์สินที่ลงทุน

หมวดพัฒนาอสังหาริมทรัพย์	21.57
หมวดพาณิชย์	14.44
หมวดขนส่งและโลจิสติกส์	14.43
หมวดธุรกิจบริการรับเหมาก่อสร้าง	10.53
หมวดเงินทุนและหลักทรัพย์	8.26

### ชื่อทรัพย์สินที่ลงทุนสูงสุด 5 อันดับแรก

ชื่อทรัพย์สิน	Security Code	% ของ NAV
บมจ.เอเชีย เอวิเอชั่น	AAV	6.10
บมจ. อาร์เอส	RS	5.43
บมจ.เดอะ แพลทินัม กรุ๊ป	PLAT	4.91
บมจ.เอ็ม บี เค	MBK	4.30
บมจ.บางกอก เซน ฮอสปีทอล	BCH	4.25

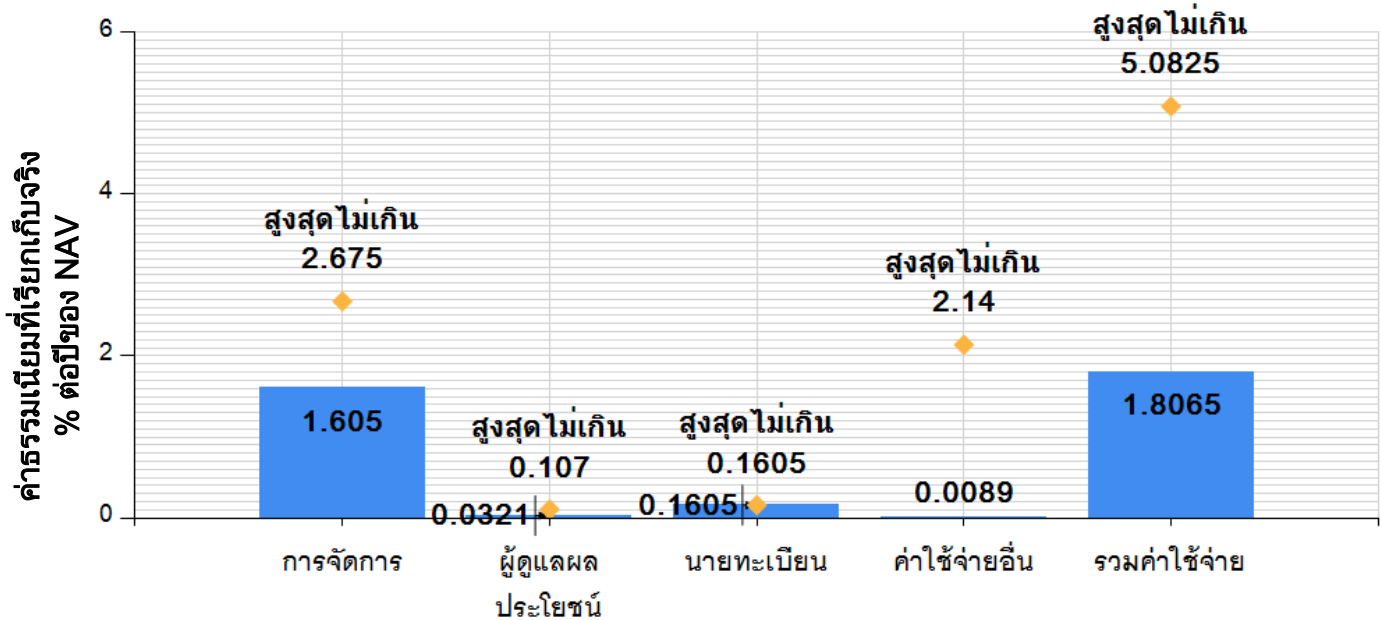


## ค่าธรรมเนียม

**\*ค่าธรรมเนียมมีผลกระทบต่อผลตอบแทนที่คุณจะได้รับ ดังนั้น คุณควรพิจารณาการเรียกเก็บค่าธรรมเนียมดังกล่าวก่อนการลงทุน\***

### ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)

#### ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม



\*คุณสามารถดูข้อมูลค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงจากกองทุนย้อนหลังได้ที่ [www.krungsriasset.com](http://www.krungsriasset.com)

### ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)

รายการ	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
ค่าธรรมเนียมขาย	ไม่เกิน 1.50	1.00
ค่าธรรมเนียมการรับซื้อคืน	ไม่เกิน 1.50	ไม่เรียกเก็บ
ค่าธรรมเนียมสับเปลี่ยนเข้า	ไม่เกิน 1.50	1.00
ค่าธรรมเนียมสับเปลี่ยนออก	ไม่เกิน 1.50	ไม่เรียกเก็บ
ค่าปรับกรณีขายคืนและสับเปลี่ยนออกก่อนระยะเวลาที่กำหนด	ไม่มี	ไม่มี
ค่าธรรมเนียมการโอน	10 บาทต่อ 1,000 หน่วย เศษของ 1,000 หน่วยคิด เป็น 1,000 หน่วย	10 บาทต่อ 1,000 หน่วยเศษของ 1,000 หน่วยคิดเป็น 1,000 หน่วย
ค่าใช้จ่ายในการซื้อขายหลักทรัพย์เมื่อมีการซื้อ ขาย สับเปลี่ยน	ไม่เกิน 0.50	0.20

หมายเหตุ : ค่าธรรมเนียมดังกล่าวเป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว



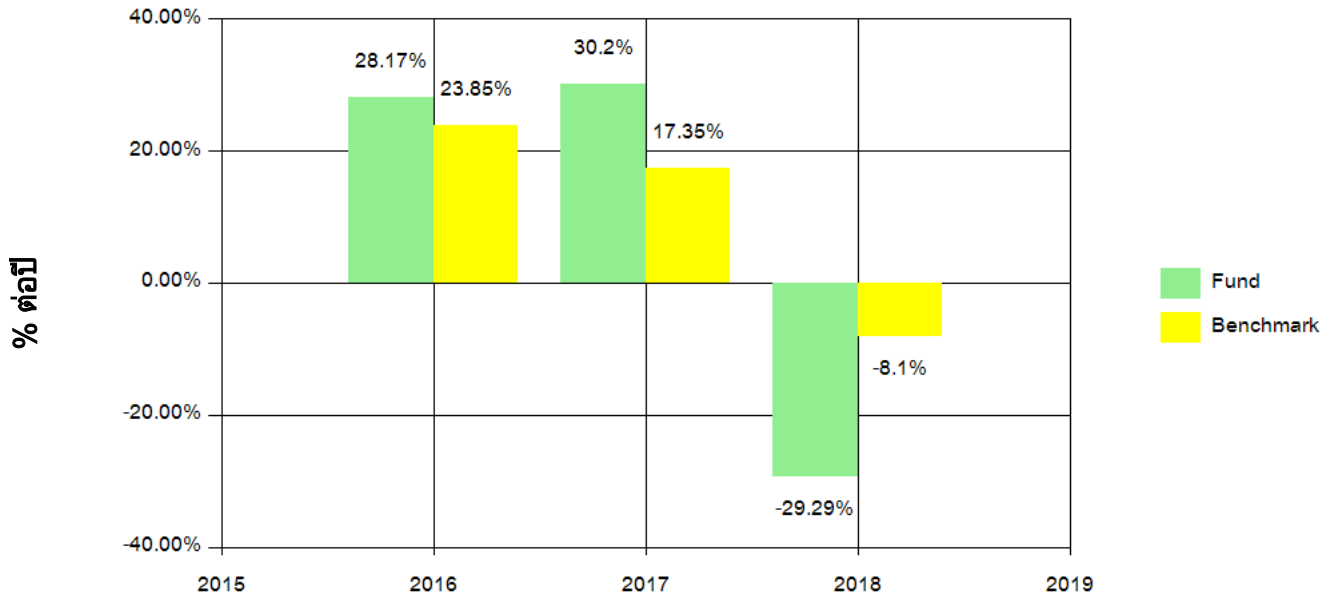
## ผลการดำเนินงานในอดีต

**\*ผลการดำเนินงานในอดีต มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต\***

### 1. ดัชนีชี้วัด (benchmark) ของกองทุนรวม

ดัชนีผลตอบแทนรวมตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET TRI)

### 2. แบบย้อนหลังตามปีปฏิทิน



\* ในปีที่กองทุนจัดตั้ง ผลการดำเนินงานจะแสดงตั้งแต่วันที่จัดตั้งจนถึงสิ้นปีปฏิทิน

### 3. กองทุนนี้เคยมีผลขาดทุนสูงสุดในช่วงเวลา 5 ปี : -32.90 %

\* กรณีกองทุนจัดตั้งไม่ครบ 5 ปีจะแสดงค่าที่เกิดขึ้นนับตั้งแต่จัดตั้งกองทุน

### 4. ความผันผวนของผลการดำเนินงาน (standard deviation) : 13.76 % ต่อปี

\* กรณีกองทุนจัดตั้งไม่ครบ 5 ปีจะแสดงค่าที่เกิดขึ้นนับตั้งแต่จัดตั้งกองทุน

### 5. ความผันผวนของส่วนต่างผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัด (Tracking Error : TE) : N/A

### 6. ประเภทกองทุนรวมเพื่อใช้เปรียบเทียบผลการดำเนินงาน ณ จุดขาย คือ Equity Small – Mid Cap

ตารางแสดงผลการดำเนินงานของกลุ่ม Equity Small – Mid Cap ณ วันที่ 30 เม.ย. 2562

Peer Percentile	Return (%)						Standard Deviation (%)					
	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี	3 ปี	5 ปี	10 ปี	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี	3 ปี	5 ปี	10 ปี
5th Percentile	5.81	-0.85	-6.46	11.51	6.00	N/A	8.04	10.29	11.29	13.69	12.18	N/A
25th Percentile	4.91	-2.39	-9.63	7.53	5.26	N/A	8.62	11.40	12.64	14.86	12.78	N/A
50th Percentile	4.52	-4.08	-12.73	4.80	4.34	N/A	8.97	12.21	13.46	15.13	13.52	N/A
75th Percentile	3.72	-4.90	-13.95	2.18	3.42	N/A	9.56	12.64	13.71	16.59	14.27	N/A
95th Percentile	2.58	-7.66	-16.78	-0.46	2.68	N/A	10.77	13.65	15.24	18.63	14.87	N/A

## 7.ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปิดหมด

กองทุน	YTD	3 เดือน	Peren tile	6 เดือน	Peren tile	1 ปี	Peren tile	3 ปี	Peren tile	5 ปี	Peren tile	10 ปี	Peren tile	ตั้งแต่จัดตั้ง
KFTHAISM	7.07	3.31	95th	-7.96	95th	-14.89	95th	6.57	50th	N/A	N/A	N/A	N/A	7.65
ดัชนีชี้วัด	8.61	3.44	95th	1.98	5th	-3.00	5th	9.31	25th	N/A	N/A	N/A	N/A	11.08
ความผันผวนของผลการดำเนินงาน	11.31	10.26	95th	13.12	95th	14.48	95th	13.98	25th	N/A	N/A	N/A	N/A	13.76
ความผันผวนของดัชนีชี้วัด	7.63	7.49	5th	9.64	5th	11.43	25th	10.48	5th	N/A	N/A	N/A	N/A	19.16

- ผลตอบแทนที่มีอายุเกินหนึ่งปีจะแสดงเป็นผลตอบแทนต่อปี
- กรณศึกษาข้อตกลงและเงื่อนไขของข้อมูลเปรียบเทียบผลการดำเนินงานแบบเปอร์เซ็นต์ไทล์ได้ที่หมายเหตุหน้าท้าย



## ข้อมูลอื่นๆ

นโยบายการจ่ายเงินปันผล :	ไม่จ่ายปันผล		
ผู้ดูแลผลประโยชน์ :	ธนาคารไทยพาณิชย์ จำกัด (มหาชน)		
วันที่จดทะเบียน :	26 ก.พ. 2559		
อายุโครงการ :	ไม่กำหนดอายุโครงการ		
การซื้อหน่วยลงทุน :	วันทำการซื้อ	ทุกวันทำการของธนาคารภายใน 15:30 น.	
	มูลค่าขั้นต่ำของการซื้อครั้งแรก	2,000 บาท	
	มูลค่าขั้นต่ำของการซื้อครั้งต่อไป	2,000 บาท	
การขายคืนหน่วยลงทุน :	วันทำการขายคืน	ทุกวันทำการของธนาคารภายใน 15:30 น.	
	มูลค่าขั้นต่ำของการขายคืน	2,000 บาท หรือ 200 หน่วย	
	ยอดคงเหลือขั้นต่ำ	200 หน่วย	
	ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน	3 วันทำการนับถัดจากวันทำรายการ (T+3)	
	ผู้ลงทุนสามารถตรวจสอบมูลค่าทรัพย์สินรายวันได้ที่ <a href="http://www.krungsriasset.com">www.krungsriasset.com</a>		
รายชื่อผู้จัดการกองทุน :	ชื่อ-นามสกุล	ขอบเขตหน้าที่	วันที่เริ่มบริหารกองทุน
	นายวิฑูรย์ เอื้ออานันท์	ผู้จัดการกองทุนตราสารทุน	26 ก.พ. 2559
	นายสาริต บัวชู	ผู้จัดการกองทุนตราสารทุน	1 พ.ย. 2560
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุนของกองทุน (Portfolio Turnover Ratio)	ในรอบระยะเวลาที่ผ่านมาย้อนหลัง 1 ปี เท่ากับ 37.07% กรณีกองทุนรวมที่จดทะเบียนจัดตั้งไม่ถึง 1 ปี จะแสดงค่าที่เกิดขึ้นจริงในช่วงเวลาดังตั้งแต่วันที่จดทะเบียนถึงวันที่รายงาน		
ผู้สนับสนุนการขายหรือรับซื้อคืน	ธนาคารกรุงศรีอยุธยา จำกัด (มหาชน) ทุกสาขา โทร 1572 บลจ.กรุงศรี หรือตัวแทนผู้สนับสนุนการขายและรับซื้อคืน		
ติดต่อสอบถาม รับหนังสือชี้ชวน/ร้องเรียน	บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด ที่อยู่ 898 อาคารเพลิมินจิตทาวเวอร์ ชั้น 1-2 โชนเอ ชั้น 12 ชั้น 18 โชนบี ถนนเพลินจิต แขวงลุมพินี เขตปทุมวัน กรุงเทพฯ 10330 โทรศัพท์ 0 2657 5757 โทรสาร 02 657 5777 เว็บไซต์ : <a href="http://www.krungsriasset.com">www.krungsriasset.com</a> อีเมล : <a href="mailto:krungsriasset.clientservice@krungsri.com">krungsriasset.clientservice@krungsri.com</a>		
ธุรกรรมที่อาจก่อให้เกิดความขัดแย้งทางผลประโยชน์	คุณสามารถตรวจสอบธุรกรรมที่อาจก่อให้เกิดความขัดแย้งทางผลประโยชน์ได้ที่ <a href="http://www.krungsriasset.com/th/Investment/RelatedPartyTransactions.html">www.krungsriasset.com/th/Investment/RelatedPartyTransactions.html</a>		
ข้อมูลอื่นๆ	ขนาดกองทุน	566 ล้านบาท	
	มูลค่าหน่วยลงทุน	12.6373 บาท/หน่วย	
	Morningstar Rating :	★★★★ (ข้อมูล ณ 29 มี.ค. 2562)	



**หมายเหตุ**

- การลงทุนในหน่วยลงทุนไม่ใช่การฝากเงิน รวมทั้งไม่ได้อยู่ภายใต้ความคุ้มครองของสถาบันคุ้มครองเงินฝาก จึงมีความเสี่ยงจากการลงทุนซึ่งผู้ลงทุนอาจไม่ได้รับเงินลงทุนคืนเต็มจำนวน
- ได้รับอนุมัติจัดตั้ง และอยู่ภายใต้การกำกับดูแลของสำนักงาน ก.ล.ต
- การพิจารณาร่างหนังสือชี้ชวนในการเสนอขายหน่วยลงทุนของกองทุนรวมนี้มิได้เป็นการแสดงว่าสำนักงาน ก.ล.ต. ได้รับความถูกต้องของข้อมูลในหนังสือชี้ชวนของกองทุนรวม หรือ ได้ประกันราคาหรือผลตอบแทนของหน่วยลงทุนที่เสนอขายนั้น ทั้งนี้ บริษัทจัดการกองทุนรวมได้สอบทานข้อมูลในหนังสือชี้ชวนส่วนสรุปข้อมูลสำคัญ ณ วันที่ 30 เม.ย. 2562 แล้วด้วยความระมัดระวังในฐานะผู้รับผิดชอบในการดำเนินการของกองทุนรวมและขอรับรองว่าข้อมูลดังกล่าวถูกต้องไม่เป็นเท็จและไม่ทำให้ผู้อื่นสำคัญผิด
- ผู้ลงทุนสามารถซื้อกรมธรรม์ประกันชีวิตควบหน่วยลงทุน(Unit-Linked) ของกองทุนนี้ได้โดยติดต่อกับบริษัทประกันชีวิตที่บริษัทจัดการกำหนด ทั้งนี้การซื้อกรมธรรม์ประกันชีวิตควบหน่วยลงทุนอาจมีข้อกำหนดและวิธีปฏิบัติที่แตกต่างไปจากผู้ถือหน่วยลงทุนปกติที่ซื้อขายหน่วยลงทุนของกองทุนนี้เพียงอย่างเดียว ผู้ลงทุนจึงควรศึกษารายละเอียดในเอกสารประกอบการขายกรมธรรม์ประกันชีวิตควบหน่วยลงทุนให้เข้าใจก่อนการตัดสินใจลงทุน ผู้ลงทุนจะได้รับเงินขายคืนหน่วยลงทุนจากบริษัทประกันชีวิตภายใน 5 วันทำการนับตั้งแต่วันถัดจากวันที่คำนวณ NAV โดยมีวิธีการรับเงินค่าขายคืนหน่วยลงทุนตามที่กำหนดไว้ในกรมธรรม์ฯ
- ข้อมูลการจัดอันดับกองทุนเป็นกรรมสิทธิ์ของบริษัท มอร์นิ่งสตาร์ ทั้งนี้บริษัทขอสงวนสิทธิ์ 1) ในการแก้ไข ปรับปรุง หรือเปลี่ยนแปลงข้อมูลใดๆ โดยไม่จำเป็นต้องแจ้งให้ทราบล่วงหน้าแต่อย่างใด 2)บริษัทขอสงวนสิทธิ์ที่จะไม่รับผิดชอบต่อความถูกต้อง ครบถ้วน และความเสียหายต่างๆ ที่เกิดขึ้นทุกกรณีจากการนำรายงานหรือข้อมูลไปใช้อ้างอิง

**ข้อตกลงและเงื่อนไขของข้อมูลเปรียบเทียบผลการดำเนินงานแบบเปอร์เซ็นต์ไทล์**

1. ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุน มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต
2. ผู้ลงทุนสามารถดูข้อมูลฉบับเต็มได้ที่ [www.aimc.or.th](http://www.aimc.or.th)
3. ผลการดำเนินงานของกองทุนที่การเปรียบเทียบแบ่งตามประเภทกองทุนรวมภายใต้ข้อกำหนดของสมาคมบริษัทจัดการลงทุน โดยกองทุนที่จะถูกเปรียบเทียบผลการดำเนินงานในแต่ละช่วงเวลากับกองทุนประเภทเดียวกันในระดับเปอร์เซ็นต์ไทล์ (Percentiles) ต่างๆ โดยแบ่งออกเป็น
  - 5th Percentile แสดงผลการดำเนินงานของกองทุนอันดับที่ 5 เปอร์เซ็นต์ไทล์ (Top 5% performance)
  - 25th Percentile แสดงผลการดำเนินงานของกองทุนอันดับที่ 25 เปอร์เซ็นต์ไทล์ (Top 25% performance)
  - 50th Percentile แสดงผลการดำเนินงานของกองทุนอันดับที่ 50 เปอร์เซ็นต์ไทล์ (Median performance)
  - 75th Percentile แสดงผลการดำเนินงานของกองทุนอันดับที่ 75 เปอร์เซ็นต์ไทล์ (Bottom 25% performance)
  - 95th Percentile แสดงผลการดำเนินงานของกองทุนอันดับที่ 95 เปอร์เซ็นต์ไทล์ (Bottom 5% performance)

เมื่อผู้ลงทุนทราบผลตอบแทนของกองทุนที่ลงทุน สามารถนำไปเปรียบเทียบกับเปอร์เซ็นต์ไทล์ตามตาราง จะทราบว่ากองทุนที่ลงทุนนั้นอยู่ในช่วงที่เท่าใดของประเภทกองทุนรวมนั้น

**คำอธิบายรายละเอียดของข้อมูลที่ต้องเปิดเผยในหนังสือชี้ชวนส่วนสรุปข้อมูลสำคัญ**

ข้อมูลที่เปิดเผยในส่วนนี้เป็นข้อมูล โดยสังเขปเพื่อใช้อธิบายมิติความเสี่ยงต่างๆ

	หัวข้อ	การเปิดเผยข้อมูล																																				
1	<p>ความเสี่ยงจากความผันผวนของมูลค่าหน่วยลงทุน (Market Risk)</p>	<p>แบ่งเป็นกรณีกองทุนรวมต่างๆ ดังต่อไปนี้</p> <table border="1" data-bbox="416 293 1497 450"> <tr> <td data-bbox="416 293 719 338">- กรณีกองทุนรวมตราสารทุน</td> <td colspan="5" data-bbox="719 293 1497 338">พิจารณาค่าความผันผวนของผลการดำเนินงานกองทุนรวม (standard deviation : SD) ต่อปี</td> </tr> <tr> <td data-bbox="416 338 719 383">ความผันผวนของ</td> <td data-bbox="719 338 799 383">ต่ำ</td> <td data-bbox="799 338 879 383"></td> <td data-bbox="879 338 959 383"></td> <td data-bbox="959 338 1038 383"></td> <td data-bbox="1038 338 1497 383">สูง</td> </tr> <tr> <td data-bbox="416 383 719 427">ผลการดำเนินงาน (SD)</td> <td data-bbox="719 383 799 427"><input type="checkbox"/></td> <td data-bbox="799 383 879 427"><input type="checkbox"/></td> <td data-bbox="879 383 959 427"><input type="checkbox"/></td> <td data-bbox="959 383 1038 427"><input type="checkbox"/></td> <td data-bbox="1038 383 1497 427"><input type="checkbox"/></td> </tr> </table> <p>กรณีกองทุนรวมตราสารทุน หมายถึง ความเสี่ยงที่มูลค่าของหลักทรัพย์ที่กองทุนรวมลงทุนจะเปลี่ยนแปลงเพิ่มขึ้นหรือลดลงจากปัจจัยภายนอก เช่น สถานะเศรษฐกิจการลงทุน ปัจจัยทางการเมืองทั้งในและต่างประเทศ เป็นต้น ซึ่งพิจารณาได้จากค่า standard deviation (SD) ของกองทุนรวม หากกองทุนรวมมีค่า SD สูง แสดงว่ากองทุนรวมมีความผันผวนจากการเปลี่ยนแปลงของราคาหลักทรัพย์สูง</p> <p>กรณีกองทุนรวมตราสารทุนในประเทศ สามารถพิจารณาลักษณะหุ้นที่กองทุนรวมเน้นลงทุน</p> <table border="1" data-bbox="416 730 1497 898"> <tr> <td data-bbox="416 730 719 775">- กรณีกองทุนรวมตราสารทุนในประเทศ</td> <td colspan="5" data-bbox="719 730 1497 775">ระบุมิติความเสี่ยงของลักษณะหุ้นที่กองทุนรวมเน้นลงทุน (ประมาณ 80% ของ NAV)</td> </tr> <tr> <td data-bbox="416 775 719 819">กลุ่มหุ้นที่เน้นลงทุน</td> <td data-bbox="719 775 799 819">ต่ำ</td> <td data-bbox="799 775 879 819"></td> <td data-bbox="879 775 959 819"></td> <td data-bbox="959 775 1038 819"></td> <td data-bbox="1038 775 1497 819">สูง</td> </tr> <tr> <td></td> <td data-bbox="719 819 799 864"><input type="checkbox"/></td> <td data-bbox="799 819 879 864"><input type="checkbox"/></td> <td data-bbox="879 819 959 864"><input type="checkbox"/></td> <td data-bbox="959 819 1038 864"><input type="checkbox"/></td> <td data-bbox="1038 819 1497 864"><input type="checkbox"/></td> </tr> </table>	- กรณีกองทุนรวมตราสารทุน	พิจารณาค่าความผันผวนของผลการดำเนินงานกองทุนรวม (standard deviation : SD) ต่อปี					ความผันผวนของ	ต่ำ				สูง	ผลการดำเนินงาน (SD)	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	- กรณีกองทุนรวมตราสารทุนในประเทศ	ระบุมิติความเสี่ยงของลักษณะหุ้นที่กองทุนรวมเน้นลงทุน (ประมาณ 80% ของ NAV)					กลุ่มหุ้นที่เน้นลงทุน	ต่ำ				สูง		<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
- กรณีกองทุนรวมตราสารทุน	พิจารณาค่าความผันผวนของผลการดำเนินงานกองทุนรวม (standard deviation : SD) ต่อปี																																					
ความผันผวนของ	ต่ำ				สูง																																	
ผลการดำเนินงาน (SD)	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>																																	
- กรณีกองทุนรวมตราสารทุนในประเทศ	ระบุมิติความเสี่ยงของลักษณะหุ้นที่กองทุนรวมเน้นลงทุน (ประมาณ 80% ของ NAV)																																					
กลุ่มหุ้นที่เน้นลงทุน	ต่ำ				สูง																																	
	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>																																	
2	<p>ความเสี่ยงจากการกระจุกตัวลงทุนในผู้ออกรายใดรายหนึ่ง (High issuer concentration risk)</p>	<p>พิจารณาจากการลงทุนแบบกระจุกตัวในตราสารของผู้ออกตราสาร คู่สัญญา หรือบุคคลอื่นที่มีภาระผูกพันตามตราสารหรือสัญญานั้น รายใดรายหนึ่งมากกว่า 10% ของ NAV รวมกัน</p> <p>ทั้งนี้ การลงทุนแบบกระจุกตัวไม่รวมถึงกรณีการลงทุนในทรัพย์สินดังนี้</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>ตราสารหนี้ภาครัฐไทย</li> <li>ตราสารภาครัฐต่างประเทศที่มีการจัดอันดับความน่าเชื่อถืออยู่ในอันดับที่สามารถลงทุนได้</li> <li>เงินฝากหรือตราสารเทียบเท่าเงินฝากที่ผู้รับฝากหรือผู้ออกตราสารที่มีการจัดอันดับความน่าเชื่อถืออยู่ในอันดับที่สามารถลงทุนได้</li> </ol>																																				
3	<p>ผลขาดทุนสูงสุดที่เกิดขึ้นจริง 5 ปี (Maximum Drawdown)</p>	<p>ผลขาดทุนสะสมสูงสุดที่เกิดจากการลงทุนจริงของกองทุนรวมย้อนหลังเป็นระยะเวลาอย่างน้อย 5 ปี นับแต่วันที่รายงาน (หรือตั้งแต่จัดตั้งกองทุนรวมกรณียังไม่ครบ 5 ปี) โดยมีวิธีการคำนวณดังนี้</p> $\text{Drawdown}_{(t)} = \frac{\text{มูลค่าหน่วยลงทุน}_{(t)} - \text{มูลค่าหน่วยลงทุนสูงสุด}^*}{\text{มูลค่าหน่วยลงทุนสูงสุด}^*}$ $\text{Maximum Drawdown} = \min (\text{Drawdown}_{(t)})$ <p>หมายเหตุ : * มูลค่าหน่วยลงทุนสูงสุด คือ มูลค่าหน่วยลงทุนสูงสุดของระยะเวลาก่อนหน้าจนถึงวันที่คำนวณ (t)</p>																																				
4	<p>ค่าความผันผวนของผลการดำเนินงาน (Standard Deviation : SD)</p>	<p>คือความผันผวนของผลตอบแทนกองทุน (Standard Deviation of Fund) คำนวณจากผลตอบแทนของกองทุนรวมซึ่งมีวิธีการคำนวณเป็นไปตามหลักเกณฑ์ของสมาคมบริษัทจัดการลงทุนว่าด้วยมาตรฐานการวัดและนำเสนอผลการดำเนินงานของกองทุนรวม ใช้การเปิดเผยค่า SD ของกองทุนรวมย้อนหลังเป็นระยะเวลา 5 ปี นับแต่วันที่รายงาน แสดงเป็น % ต่อปี</p>																																				

	หัวข้อ	การเปิดเผยข้อมูล
5	ค่าความผันผวนของส่วนต่างของผลตอบแทนเฉลี่ยของกองทุนรวมและผลตอบแทนของดัชนีชี้วัด (Tracking Error)	<p>Tracking Error คือ ความผันผวนของส่วนต่างของผลตอบแทนเฉลี่ยของกองทุนรวมและผลตอบแทนของดัชนีชี้วัด ซึ่งสะท้อนให้เห็นถึงประสิทธิภาพในการเลียนแบบดัชนีชี้วัดของกองทุนรวมว่ามีการเบี่ยงเบนออกไปจากดัชนีชี้วัดมากน้อยเพียงใด เช่น หากกองทุนรวมมีค่า TE ต่ำ แสดงว่า อัตราผลตอบแทนของกองทุนมีการเบี่ยงเบนออกไปจาก ดัชนีชี้วัดในอัตราที่ต่ำ ดังนั้น กองทุนรวมนี้จึงมีประสิทธิภาพในการเลียนแบบดัชนีชี้วัด อ้างอิง ในขณะที่กองทุนรวมที่มีค่า TE สูง แสดงว่าอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมมีการเบี่ยงเบนออกจากดัชนีชี้วัดในอัตราที่สูง ดังนั้น โอกาสที่ผลตอบแทน การลงทุนจะเป็นไปตามผลตอบแทนของ benchmark ก็จะมีลดน้อยลง เป็นต้น</p> <p>ใช้พิจารณาเกี่ยวกับกองทุนรวมที่มีนโยบายการบริหารกองทุนแบบ passive fund/ Index tracking เช่น กองทุนรวมดัชนี หรือกองทุนรวมอีทีเอฟ เป็นต้น</p>
6	อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุนของกองทุนรวม (Portfolio Turnover Ratio : PTR)	<p>เพื่อให้ผู้ลงทุน ทราบถึงปริมาณการซื้อขายทรัพย์สินของกองทุน และช่วยสะท้อนกลยุทธ์การลงทุนของผู้จัดการกองทุน ได้ดียิ่งขึ้น โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อขายทรัพย์สินที่กองทุนรวมลงทุนในรอบระยะเวลาผ่านมาย้อนหลัง 1 ปี หารด้วยมูลค่าทรัพย์สินสุทธิเฉลี่ยของกองทุนรวมในรอบระยะเวลาเดียวกัน</p> <div style="border: 1px solid black; padding: 10px; width: fit-content; margin: 10px auto;"> <math display="block">PTR = \frac{\text{Min (ซื้อหุ้น , ขายหุ้น)}}{\text{Avg. NAV}}</math> </div>