

กองทุนเปิดเค ALL-EN ห้ามขายผู้ลงทุนรายย่อย-C ชนิดสะสมมูลค่า

K-ALLEN-UI-C(A)

ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

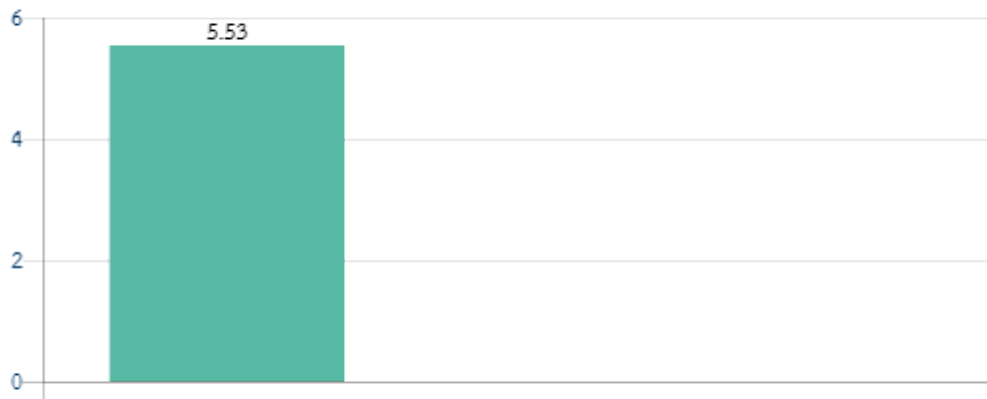
- กองทุนรวมผสมต่างประเทศ / กองทุนรวมฟิเดอริโอ
- กลุ่ม Foreign Investment Allocation

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- กองทุนนี้เปลี่ยนชื่อมาจากกองทุนเปิดเค ออลโรดส์ เอ็นแฮนซ์ ห้ามขายผู้ลงทุนรายย่อย เมื่อวันที่ 19 มกราคม 2566
- ลงทุนในกองทุน LO Funds IV - All Roads Enhanced, (USD), I Class A (กองทุนหลัก) ที่มีนโยบายลงทุนในตราสารทุน ตราสารหนี้ที่ออกโดยภาครัฐหรือภาคเอกชน และสินค้าโภคภัณฑ์ ในประเทศต่างๆ ทั่วโลก และมีการจัดสรรน้ำหนักการลงทุนในสินทรัพย์ดังกล่าวเพื่อควบคุมความเสี่ยงของพอร์ตการลงทุนโดยรวม
- ป้องกันความเสี่ยงด้านอัตราแลกเปลี่ยนตามดุลยพินิจของผู้จัดการกองทุน
- กองทุนนี้ลงทุนในกองทุนหลักซึ่งอาจลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่มีวัตถุประสงค์เพื่อเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน และเพื่อเป็นส่วนหนึ่งของกลยุทธ์การลงทุน และกองทุนนี้อาจลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเพื่อการเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน หากราคาหลักทรัพย์อ้างอิงมีความผันผวนมาก หรือทิศทางการลงทุนไม่เป็นไปตามที่คาดการณ์ กองทุนอาจขาดทุนได้ อย่างไรก็ตาม ผู้ลงทุนจะขาดทุนไม่เกิน 100% ของมูลค่าเงินลงทุนเริ่มแรกของผู้ลงทุน
- บริษัทที่บริหารจัดการกองทุนหลัก คือ Lombard Odier Funds (Europe) S.A.
- มุ่งหวังให้ผลประกอบการเคลื่อนไหวตามกองทุนหลัก โดยกองทุนหลักมุ่งหวังให้ผลประกอบการเคลื่อนไหวสูงกว่าดัชนีชี้วัด (active management) และใช้กลยุทธ์ Risk-based methodology เพื่อควบคุมความเสี่ยงของพอร์ตการลงทุนโดยรวม

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (% ต่อปี)

■ กองทุน ■ ดัชนีชี้วัด ■ ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน



ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปีหมุน (%)

| | YTD | 3 เดือน | 6 เดือน | 1 ปี * |
|--------------------------|-------|---------|---------|--------|
| กองทุน | 5.08 | -3.04 | -0.82 | 14.99 |
| ดัชนีชี้วัด | N/A | N/A | N/A | N/A |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน | 4.29 | -0.19 | 2.67 | 13.18 |
| ความผันผวนกองทุน | 10.06 | 9.61 | 10.23 | 9.82 |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด | N/A | N/A | N/A | N/A |

| | 3 ปี * | 5 ปี * | 10 ปี * | ตั้งแต่จัดตั้ง * |
|--------------------------|--------|--------|---------|------------------|
| กองทุน | N/A | N/A | N/A | 9.40 |
| ดัชนีชี้วัด | N/A | N/A | N/A | N/A |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน | N/A | N/A | N/A | N/A |
| ความผันผวนกองทุน | N/A | N/A | N/A | 9.44 |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด | N/A | N/A | N/A | N/A |

หมายเหตุ : * % ต่อปี

ระดับความเสี่ยง

ต่ำ 1 2 3 4 5 6 7 8 8+ สูง

ความเสี่ยงสูงมาก อย่างมีนัยสำคัญ

ลงทุนในตราสารทุน ตราสารหนี้ และหรือทรัพย์สินทางเลือก โดยไม่จำกัดอัตราส่วนการลงทุน

ข้อมูลกองทุนรวม

| | |
|------------------------|------------|
| วันจดทะเบียนกองทุน | 9 มี.ค. 65 |
| วันเริ่มต้น class | 8 ก.ย. 66 |
| นโยบายการจ่ายเงินปันผล | ไม่จ่าย |
| อายุกองทุน | ไม่กำหนด |

ผู้จัดการกองทุนรวม

น.ส. ชุมทวรรณ ชัดดินานนท์ (ตั้งแต่ 1 พ.ย. 66)

ดัชนีชี้วัด :

ไม่มี

คำเตือน:

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวม มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต : ได้รับการรับรองจาก CAC

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

ผู้ลงทุนสามารถศึกษา
เครื่องมือบริหารความเสี่ยง
ด้านสภาพคล่องได้ใน
หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



www.kasikornasset.com

การซื้อขายหน่วยลงทุน

วันทำการซื้อ : ทุกวันทำการซื้อขาย

เวลาทำการ : 08:30 น. - 15:30 น.

การซื้อขายครั้งแรกขั้นต่ำ : ไม่กำหนด

การซื้อขายครั้งถัดไปขั้นต่ำ : ไม่กำหนด

การขายคืนหน่วยลงทุน

วันทำการขายคืน : ทุกวันทำการซื้อขาย

เวลาทำการ : 08:30 น. - 15:30 น.

การขายคืนขั้นต่ำ : ไม่กำหนด

ยอดคงเหลือขั้นต่ำ : ไม่กำหนด

ระยะเวลาการรับเงินขายคืน : T+6

(ประกาศ NAV T+3 คืนเงิน T+6 เวลา 10.00 น.เป็นต้นไป)

ข้อมูลเชิงสถิติ

| | |
|----------------------------|-----------|
| Maximum Drawdown | -7.52 % |
| Recovering Period | N/A |
| FX Hedging | 91.47 % |
| อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน | 0.08 เท่า |

หมายเหตุ :

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)

| ค่าธรรมเนียม | สูงสุดไม่เกิน | เก็บจริง |
|---------------|---------------|----------|
| การจัดการ | 3.2100 | 1.0700 |
| รวมค่าใช้จ่าย | 4.8685 | 1.1315 |

หมายเหตุ : ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะ หรือภาษีอื่นใดแล้ว

- บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริง เพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)

| ค่าธรรมเนียม | สูงสุดไม่เกิน | เก็บจริง |
|-----------------------------|----------------|--------------|
| การขาย | 2.00 | ยกเว้น |
| การรับซื้อคืน | 2.00 | ยกเว้น |
| การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า | | ดูหมายเหตุ |
| การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก | | ดูหมายเหตุ |
| การโอนหน่วย | ตามที่เก็บจริง | ไม่เรียกเก็บ |

หมายเหตุ : ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะ หรือภาษีอื่นใดแล้ว

- บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริง เพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ

ค่าธรรมเนียมการสับเปลี่ยน (Switching Fee) : อัตราเท่ากับค่าธรรมเนียมการรับซื้อคืนหน่วยลงทุนของกองทุนต้นทาง หรือค่าธรรมเนียมการขายหน่วยลงทุนของกองทุนปลายทางแล้วแต่อัตราใดจะสูงกว่า

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน**ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก**

| ประเภททรัพย์สิน | % NAV | ทรัพย์สิน | % NAV |
|-----------------|-------|--|-------|
| หน่วยลงทุน | 94.11 | LO Funds IV-All Roads Enhanced (USD) I | 94.11 |
| เงินฝาก | 2.95 | Class A | |
| อื่นๆ | 2.94 | เงินฝาก บมจ.ธนาคารทหารไทยธนชาติ | 2.39 |
| | | เงินฝาก บมจ.ธนาคารกสิกรไทย | 0.56 |

การลงทุนในกองทุนอื่นเกินกว่า 20 % (กองในประเทศและกองต่างประเทศ)

ชื่อกองทุน : [กองทุน LO Funds IV - All Roads Enhanced, \(USD\), I Class A](#)

ISIN Code : LU2076220792

Bloomberg Code : LOAREUI:LX

คำอธิบาย

Maximum Drawdown เปรอ์เซ็นต์ผลขาดทุนสูงสุดของกองทุนรวมในระยะเวลา 5 ปีย้อนหลัง (หรือตั้งแต่จัดตั้งกองทุนกรณีที่ยังไม่ครบ 5 ปี) โดยวัดจากระดับ NAV ต่อหน่วยที่จุดสูงสุดไปจนถึงจุดต่ำสุดในช่วงที่ NAV ต่อหน่วยปรับตัวลดลง ค่า Maximum Drawdown เป็นข้อมูลที่ช่วยให้ทราบถึงความเสี่ยงที่อาจขาดทุนจากการลงทุนในกองทุนรวม

Recovering Period ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาตั้งแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลานานเท่าใด

FX Hedging เปรอ์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตกองทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลานึง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์กับผลรวมของมูลค่าการขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 1 ปีหารด้วยมูลค่า NAV ของกองทุนรวมเฉลี่ยในรอบระยะเวลาเดียวกัน กองทุนรวมที่มีค่าอัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุนสูง 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 หลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนมากกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด

Tracking Error อัตราผลตอบแทนของกองทุนมีประสิทธิภาพในการเลียนแบบดัชนีชี้วัด โดยหาก tracking error ต่ำ หมายถึงกองทุนรวมมีประสิทธิภาพในการสร้างผลตอบแทนให้ใกล้เคียงกับดัชนีชี้วัด กองทุนรวมที่มีค่า tracking error สูง จะมีอัตราผลตอบแทนโดยเฉลี่ยห่างจากดัชนีชี้วัดมากขึ้น

Yield to Maturity อัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในตราสารหนี้โดยถือจนครบกำหนดอายุ ซึ่งคำนวณจากดอกเบี้ยที่จะได้รับในอนาคตตลอดอายุตราสารและเงินต้นที่จะได้รับคืน นำมาคิดลดเป็นมูลค่าปัจจุบัน โดยใช้ตัวอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมตราสารหนี้ คำนวณจากค่าเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักของ Yield to Maturity ของตราสารหนี้แต่ละตัวที่กองทุนมีการลงทุน และเนื่องจาก Yield to Maturity มีหน่วยมาตรฐานเป็นเปอร์เซ็นต์ต่อปี จึงสามารถนำไปใช้เปรียบเทียบอัตราผลตอบแทนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีนโยบายถือครองตราสารหนี้จนครบกำหนดอายุและมีลักษณะการลงทุนที่ใกล้เคียงกันได้

๑ สงวนลิขสิทธิ์ 2024 บริษัท มอร์นิ่งสตาร์ รีเสิร์ช (ประเทศไทย) จำกัด ข้อมูลนี้ (1) เป็นกรรมสิทธิ์ของบริษัท มอร์นิ่งสตาร์ รีเสิร์ช (ประเทศไทย) จำกัด และ/หรือ ผู้ให้บริการข้อมูล (2) ขอสงวนสิทธิ์ในการลอกเลียน หรือเผยแพร่ (3) ขอสงวนสิทธิ์ที่จะไม่รับผิดชอบต่อความถูกต้อง ครบถ้วน และความเสียหายต่างๆ ที่เกิดขึ้นทุกกรณีจากการนำข้อมูลไปใช้อ้างอิง ผลการดำเนินงานในอดีตมิได้เป็นสัญญาณยืนยันผลการดำเนินงานในอนาคต

หนังสือชี้ชวนส่วนสรุปข้อมูลสำคัญ



บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กสิกรไทย จำกัด
ที่อยู่ : 400/22 อาคารธนาคารกสิกรไทย ชั้น 6 และ 12 ถนนพหลโยธิน
แขวงสามเสนใน เขตพญาไท กรุงเทพฯ 10400
โทรศัพท์ : 0 - 2673 - 3888

website : www.kasikornasset.com

email : ka.customer@kasikornasset.com

หนังสือยินยอมรับทราบความเสี่ยงจากการลงทุน
กองทุนเปิดเค ALL-EN ห้ามขายผู้ลงทุนรายย่อย-C ชนิดสะสมมูลค่า (K-ALLEN-UI-C(A))

ข้าพเจ้าได้รับทราบและมีความเข้าใจเกี่ยวกับลักษณะ นโยบายการลงทุน กลยุทธ์การลงทุน ความเสี่ยง และผลตอบแทนที่เกี่ยวข้องกับกองทุนเปิดเค ALL-EN ห้ามขายผู้ลงทุนรายย่อย-C ชนิดสะสมมูลค่า (K-ALLEN-UI-C(A)) เป็นอย่างดีแล้วว่า

1. กองทุน K-ALLEN-UI-C(A) จัดเป็นกองทุนที่มีความเสี่ยงสูงหรือมีความซับซ้อน จึงมีความแตกต่างจากการลงทุนในกองทุนรวมทั่วไป เนื่องจากกองทุน K-ALLEN-UI-C(A) ลงทุนในกองทุนต่างประเทศที่ลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเพื่อใช้เป็นเครื่องมือในการสร้างกลยุทธ์การลงทุนที่ซับซ้อน เช่น Long/short Strategy เป็นต้น และเพื่อเพิ่มฐานะการลงทุนในสินทรัพย์โดยรวม (Leverage) ซึ่งอาจมีการลงทุนทั้งฐานะซื้อ (long position) และฐานะขาย (short position) ที่สูงกว่ามูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน จึงส่งผลให้กองทุน K-ALLEN-UI-C(A) มีความเสี่ยงมากกว่ากองทุนรวมที่ลงทุนในหลักทรัพย์โดยตรง
2. แม้ว่าการเพิ่มฐานะการลงทุนจากการลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้าจะช่วยเพิ่มโอกาสในการรับผลตอบแทนของกองทุนให้สูงขึ้น แต่กรณีที่ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงมีความผันผวนมาก หรือทิศทางการลงทุนไม่เป็นไปตามที่คาดการณ์ อาจทำให้กองทุนขาดทุนจากการลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้าหรือตราสารที่มีสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแฝง

ลงชื่อผู้ซื้อหน่วยลงทุนวันที่.....
(.....)

สำหรับผู้ซื้อหน่วยลงทุน

**หนังสือยินยอมรับทราบความเสี่ยงจากการลงทุน
กองทุนเปิดเค ALL-EN ห้ามขายผู้ลงทุนรายย่อย-C ชนิดสะสมมูลค่า (K-ALLEN-UI-C(A))**

ข้าพเจ้าได้รับทราบและมีความเข้าใจเกี่ยวกับลักษณะ นโยบายการลงทุน กลยุทธ์การลงทุน ความเสี่ยง และผลตอบแทนที่เกี่ยวข้องกับกองทุนเปิดเค ALL-EN ห้ามขายผู้ลงทุนรายย่อย-C ชนิดสะสมมูลค่า (K-ALLEN-UI-C(A)) เป็นอย่างดีแล้วว่า

1. กองทุน K-ALLEN-UI-C(A) จัดเป็นกองทุนที่มีความเสี่ยงสูงหรือมีความซับซ้อน จึงมีความแตกต่างจากการลงทุนในกองทุนรวมทั่วไป เนื่องจากกองทุน K-ALLEN-UI-C(A) ลงทุนในกองทุนต่างประเทศที่ลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเพื่อใช้เป็นเครื่องมือในการสร้างกลยุทธ์การลงทุนที่ซับซ้อน เช่น Long/short Strategy เป็นต้น และเพื่อเพิ่มฐานะการลงทุนในสินทรัพย์โดยรวม (Leverage) ซึ่งอาจมีการลงทุนทั้งฐานะซื้อ (long position) และฐานะขาย (short position) ที่สูงกว่ามูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน จึงส่งผลให้กองทุน K-ALLEN-UI-C(A) มีความเสี่ยงมากกว่ากองทุนรวมที่ลงทุนในหลักทรัพย์โดยตรง
2. แม้ว่าการเพิ่มฐานะการลงทุนจากการลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้าจะช่วยเพิ่มโอกาสในการรับผลตอบแทนของกองทุนให้สูงขึ้น แต่กรณีที่ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงมีความผันผวนมาก หรือทิศทางการลงทุนไม่เป็นไปตามที่คาดการณ์ อาจทำให้กองทุนขาดทุนจากการลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้าหรือตราสารที่มีสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแฝง

ลงชื่อผู้ซื้อหน่วยลงทุน วันที่.....
(.....)