

กองทุนเปิดเค มัลติ-ตราทึ่จี บอนด์ ห้ามขายผู้ลงทุนรายย่อย

K-MBOND

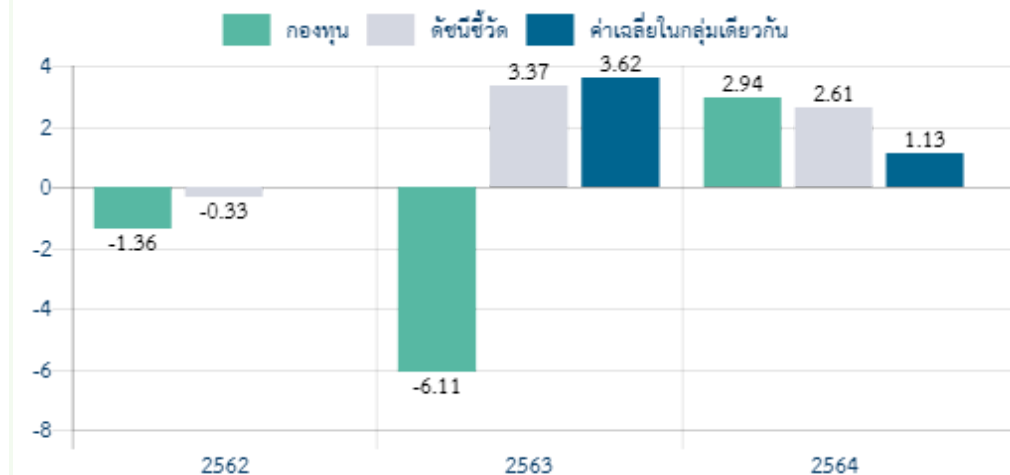
ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมตราสารหนี้ต่างประเทศ / กองทุนรวมฟีดเดอร์
- กลุ่ม Global Bond Discretionary F/X Hedge or Unhedge

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- ลงทุนในกองทุน PrivilEdge – H2O High Conviction Bonds, (EUR), I Class A (กองทุนหลัก) ที่มีการลงทุนในตราสารหนี้ที่จ่ายดอกเบี้ยทั้งแบบคงที่และลอยตัว ตราสารหนี้ที่มีอันดับความน่าเชื่อถือต่ำกว่าที่สามารถลงทุนได้ หุ้นกู้แปลงสภาพที่มีเงื่อนไข (Coco Bonds) หุ้นกู้แปลงสภาพ (Convertible bonds) และหรือตราสารหนี้อื่น เงินตราต่างประเทศสกุลต่างๆ และอาจลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ซึ่งรวมถึงสัญญาซื้อขายล่วงหน้าอ้างอิงกับเครดิต (รวมถึง Credit default swap) อัตราดอกเบี้ย (รวมถึง Interest rate swap) อัตราเงินเพื่อ เงินตราต่างประเทศสกุลต่างๆ และค่าความผันผวน เป็นต้น และอาจลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเพื่อเป็นส่วนหนึ่งของกลยุทธ์การลงทุนซึ่งส่งผลให้ฐานการการลงทุนในสินทรัพย์สูงขึ้น (Leverage)
- กองทุนและกองทุนหลักอาจลงทุนในตราสารที่มีสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแฝง (Structured Notes) และสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเพื่อการเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน (Efficient Portfolio Management)
- ป้องกันความเสี่ยงด้านอัตราแลกเปลี่ยนตามดุลยพินิจของผู้จัดการกองทุน
- บริษัทที่บริหารจัดการกองทุนหลัก คือ Lombard Odier Funds (Europe) S.A.
- มุ่งหวังให้ผลประโยชน์การเคลื่อนไหวตามกองทุนหลัก โดยกองทุนหลักมุ่งหวังให้ผลประโยชน์การเคลื่อนไหวสูงกว่าดัชนีชี้วัด (active management)

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (% ต่อปี)



ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปีกลมุด (%)

	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี *
กองทุน	7.21	2.28	1.55	8.08
ดัชนีชี้วัด	-8.61	-3.36	-2.63	-10.21
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	-10.21	-1.94	-4.05	-9.89
ความผันผวนกองทุน	22.30	14.68	15.00	21.84
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	8.59	7.50	8.34	8.37
	3 ปี *	5 ปี *	10 ปี *	ตั้งแต่จัดตั้ง *
กองทุน	N/A	N/A	N/A	0.73
ดัชนีชี้วัด	N/A	N/A	N/A	-1.15
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	N/A	N/A	N/A	N/A
ความผันผวนกองทุน	N/A	N/A	N/A	22.58
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	N/A	N/A	N/A	6.42

หมายเหตุ : * % ต่อปี

ระดับความเสี่ยง

ต่ำ 1 2 3 4 5 6 7 8 สูง

ความเสี่ยงปานกลางค่อนข้างสูง

ลงทุนในพันธบัตรรัฐบาล และตราสารหนี้เอกชน โดยมีตราสาร non-investment grade/unrated เกินกว่า 20% แต่ไม่น้อยกว่า 60% ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน	13 ธ.ค. 62
นโยบายการจ่ายเงินปันผล	ไม่จ่าย
อายุกองทุน	ไม่กำหนด

ผู้จัดการกองทุนรวม

น.ส. กัญญา พสุธีรฤนิกร (ตั้งแต่ 13 ธ.ค. 62)

ดัชนีชี้วัด :

1. ดัชนี JP Morgan Government Bond Index Broad (100.00%)

ปรับตัวด้วยต้นทุนการป้องกันความเสี่ยงอัตราแลกเปลี่ยน เพื่อเทียบกับค่าสกุลเงินบาท ณ วันที่คำนวณผลตอบแทน ร้อยละ 90 และปรับตัวด้วยอัตราแลกเปลี่ยนเพื่อเทียบกับค่าสกุลเงินบาท ณ วันที่คำนวณผลตอบแทน ร้อยละ 10

คำเตือน:

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวม มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต : ได้รับการรับรองจาก CAC

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

ผู้ลงทุนสามารถศึกษา
เครื่องมือบริหารความเสี่ยง
ด้านสภาพคล่องได้ใน
หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



www.kasikornasset.com

การซื้อขายหน่วยลงทุน

วันทำการซื้อ : -
 เวลาทำการ : -
 การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ : -
 การซื้อครั้งถัดไปขั้นต่ำ : -

การขายคืนหน่วยลงทุน

วันทำการขายคืน : ทุกวันทำการซื้อขาย
 เวลาทำการ : 08:30 น. - 15:30 น.
 การขายคืนขั้นต่ำ : 500 บาท
 ยอดคงเหลือขั้นต่ำ : 50 บาท
 ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน : T+1
 (ประกาศ NAV T+1 คืนเงิน T+1 เวลา 15.00 น. เป็นต้นไป)

ข้อมูลเชิงสถิติ

Maximum Drawdown -36.90 %
 Recovering Period N/A
 FX Hedging 94.38 %
 อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน 0.03 เท่า

หมายเหตุ : ไม่เปิดให้ซื้อและสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้าตั้งแต่วันที่ 23 ธันวาคม 2565 เป็นต้นไป

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	3.2100	ยกเว้น
รวมค่าใช้จ่าย	4.8685	0.0828

หมายเหตุ : ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะ หรือภาษีอื่นใดแล้ว

- บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริง เพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ
- บริษัทจัดการยกเว้นค่าธรรมเนียมการจัดการ โดยมีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 23 ธ.ค. 2565 เป็นต้นไป

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การขาย	3.00	1.50
การรับซื้อคืน	3.00	ยกเว้น
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก		ดูหมายเหตุ
การโอนหน่วย	ตามที่เก็บจริง	ไม่เรียกเก็บ

หมายเหตุ : ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะ หรือภาษีอื่นใดแล้ว

- บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริง เพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ
- ค่าธรรมเนียมการสับเปลี่ยนออก : อัตราเท่ากับค่าธรรมเนียมการรับซื้อคืนหน่วยลงทุนของกองทุนต้นทางหรือค่าธรรมเนียมการขายหน่วยลงทุนของกองทุนปลายทางแล้วแต่อัตราใดจะสูงกว่า

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน**ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก**

ประเภททรัพย์สิน	% NAV	ทรัพย์สิน	% NAV
เงินฝาก	100.34	เงินฝาก JP Morgan Chase Bank, N.A.	97.43
อื่นๆ	-0.34	เงินฝาก ธนาคารไทยพาณิชย์ จำกัด (มหาชน)	2.91

คำอธิบาย

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

Recovering Period ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาตั้งแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลานานเท่าใด

FX Hedging เปรอ์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

อัตราส่วนหมุนเวียนการการลงทุน ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตกองทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลาหนึ่ง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์กับผลรวมของมูลค่าการขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 1 ปีหารด้วยมูลค่า NAV ของกองทุนรวมเฉลี่ยในรอบระยะเวลาเดียวกัน กองทุนรวมที่มีค่าอัตราส่วนหมุนเวียนการการลงทุนสูง บ่งชี้ถึงการซื้อขายหลักทรัพย์บ่อยครั้งของผู้จัดการกองทุนและทำให้มีต้นทุนการซื้อขายหลักทรัพย์ที่สูง จึงต้องพิจารณาเปรียบเทียบกับผลการดำเนินงานของกองทุนรวมเพื่อประเมินความคุ้มค่าของการซื้อขายหลักทรัพย์ดังกล่าว

Sharpe Ratio อัตราส่วนระหว่างผลตอบแทนส่วนเพิ่มของกองทุนรวมเปรียบเทียบกับความเสี่ยงจากการลงทุน โดยคำนวณจากผลต่างระหว่างอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมกับอัตราผลตอบแทนที่ปราศจากความเสี่ยง (risk-free rate) เปรียบเทียบกับค่าเบี่ยงเบนมาตรฐาน (standard deviation) ของกองทุนรวม ค่า Sharpe Ratio สะท้อนถึงอัตราผลตอบแทนที่กองทุนรวมควรได้รับเพิ่มขึ้นเพื่อชดเชยกับความเสี่ยงที่กองทุนรวมรับมา โดยกองทุนรวมที่มีค่า Sharpe Ratio สูงกว่าจะเป็นกองทุนที่มีประสิทธิภาพในการบริหารจัดการการลงทุนที่ดีกว่า 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 โดยใช้วัดอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมตราสารหนี้ คำนวณจากค่าเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักของ Yield to Maturity ของตราสารหนี้แต่ละตัวที่กองทุนมีการลงทุน และเนื่องจาก Yield to Maturity มีหน่วยมาตรฐานเป็นเปอร์เซ็นต์ต่อปี จึงสามารถนำไปใช้เปรียบเทียบอัตราผลตอบแทนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีนโยบายถือครองตราสารหนี้จนครบกำหนดอายุและมีลักษณะการลงทุนที่ใกล้เคียงกันได้

© สงวนลิขสิทธิ์ 2022 บริษัท มอร์นิ่งสตาร์ รีเสิร์ช (ประเทศไทย) จำกัด ข้อมูลนี้ (1) เป็นกรรมสิทธิ์ของบริษัท มอร์นิ่งสตาร์ รีเสิร์ช (ประเทศไทย) จำกัด และ/หรือ ผู้ให้บริการข้อมูล (2) ขอสงวนสิทธิ์ในการลอกเลียน หรือเผยแพร่ (3) ขอสงวนสิทธิ์ที่จะไม่รับผิดชอบต่อความถูกต้อง ครบถ้วน และความเสียหายต่างๆ ที่เกิดขึ้นทุกกรณีจากการนำข้อมูลไปใช้อ้างอิง ผลการดำเนินงานในอดีตมิได้เป็นสิ่งยืนยันผลการดำเนินงานในอนาคต

หนังสือชี้ชวนส่วนสรุปข้อมูลสำคัญ



บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กสิกรไทย จำกัด
ที่อยู่ : 400/22 อาคารธนาคารกสิกรไทย ชั้น 6 และ 12 ถนนพหลโยธิน
แขวงสามเสนใน เขตพญาไท กรุงเทพฯ 10400
โทรศัพท์ : 0 - 2673 - 3888 โทรสาร : 0 - 2673 - 3988
website : www.kasikornasset.com
email : ka.customer@kasikornasset.com

หนังสือยินยอมรับทราบความเสี่ยงจากการลงทุน
กองทุนเปิดเค มัลติ-ตราที่จี บอนด์ ห้ามขายผู้ลงทุนรายย่อย (K-MBOND)

ข้าพเจ้าได้รับทราบและมีความเข้าใจเกี่ยวกับลักษณะ นโยบายการลงทุน กลยุทธ์การลงทุน ความเสี่ยง และผลตอบแทนที่
เกี่ยวข้องกับหน่วยลงทุนของกองทุนเปิดเค มัลติ-ตราที่จี บอนด์ ห้ามขายผู้ลงทุนรายย่อย (K-MBOND) เป็นอย่างดีแล้วว่า

กองทุน K-MBOND จัดเป็นผลิตภัณฑ์ที่มีความเสี่ยงสูงหรือมีความซับซ้อน จึงมีความแตกต่างจากการลงทุนในกองทุนรวมทั่วไป
เนื่องจากกองทุน K-MBOND ลงทุนในกองทุน PrivilEdge – H2O High Conviction Bonds, (EUR), I Class A (กองทุนหลัก) ซึ่ง
ลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเพื่อใช้เป็นส่วนหนึ่งของกลยุทธ์การลงทุนในตราสารหนี้ และเพิ่มฐานะการลงทุนในสินทรัพย์โดยรวม
(Leverage) จึงส่งผลให้กองทุน K-MBOND มีความเสี่ยงมากกว่ากองทุนรวมที่ลงทุนในหลักทรัพย์โดยตรง แม้ว่าการเพิ่มฐานะการ
ลงทุนจากการลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้าจะช่วยเพิ่มโอกาสในการรับผลตอบแทนของกองทุนให้สูงขึ้น แต่กรณีที่ราคาหลักทรัพย์
อ้างอิงมีความผันผวนมาก หรือทิศทางการลงทุนไม่เป็นไปตามที่คาดการณ์ อาจทำให้กองทุนหลักขาดทุนจากการลงทุนในสัญญาซื้อขาย
ล่วงหน้า

นอกจากนี้ กองทุนหลักอาจจำกัดการไถ่ถอนหน่วยลงทุนในกรณีที่ผู้ถือหน่วยลงทุนของกองทุนหลักไถ่ถอนหน่วยลงทุนเกินกว่าร้อยละ
10 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุนหลัก โดยจะเลื่อนคำสั่งขายคืนหน่วยลงทุนบางส่วนให้มีผลในวันทำการถัดไป อย่างไรก็ตาม
บริษัทจัดการได้พิจารณาแล้วว่า ในสถานะตลาดปกติ กองทุนหลักลงทุนในสินทรัพย์ที่มีสภาพคล่องเพียงพอที่จะรองรับการไถ่ถอน
หน่วยลงทุน และบริษัทจัดการมิได้จำกัดการไถ่ถอนหน่วยลงทุนกองทุน K-MBOND แต่อย่างใด

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

สำหรับผู้ซื้อหน่วยลงทุน

หนังสือยินยอมรับทราบความเสี่ยงจากการลงทุน
กองทุนเปิดเค มัลติ-ตราที่จี บอนด์ ห้ามขายผู้ลงทุนรายย่อย (K-MBOND)

ข้าพเจ้าได้รับทราบและมีความเข้าใจเกี่ยวกับลักษณะ นโยบายการลงทุน กลยุทธ์การลงทุน ความเสี่ยง และผลตอบแทนที่
เกี่ยวข้องกับหน่วยลงทุนของกองทุนเปิดเค มัลติ-ตราที่จี บอนด์ ห้ามขายผู้ลงทุนรายย่อย (K-MBOND) เป็นอย่างดีแล้วว่า

กองทุน K-MBOND จัดเป็นผลิตภัณฑ์ที่มีความเสี่ยงสูงหรือมีความซับซ้อน จึงมีความแตกต่างจากการลงทุนในกองทุนรวมทั่วไป
เนื่องจากกองทุน K-MBOND ลงทุนในกองทุน PrivilEdge – H2O High Conviction Bonds, (EUR), I Class A (กองทุนหลัก) ซึ่ง
ลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเพื่อใช้เป็นส่วนหนึ่งของกลยุทธ์การลงทุนในตราสารหนี้ และเพิ่มฐานะการลงทุนในสินทรัพย์โดยรวม
(Leverage) จึงส่งผลให้กองทุน K-MBOND มีความเสี่ยงมากกว่ากองทุนรวมที่ลงทุนในหลักทรัพย์โดยตรง แม้ว่าการเพิ่มฐานะการ
ลงทุนจากการลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้าจะช่วยเพิ่มโอกาสในการรับผลตอบแทนของกองทุนให้สูงขึ้น แต่กรณีที่ราคาหลักทรัพย์
อ้างอิงมีความผันผวนมาก หรือทิศทางการลงทุนไม่เป็นไปตามที่คาดการณ์ อาจทำให้กองทุนหลักขาดทุนจากการลงทุนในสัญญาซื้อขาย
ล่วงหน้า

นอกจากนี้ กองทุนหลักอาจจำกัดการไถ่ถอนหน่วยลงทุนในกรณีที่ผู้ถือหน่วยลงทุนของกองทุนหลักไถ่ถอนหน่วยลงทุนเกินกว่าร้อยละ
10 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุนหลัก โดยจะเลื่อนคำสั่งขายคืนหน่วยลงทุนบางส่วนให้มีผลในวันทำการถัดไป อย่างไรก็ตาม
บริษัทจัดการได้พิจารณาแล้วว่า ในสถานะตลาดปกติ กองทุนหลักลงทุนในสินทรัพย์ที่มีสภาพคล่องเพียงพอที่จะรองรับการไถ่ถอน
หน่วยลงทุน และบริษัทจัดการมิได้จำกัดการไถ่ถอนหน่วยลงทุนกองทุน K-MBOND แต่อย่างใด

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

สำหรับสาขาธนาคารกสิกรไทย หรือผู้สนับสนุนการขายและรับซื้อคืนหน่วยลงทุน