



รายงานการปรับน้ำหนักพอร์ตการลงทุนของกองทุน K-SGM

ณ วันที่ 8 ตุลาคม 2563

- ความผันผวนของพันธบัตรรัฐบาล ตราสารหนี้เอกชนและหุ้นตลาดพัฒนาแล้วลดลงอย่างต่อเนื่องตามความชันของ Yield Curve ที่ปรับเพิ่มขึ้นเล็กน้อยเนื่องจากตลาดมีความเชื่อมั่นว่าพรรคเดโมแครตจะชนะการเลือกตั้ง และความคาดหวังต่อมาตรการกระตุ้นเศรษฐกิจเพิ่มเติมในปี 2564 ส่วนความผันผวนของหุ้นตลาดเกิดใหม่ ทรงตัว โมเดลจึงแนะนำให้เพิ่มสัดส่วนการลงทุนในตราสารหนี้ และหุ้นตลาดพัฒนาแล้ว
- กองทุนเพิ่มสัดส่วนพันธบัตรรัฐบาล +4.51% Credit +1.59% หุ้นตลาดพัฒนาแล้ว +0.17% และลดสัดส่วนเงินสด -6.25%

ประเภทสินทรัพย์	น้ำหนักก่อนปรับสัดส่วน (Current Allocation)	น้ำหนักหลังปรับสัดส่วน (New Allocation)	การเปลี่ยนแปลง
พันธบัตรรัฐบาล	44.90%	49.41%	+4.51%
ตราสารหนี้เอกชน	12.40%	13.99%	+1.59%
หุ้นกลุ่มประเทศพัฒนาแล้ว	6.12%	6.29%	+0.17%
หุ้นกลุ่มประเทศเกิดใหม่	3.35%	3.34%	-0.01%
เงินสด	33.23%	26.98%	-6.25%

ที่มา: Lombard Odier (ข้อมูล ณ 8 ตุลาคม 2563)