

กองทุนเปิดดัชนีพันธบัตรไทยเอบีเอฟ

ABFTH

ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมตราสารหนี้ / กองทุนรวมอีทีเอฟ / กองทุนรวมดัชนี
- กลุ่ม Long Term General Bond

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- ลงทุนส่วนใหญ่ในตราสารหนี้สกุลเงินบาทที่ออกโดยภาครัฐไทย รัฐวิสาหกิจ องค์กรของรัฐบาลไทย องค์กรที่จัดตั้งโดยรัฐบาลไทย รัฐบาลประเทศสมาชิก EMEAP หรือองค์กรระหว่างประเทศ หรือตราสารอื่นๆ ที่เป็นส่วนประกอบดัชนีอ้างอิง เพื่อสร้างผลตอบแทนให้ใกล้เคียงกับดัชนี iBoxx ABF Thailand (Net of Tax) (ดัชนีอ้างอิง)
- มุ่งหวังให้ผลประกอบการเคลื่อนไหวตามดัชนีชี้วัด (passive management/index tracking)

ระดับความเสี่ยง

ต่ำ 1 2 3 4 5 6 7 8 สูง

ความเสี่ยงปานกลางค่อนข้างต่ำ

ลงทุนในพันธบัตรรัฐบาลหรือพันธบัตร ธพท. รวมกันไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน	23 ก.พ. 49
นโยบายการจ่ายเงินปันผล	จ่าย ปีละไม่เกิน 2 ครั้ง (รอบการพิจารณาทุกสิ้นเดือน พ.ค. และ พ.ย.)
อายุกองทุน	ไม่กำหนด

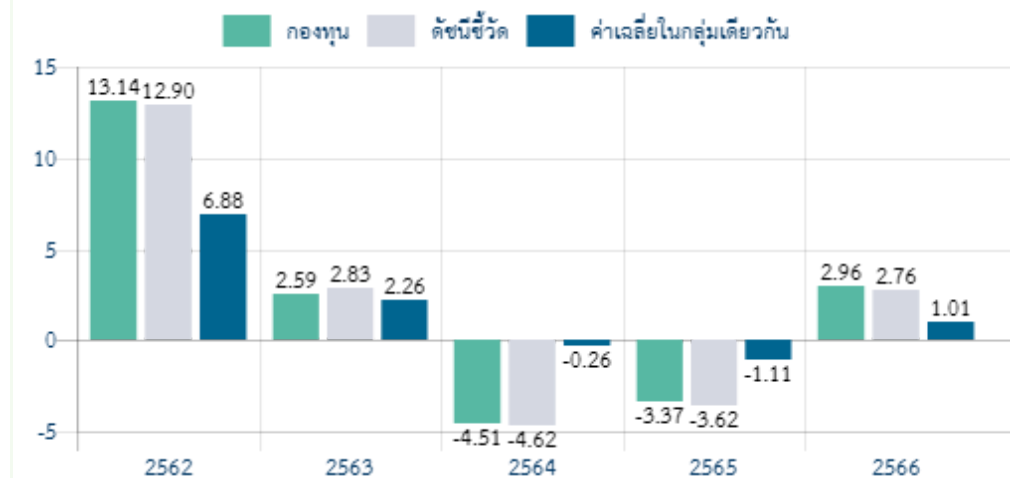
ผู้จัดการกองทุนรวม

นาย สารัช อรุณากร (ตั้งแต่ 4 ม.ค. 64)
นาง สลิลสิริ เรืองสุขอุดม (ตั้งแต่ 1 ก.พ. 67)

ดัชนีชี้วัด :

1. iBoxx ABF Thailand (Net of Tax) Index (100.00%)

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (% ต่อปี)



ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด (%)

	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี *
กองทุน	2.50	2.50	6.06	2.08
ดัชนีชี้วัด	2.45	2.45	5.94	1.81
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	1.33	1.33	3.21	1.02
ความผันผวนกองทุน	1.94	1.94	2.79	2.51
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	1.94	1.94	2.81	2.52
	3 ปี *	5 ปี *	10 ปี *	ตั้งแต่จัดตั้ง *
กองทุน	0.94	2.23	3.11	4.01
ดัชนีชี้วัด	0.69	2.12	3.13	4.11
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	1.26	1.81	2.32	N/A
ความผันผวนกองทุน	3.23	3.58	2.91	3.91
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	3.30	3.55	2.86	3.84

หมายเหตุ : * % ต่อปี

คำเตือน:

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวม มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต : ได้รับการรับรองจาก CAC

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

ผู้ลงทุนสามารถศึกษา
เครื่องมือบริหารความเสี่ยง
ด้านสภาพคล่องได้ใน
หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



การซื้อหน่วยลงทุน

วันทำการซื้อ : ทุกวันทำการ

เวลาทำการ : 08:30 น. - 15:30 น.

การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ : ดูรายละเอียดเพิ่มเติม

การซื้อครั้งถัดไปขั้นต่ำ : ดูรายละเอียดเพิ่มเติม

หมายเหตุ : บริษัทจัดการได้กำหนดจำนวนหน่วยลงทุนขั้นต่ำในการสั่งซื้อ/รับซื้อคืนหน่วยลงทุนของผู้ลงทุนรายใหญ่ในแต่ละกลุ่มไว้ดังนี้

(1) ผู้ร่วมค้าหน่วยลงทุน 1 หน่วยซื้อหรือหน่วยรับซื้อคืน (2) ผู้ดูแลสภาพคล่องในตลาดรอง 1 หน่วยซื้อหรือหน่วยรับซื้อคืน (3) EMEAP 1 หน่วยซื้อหรือหน่วยรับซื้อคืน

ผู้ลงทุนทั่วไปสามารถซื้อ/ขายคืนหน่วยลงทุนกับผู้ลงทุนรายใหญ่ หรือในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย

การขายคืนหน่วยลงทุน

วันทำการขายคืน : ทุกวันทำการ

เวลาทำการ : 08:30 น. - 15:30 น.

การขายคืนขั้นต่ำ : ดูรายละเอียดเพิ่มเติม

ยอดคงเหลือขั้นต่ำ : ไม่กำหนด

ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน : T+2

(ประกาศ NAV T+1)

ข้อมูลเชิงสถิติ

Maximum Drawdown	-16.56 %
Recovering Period	N/A
FX Hedging	ยังไม่มีการลงทุนในต่างประเทศ
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน	0.28 เท่า
Tracking Error	0.19 %
อายุเฉลี่ยของตราสารหนี้	8 ปี 9.48 เดือน
Yield to Maturity	2.92% ต่อปี

การจัดสรรการลงทุนในต่างประเทศ

ประเทศ	% NAV
ไทย	100.00

การจัดสรรการลงทุนในผู้ออกตราสาร 5 อันดับแรก

ผู้ออก	% NAV
กระทรวงการคลัง	85.42
บมจ.ปตท.	7.45
ธ.เพื่อการเกษตรและสหกรณ์การเกษตร	3.04
การรถไฟแห่งประเทศไทย	1.73
องค์การขนส่งมวลชนกรุงเทพ	1.04

การจัดสรรการลงทุนตามอันดับความน่าเชื่อถือ (%)

	ในประเทศ	National	International
Gov Bond/AAA	99.99		
AA			0.03

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	1.0700	0.1070
รวมค่าใช้จ่าย	2.5680	0.3505

หมายเหตุ : ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะ หรือภาษีอื่นใดแล้ว

- บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริง เพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การขาย	ไม่มี	ไม่มี
การรับซื้อคืน	ไม่มี	ไม่มี
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า	ดูหมายเหตุ	
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก	ดูหมายเหตุ	
การโอนหน่วย	ตามที่เก็บจริง	ไม่เรียกเก็บ

หมายเหตุ : ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะ หรือภาษีอื่นใดแล้ว

- บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริง เพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ

- กองทุนไม่เปิดให้มีการสับเปลี่ยนหน่วยลงทุน

- ค่าธรรมเนียมอื่นๆ : Dilution Fee ซึ่งได้แก่

1. ค่าธรรมเนียมที่เกิดขึ้นจากการที่กองทุนอาจต้องซื้อหรือขายหลักทรัพย์ ในอัตราไม่เกิน 1.0% ของมูลค่าหน่วยลงทุน (เก็บจริง 0.2% ของมูลค่าหน่วยลงทุน) กองทุนโดยบริษัทจัดการจะเรียกเก็บค่าธรรมเนียมดังกล่าวจากผู้ถือหน่วยลงทุนเมื่อมีการสั่งซื้อหน่วยลงทุนหรือหักจากมูลค่าหน่วยลงทุนที่บริษัทจัดการต้องชำระให้กับผู้ถือหน่วยลงทุนเมื่อมีการส่งขายคืนหน่วยลงทุน

2. ค่าธรรมเนียมที่เกิดขึ้นจากการที่กองทุนอาจต้องรับซื้อคืนหน่วยลงทุนเมื่อผู้ถือหน่วยลงทุนส่งขายคืนหน่วยลงทุนกับบริษัทจัดการในวันทำการรับซื้อคืนพิเศษ ทั้งนี้ กองทุนโดยบริษัทจัดการจะหักค่าธรรมเนียมดังกล่าวจากมูลค่าหน่วยลงทุนที่บริษัทจัดการต้องชำระให้กับผู้ถือหน่วยลงทุน ในระยะแรกกองทุนจะเรียกเก็บค่าธรรมเนียมดังกล่าวในอัตราร้อยละ 5.0 ของมูลค่าหน่วยลงทุน

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน

ประเภททรัพย์สิน	% NAV	ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก	% NAV
พันธบัตร	91.50	พันธบัตร (LB31DA)	5.00
หุ้นกู้	8.48	พันธบัตร (LB276A)	4.69
เงินฝาก	0.03	พันธบัตร (LB29DA)	4.53
อื่นๆ	-0.02	พันธบัตร (LB386A)	3.89
		พันธบัตร (ESGLB35DA)	3.83

คำอธิบาย

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

Recovering Period ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาตั้งแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินลงทุนเริ่มต้นใช้เวลานานเท่าใด

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 สูงกว่าจะเป็นกองทุนที่มีประสิทธิภาพในการบริหารจัดการกองทุนที่ดีกว่า 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 2024 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
website : www.kasikornasset.com
email : ka.customer@kasikornasset.com