

กองทุนเปิดกรุงไทย ซีเล็คทีฟ อีควิตี้ ฟันด์
Krung Thai Selective Equity Fund

KTSE

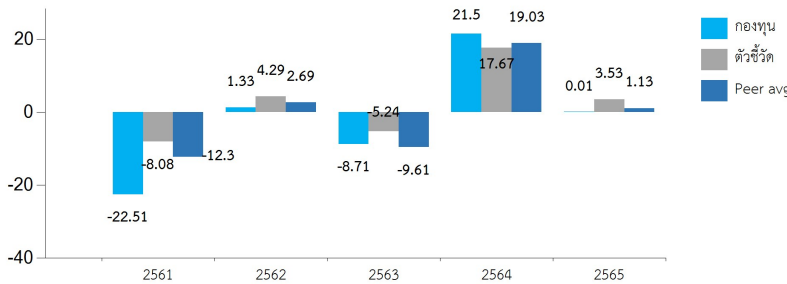
ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมตราสารแห่งทุน
- กองทุนที่ลงทุนแบบไม่มีความเสี่ยงต่างประเทศ
- กลุ่ม Equity General

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- ลงทุนในหุ้นที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยที่มีปัจจัยพื้นฐานดี รวมทั้งลงทุนในตราสารแห่งหนี้ และหรือเงินฝาก ตราสารกึ่งหนี้กึ่งทุน ตลอดจนหลักทรัพย์และทรัพย์สินอื่น หรือการหาผลตอบแทนโดยวิธีอื่นอย่างใดอย่างหนึ่งหรือหลายอย่าง ทั้งนี้ ตามที่สำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ต. กำหนด
- ทั้งนี้ บริษัทจะลงทุนในตราสารทุน จำนวนไม่เกิน 30 หลักทรัพย์ ซึ่งคิดเป็นอัตราส่วนโดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชี ไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของ NAV โดยจะประกาศรายชื่อหลักทรัพย์ที่ลงทุนอย่างน้อยเดือนละ 1 ครั้ง พร้อมทั้งเหตุผลในการลงทุน
- มุ่งหวังให้ผลประกอบการสูงกว่าดัชนีชี้วัด (active management)

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (%ต่อปี)



ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด

	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี*
กองทุน	-7.75	-0.22	-5.10	-3.97
ดัชนีชี้วัด	-9.56	-1.40	-7.04	-4.86
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	-8.22	-0.11	-4.59	-3.54
ความผันผวนกองทุน	9.76	8.62	9.24	9.57
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	11.25	10.20	10.94	10.84
	3 ปี*	5 ปี*	10 ปี*	ตั้งแต่จัดตั้ง*
กองทุน	7.34	-1.53	0.47	7.50
ดัชนีชี้วัด	8.95	-0.54	3.78	8.51
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	7.54	-1.81	2.01	
ความผันผวนกองทุน	11.53	15.41	15.35	19.86
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	12.85	16.69	14.68	18.99

หมายเหตุ : * % ต่อปี

ระดับความเสี่ยง



กองทุนรวมตราสารทุน ที่มี net exposure ในตราสารทุนเป็นหลักโดยเฉลี่ยรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน 22/10/46

วันเริ่มต้น class N/A

นโยบายการจ่ายเงินปันผล มี

อายุกองทุน ไม่กำหนดอายุโครงการ

ผู้จัดการกองทุนรวม

นาย ยืนยง เทพจำนงค์ ตั้งแต่ 05/06/61

ดัชนีชี้วัด

ดัชนีผลตอบแทนรวมตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET TRI) สัดส่วน 100

คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวม มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต : ได้รับการรับรองจาก CAC

จัดอันดับกองทุน



Morningstar® Sustainability Rating™



ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือบริหาร

ความเสี่ยงด้านสภาพคล่องได้ในหนังสือ

ชวนฉบับเต็ม

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม


www.ktam.co.th

การซื้อหน่วยลงทุน	การขายคืนหน่วยลงทุน
วันทำการซื้อ : ทุกวันทำการ	วันทำการขายคืน : ทุกวันทำการ
เวลาทำการ : 8:30 - 15:30	เวลาทำการ : 8:30 - 15:30
การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ : 1,000 บาท	การขายคืนขั้นต่ำ : ไม่กำหนด
การซื้อครั้งถัดไปขั้นต่ำ : 1,000 บาท	ยอดคงเหลือขั้นต่ำ : ไม่กำหนด
	ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน : T+3 คือ 3 วันทำการหลังจากวันทำรายการขายคืน

หมายเหตุ :

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)		
ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	1.07	1.07
รวมค่าใช้จ่าย	3.10	1.22

หมายเหตุ : * เป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะ หรือภาษีอื่นใดในทำนองเดียวกัน **รวมค่าใช้จ่าย (เก็บจริง) เป็นของรอบปีบัญชีที่ผ่านมา

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)		
ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การขาย	0.25	0.25
การรับซื้อคืน	0.25	ยังไม่เรียกเก็บ
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า	ไม่มี	ไม่มี
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก	ไม่มี	ไม่มี
การโอนหน่วย	ดูหมายเหตุเพิ่มเติม	ดูหมายเหตุเพิ่มเติม

หมายเหตุ : * เป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะ หรือภาษีอื่นใดในทำนองเดียวกัน **ในกรณีที่คิดค่าธรรมเนียมรับซื้อคืนหน่วยลงทุน บริษัทจัดการจะแจ้งให้ผู้ถือหน่วยลงทุนทราบล่วงหน้าไม่น้อยกว่า 30 วัน โดยจะติดประกาศ ณ ที่ทำการของบริษัทจัดการและผู้สนับสนุนการขายหรือรับซื้อคืน และลงประกาศในหนังสือพิมพ์รายวันอย่างน้อย 1 ฉบับ *** ค่าธรรมเนียมการโอนหน่วยลงทุน ตามที่นายทะเบียนเรียกเก็บ

ข้อมูลเชิงสถิติ	
Maximum Drawdown	-36.31 %
Recovering Period	1 ปี 7 เดือน
FX Hedging	N/A
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน	2.65 เท่า
Sharpe Ratio	0.63
Alpha	-1.61
Beta	0.82

การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม	
กลุ่มอุตสาหกรรม	% NAV
บริการ	25.45
ทรัพยากร	20.14
เทคโนโลยี	13.91
ธุรกิจการเงิน	13.62
อสังหาริมทรัพย์และก่อสร้าง	7.24

หมายเหตุ :

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน

ทรัพย์สิน	% NAV
หุ้นสามัญ	83.32
เงินฝากธนาคาร	16.68

หมายเหตุ :

ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก

ทรัพย์สิน	% NAV
บมจ. ซีพี ออลล์	6.40
บมจ. กัลฟ์ เอ็นเนอร์จี ดีเวลลอปเม้นท์	6.11
บมจ. ปตท. สำรวจและผลิตปิโตรเลียม	5.98
บมจ. ท่าอากาศยานไทย	5.97
บมจ. แอตวานซ์ อินโฟร์ เซอร์วิส	5.64

หมายเหตุ :

คำอธิบาย

Maximum Drawdown เปรอ์เซ็นต์ผลขาดทุนสูงสุดของกองทุนรวมในระยะเวลา 5 ปีย้อนหลัง (หรือตั้งแต่จัดตั้งกองทุนกรณีที่ยังไม่ครบ 5 ปี) โดยวัดจากระดับ NAV ต่อหน่วยที่จุดสูงสุด ไปจนถึงจุดต่ำสุดในช่วงที่ NAV ต่อหน่วยปรับตัวลดลงค่า Maximum Drawdown เป็นข้อมูลที่ช่วยให้ทราบถึงความเสี่ยงที่อาจขาดทุนจากการลงทุนในกองทุนรวม

Recovering Period ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาตั้งแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลานานเท่าใด

FX Hedging เปรอ์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตลงทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลาหนึ่ง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์กับ ผลรวมของมูลค่าการขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 1 ปีหารด้วยมูลค่า NAV ของกองทุนรวมเฉลี่ยในรอบระยะเวลาเดียวกัน กองทุนรวมที่มีค่า portfolio turnover สูง 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 หลักทรัพย์ ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนมากกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด

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

Yield to Maturity อัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในตราสารหนี้โดยถือจนครบกำหนดอายุ ซึ่งคำนวณจากดอกเบี้ยที่ได้รับในอนาคตตลอดอายุตราสารและเงินต้นที่จะได้รับคืน นำมาคิดลดเป็นมูลค่าปัจจุบัน โดยใช้วัดอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมตราสารหนี้ คำนวณจากค่าเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักของ Yield to Maturity ของตราสารหนี้แต่ละตัวที่กองทุนมีการลงทุน และเนื่องจาก Yield to Maturity มีหน่วยมาตรฐานเป็นเปอร์เซ็นต์ต่อปีจึงสามารถนำไปใช้เปรียบเทียบอัตราผลตอบแทนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีนโยบายถือครอง ตราสารหนี้จนครบกำหนดอายุและมีลักษณะการลงทุนที่ใกล้เคียงกันได้

ข้อมูล Morningstar Rating ณ วันที่ 30/09/2566

ข้อมูล Morningstar Sustainability Rating ณ วันที่ 31/08/2566

© สงวนลิขสิทธิ์ 2566 บริษัท มอร์นิ่งสตาร์ รีเสิร์ช ประเทศไทย ข้อมูลนี้ (1) เป็นกรรมสิทธิ์ของบริษัทมอร์นิ่งสตาร์ และ/หรือ ผู้ให้บริการข้อมูล (2) ขอสงวนสิทธิ์ในการลอกเลียน หรือเผยแพร่ (3) ขอสงวนสิทธิ์ที่จะไม่รับผิดชอบต่อความถูกต้อง ครบถ้วน และความเสียหายต่างๆ ที่เกิดขึ้นทุกกรณีจากการนำข้อมูลไปใช้อ้างอิง, ผลการดำเนินงานในอดีตมิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต.

คะแนนในส่วนของ Corporate Sustainability Score, Sovereign Sustainability Score และสโตร์การลงทุนเป็นข้อมูล ณ วันที่ 31/08/2566

มอร์นิ่งสตาร์ได้มีการนำข้อมูลความยั่งยืนของบริษัทหรือประเทศที่วิเคราะห์โดย Sustainalytics มาใช้ในการคำนวณ Sustainability Score

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงไทย จำกัด (มหาชน)

โทรศัพท์ 0-2686-6100 แฟกซ์ 0-2670-0430 www.ktam.co.th

เลขที่ 1 อาคารเอ็มไพร์ทาวเวอร์ ชั้น 32 ถนนสาทรใต้ แขวงยานนาวา เขตสาทร กรุงเทพมหานคร 10120