

# สรุป ผลการดำเนินงานของนโยบายการลงทุนใน กช. เค มาสเตอร์ พูล ฟันด์ ณ 31 พฤษภาคม 2560

## 7. ลงทุนในหน่วยลงทุน

ที่มีนโยบายลงทุนในต่างประเทศ

(เริ่มบริหาร 1 ต.ค. 2559)

สินทรัพย์สุทธิ 6.81 ล้านบาท

นายจ้าง 5 บริษัท

ผลตอบแทนกองทุน ม.ค. - พ.ค. 60 = 3.85%



ข้อจำกัดการลงทุนของกองทุน โดยมีรายละเอียดดังต่อไปนี้  
 ลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมที่มีนโยบายลงทุนในต่างประเทศโดยเฉลี่ยในรอบปี  
 บัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของนโยบายการลงทุน

ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุน มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

สัดส่วนการลงทุนในกองทุนต่างประเทศ (% ของเงินลงทุน)			
ISHARES MSCI ACWI INDEX FUND			40.01%
SPDR S&P 500 ETF			21.70%
MSCI ALL CTY WRLD MIN ETF			8.50%
SPDR EURO STOXX 50 ETF			6.63%
ISHARES MSCI JAPAN ETF			6.31%
ISHARES MSCI ALL COUNTRY ASIA EX-JAPAN INDEX FUND			6.20%
POWERSHARES QQQ NASDAQ 100			4.47%
HANG SENG H-SHARE INDEX ETF (HSIM)			1.99%
ISHARES MSCI PHILIPPINES INVSTABLE MARKET INDEX FUND (USD) (BLACKF)			1.02%
ISHARES MSCI UNITED KINGDOM ETF (BLACKROCK)			0.48%
Regional Breakdown (% of NAV)		K-GLOBE	Benchmark
USA and North America	52.59%	56.97%	Underweight
Europe	14.68%	14.58%	Overweight
Asia-Pacificex Japan	13.63%	11.49%	Overweight
Japan	9.84%	7.84%	Overweight
United Kingdom	4.44%	5.88%	Underweight
Cash	3.98%	0.00%	Overweight
Latin america	0.60%	1.40%	Underweight
Emerging Middle East	0.24%	1.84%	Underweight
หมายเหตุ : ข้อมูลจากบริษัทจัดการ ณ วันที่ 28 เมษายน 2560			

ผลการดำเนินงาน (%)								
Global Equity	ผลการดำเนินงานย้อนหลัง ณ วันที่ 28 เม.ย. 60*							
	% ตามช่วงเวลา		% ต่อปี					ตั้งแต่จัดตั้ง
	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี	3 ปี	5 ปี	10 ปี		
กองทุนรวม	3.53%	7.70%	11.33%	6.77%	8.79%	2.09%	3.23%	
Benchmark	3.38%	9.53%	11.82%	5.60%	9.32%	1.48%	2.27%	
Information Ratio <sup>2</sup>	0.04	-1.89	-0.16	0.33	-0.12	0.06	0.12	
ความผันผวนของ ผลการดำเนินงาน	7.15%	8.17%	11.09%	12.68%	12.20%	16.78%	16.33%	

\* วันที่ทำการสุดท้ายของเดือน หากตรงกับวันหยุดให้ใช้วันที่ทำการก่อนหน้า  
<sup>2</sup> Information Ratio : แสดงความสามารถของผู้จัดการกองทุนในการสร้างผลตอบแทนเมื่อเทียบกับความเสี่ยง ผู้ลงทุนสามารถดูข้อมูลที่เป็นปัจจุบันได้ที่ Website: www.kasikornasset.com

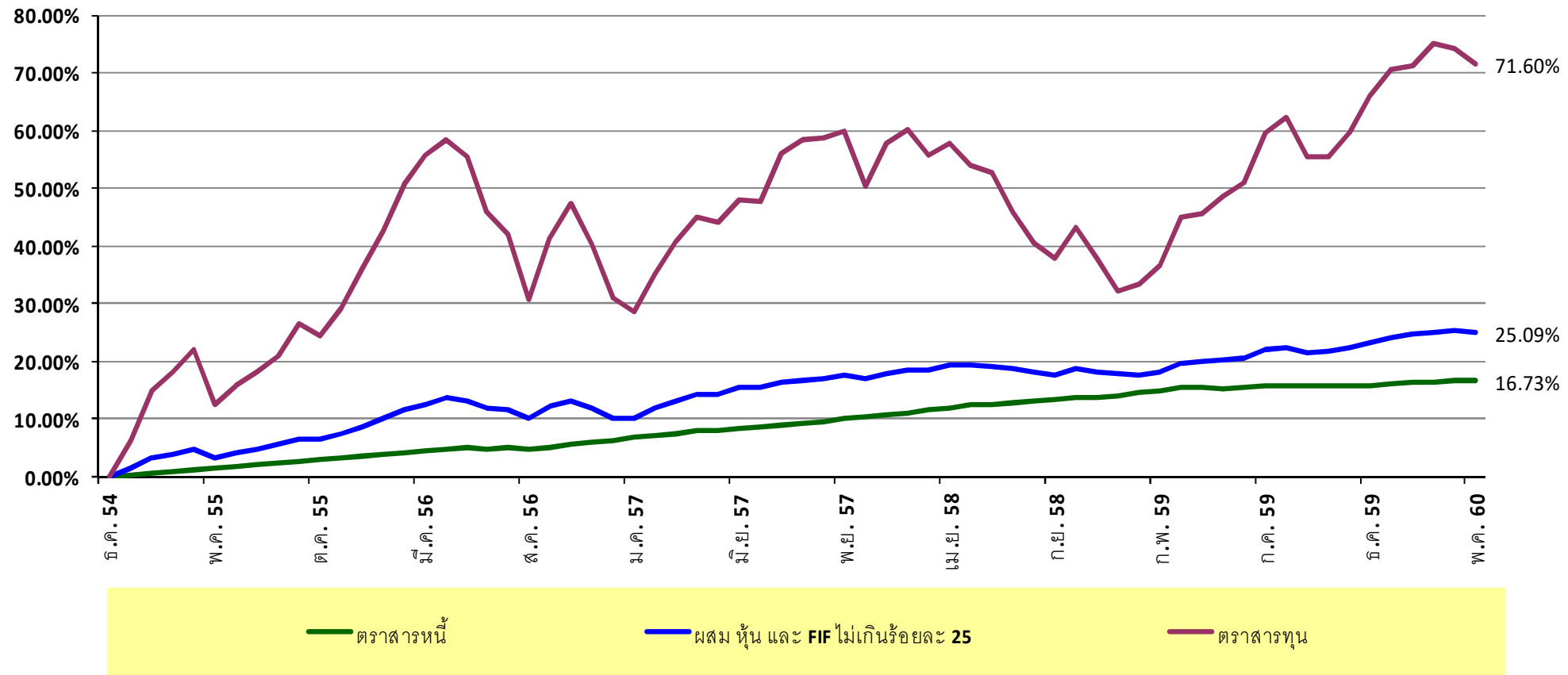
ผลการดำเนินงาน (คำนวณตามปีปฏิทิน)

ปี	Fund (%)	Benchmark (%)
2555	3.53%	3.38%
2556	7.70%	9.53%
2557	11.33%	11.82%
2558	6.77%	5.60%
2559	8.79%	9.32%

\*ผลการดำเนินงานในอดีต มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต\*



การเปลี่ยนแปลงของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิต่อหน่วย ระยะเวลา 5 ปี 5 เดือน (2555 – พฤษภาคม 2560)



บริการทุกระดับประทับใจ



# นโยบายการลงทุน K Master Pooled Fund



# นโยบายการลงทุน K Master Pooled Fund

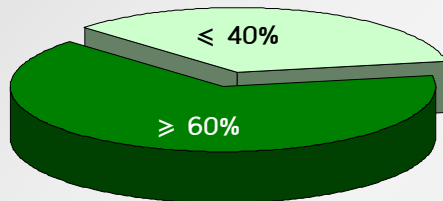
## ตราสารหนี้



## กช.เค มาสเตอร์ พูล ฟันด์ - ตราสารหนี้

### นโยบายการลงทุน\*

ตราสารหนี้ภาคเอกชน อาทิ  
- หุ้นกู้ ตัวแลกเปลี่ยน บริษัทเอกชน



เงินฝาก ตราสารหนี้ภาครัฐ

และสถาบันการเงิน อาทิ

- พันธบัตรรัฐบาล รัฐวิสาหกิจ
- ตัวเงินคลัง
- ตราสารหนี้ของธนาคาร  
และสถาบันการเงิน

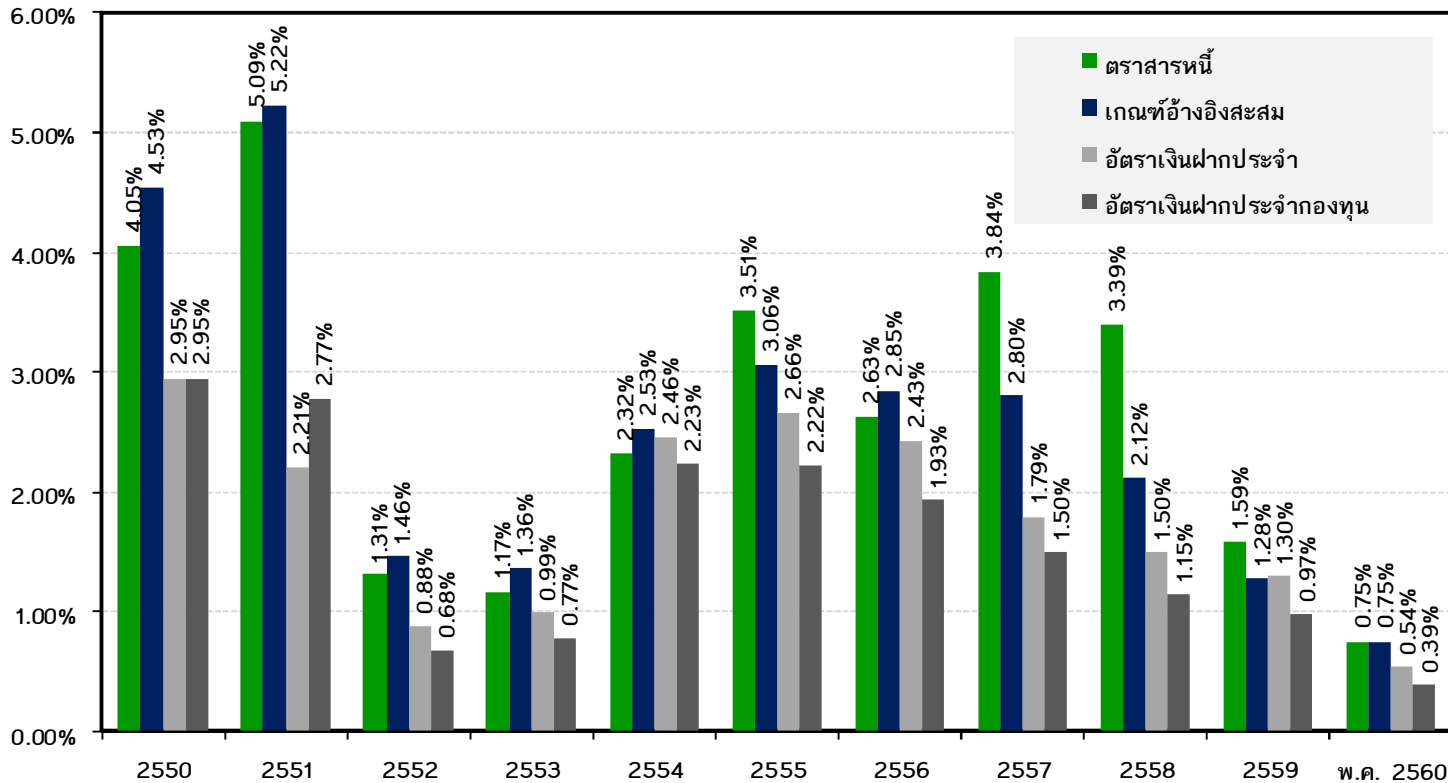
\* แผนการลงทุนอาจมีการเปลี่ยนแปลงได้ตามสภาวะตลาด  
ภายใต้กรอบของสัญญา

### รายละเอียดการลงทุน

ณ 31 พฤษภาคม 2560	%
พันธบัตร ตัวเงินคลัง หรือ พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย	19.47%
เงินฝากในธนาคารพาณิชย์ หรือธนาคารอื่นที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้น	16.51%
บัตรเงินฝากที่ธนาคารพาณิชย์เป็นผู้ออก	8.21%
ตราสารแห่งหนี้ที่ธนาคารเป็นผู้ออก	15.68%
ตราสารแห่งหนี้ที่รัฐวิสาหกิจตามกฎหมายว่าด้วยวิธีการงบประมาณ	0.01%
ตราสารแห่งหนี้ที่บริษัทจำกัดเป็นผู้ออก	38.69%
<b>รวม</b>	<b>98.57%</b>



## อัตราผลตอบแทน



### สถานะภาพของกองทุน ณ 31 พ.ค. 60

ยอดสินทรัพย์รวม	12,136.20	ล้านบาท
จำนวนพนักงาน	67,437	คน
จำนวนนายจ้าง	930	บริษัท

### อัตราผลตอบแทนสะสมสุทธิ

ม.ค. - พ.ค. 60 = 0.75%

### \*\*อัตราอ้างอิงผลการดำเนินงานของกองทุนสะสม

ม.ค. - พ.ค. 60 = 0.75%

\*อัตราอ้างอิงผลการดำเนินงานกองทุน : 50% ของอัตราดอกเบี้ยเงินฝากประจำ 1 ปีที่กองทุนสำรองเลี้ยงชีพพึงได้รับ วงเงิน 1 ล้านบาท เฉลี่ยของ BBL, SCB, KBANK, KTB + 50% ของดัชนีอัตราผลตอบแทนของการลงทุนในพันธบัตรรัฐบาลที่มีอายุคงที่ของสมาคมตราสารหนี้ไทย อายุ 2 ปี



# นโยบายการลงทุน K Master Pooled Fund

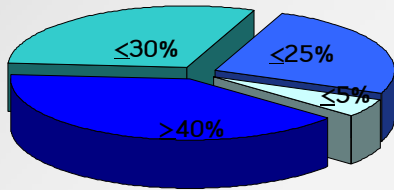
ผสมหุ้น และ FIF ไม่เกิน 25 %



## กช.เค มาสเตอร์ พูล ฟันด์ - ผสม หุ้น และ FIF ไม่เกินร้อยละ 25

### นโยบายการลงทุน\*

ตราสารหนี้ภาคเอกชน อาทิ  
- หุ้นกู้ ตัวแลกเปลี่ยน  
บริษัทเอกชน



เงินฝาก ตราสารหนี้ภาครัฐ  
และสถาบันการเงิน อาทิ  
- พันธบัตรรัฐบาล รัฐวิสาหกิจ  
- ตัวเงินคลัง  
- ตราสารหนี้ของธนาคาร  
สถาบันการเงิน

ตราสารทุน อาทิ  
- หุ้นสามัญ หุ้นบุริมสิทธิ  
- หน่วยลงทุน  
- FIF กองทุนรวมตราสาร  
แห่งทุนและกองทุนรวมผสม

สินทรัพย์ทางเลือก  
อาทิ กองทุนรวม  
อสังหาริมทรัพย์,  
กองทุนรวม  
โครงสร้างพื้นฐาน,  
กองทุนรวมทองคำ

\* แผนการลงทุนอาจมีการเปลี่ยนแปลงได้ตามสภาวะตลาด  
ภายใต้กรอบของสัญญา

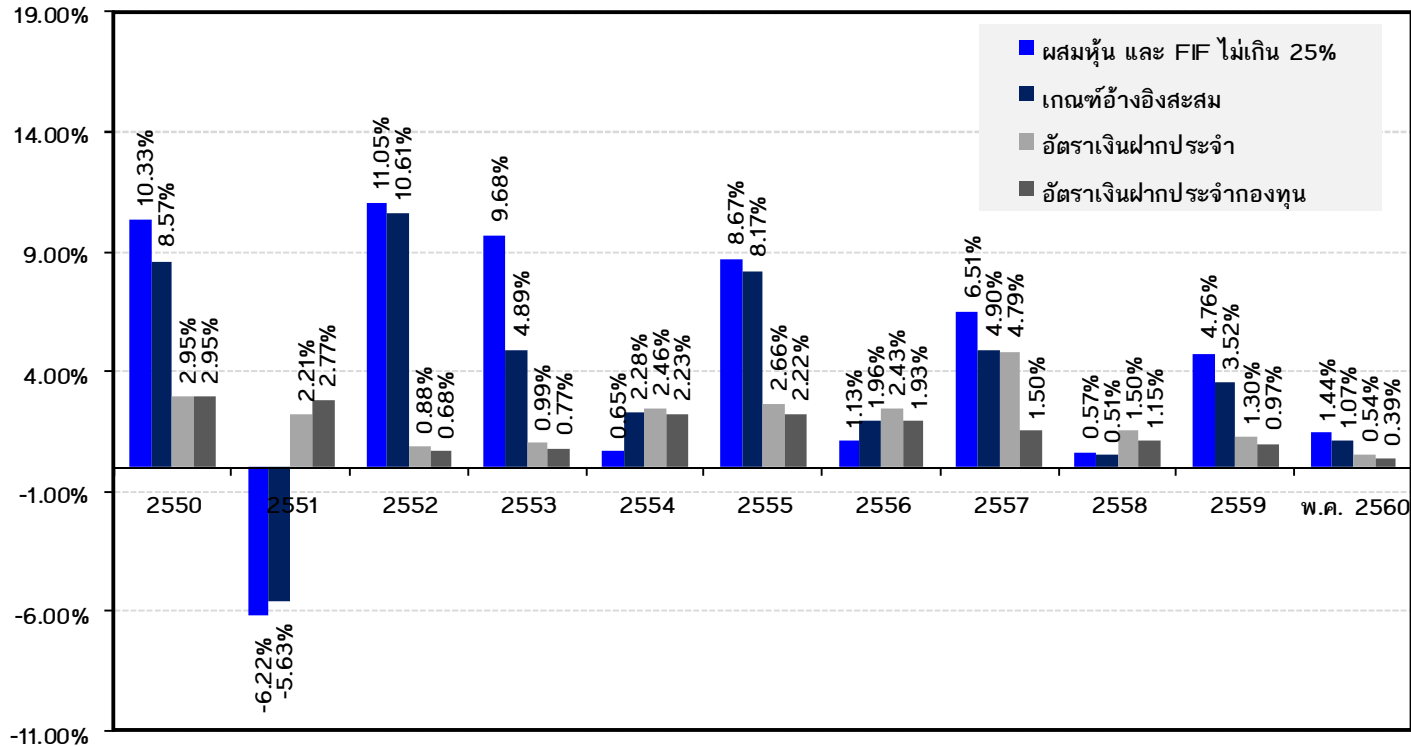
### รายละเอียดการลงทุน

ณ 31 พฤษภาคม 2560	%
พันธบัตร ตัวเงินคลัง หรือ พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย	30.58%
เงินฝากในธนาคารพาณิชย์ หรือธนาคารอื่นที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้น	16.48%
บัตรเงินฝากที่ธนาคารพาณิชย์เป็นผู้ออก	8.13%
ตราสารแห่งหนึ่งที่ธนาคารเป็นผู้ออก	7.38%
ตราสารแห่งหนึ่งที่บริษัทจำกัดเป็นผู้ออก	16.60%
ตราสารแสดงสิทธิในหน่วยลงทุนและใบสำคัญแสดงสิทธิที่จะซื้อหน่วยลงทุน	6.43%
หุ้นและใบสำคัญแสดงสิทธิที่จะซื้อหุ้น	17.07%
<b>รวม</b>	<b>102.67%</b>





## อัตราผลตอบแทน



### สถานะภาพของกองทุน ณ 31 พ.ค. 60

ยอดสินทรัพย์รวม	1,434.37	ล้านบาท
จำนวนพนักงาน	5,916	คน
จำนวนนายจ้าง	270	บริษัท

### อัตราผลตอบแทนสะสมสุทธิ

ม.ค. - พ.ค. 60 = 1.44%

### \*\*อัตราอ้างอิงผลการดำเนินงานของกองทุนสะสม

ม.ค. - พ.ค. 60 = 1.07%

### \* อัตราอ้างอิงผลการดำเนินงานกองทุน :

16.25% SET Index + 40.50% ของอัตราดอกเบี้ยเงินฝากประจำ 1 ปี ที่กองทุนสำรองเลี้ยงชีพพึงได้รับ วงเงิน 1 ล้านบาท เฉลี่ยของ BBL, SCB, KBANK, KTB + 40.5% ของดัชนีอัตราผลตอบแทนของการลงทุนในพันธบัตรรัฐบาลที่มีอายุคงที่ของสมาคมตราสารหนี้ไทย อายุ 2 ปี + 1.25% MSSB + 1.5% MSCI\_ACWI



# นโยบายการลงทุน K Master Pooled Fund

ตราสารทุน

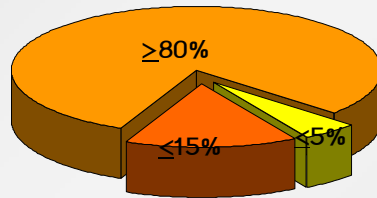


## กช.เค มาสเตอร์ พูล ฟันด์ – ตราสารทุน

### นโยบายการลงทุน\*

ตราสารทุน อาทิ

- หุ้นสามัญ หุ้นบุริมสิทธิ
- หน่วยลงทุน



เงินฝาก ตราสารหนี้ภาครัฐ

และสถาบันการเงิน อาทิ

- พันธบัตรรัฐบาล รัฐวิสาหกิจ
- ตั๋วเงินคลัง
- ตราสารหนี้ของธนาคาร  
สถาบันการเงิน

สินทรัพย์ทางเลือก

อาทิ กองทุนรวม  
อสังหาริมทรัพย์, กองทุน  
รวมโครงสร้างพื้นฐาน,  
กองทุนรวมทองคำ

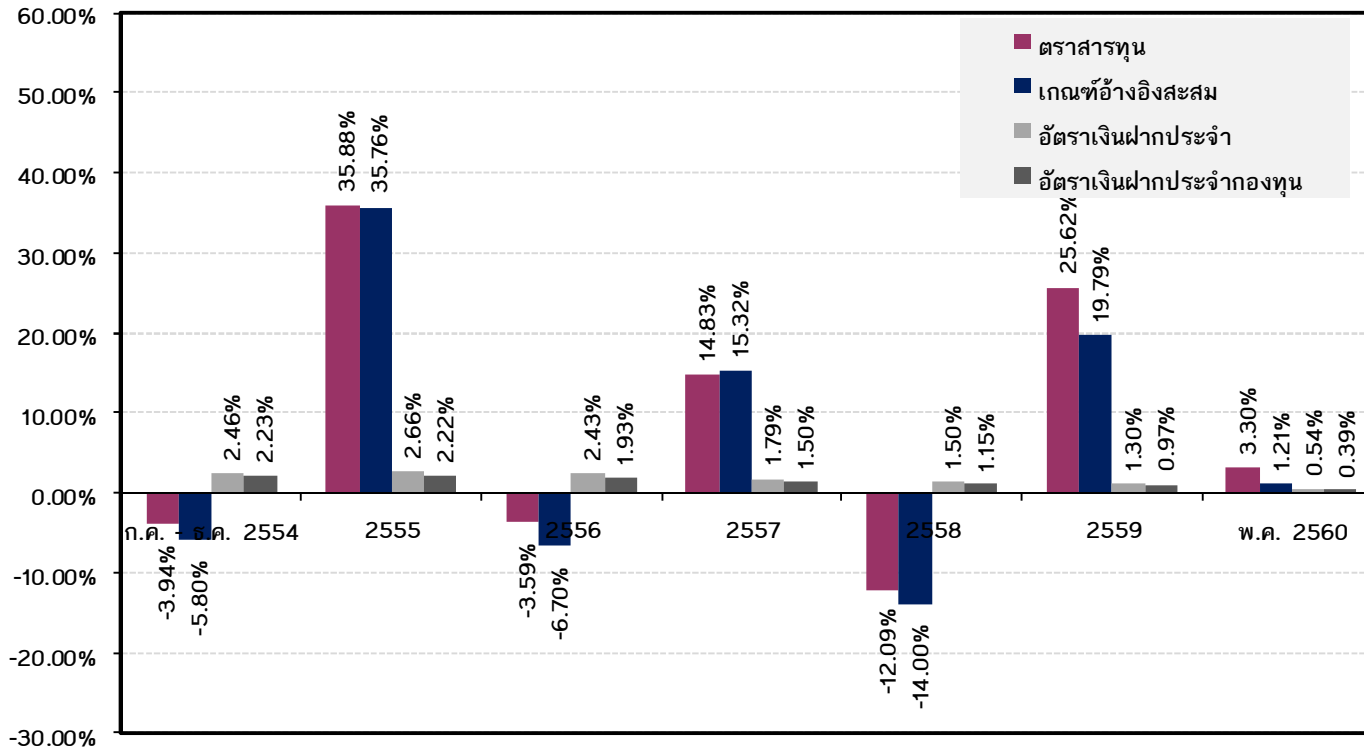
\* แผนการลงทุนอาจมีการเปลี่ยนแปลงได้ตามสภาวะตลาด  
ภายใต้กรอบของสัญญา

### รายละเอียดการลงทุน

ณ 31 พฤษภาคม 2560	%
เงินฝากในธนาคารพาณิชย์ หรือธนาคารอื่นที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้น	2.12%
หุ้นและใบสำคัญแสดงสิทธิที่จะซื้อหุ้น	99.61%
<b>รวม</b>	<b>101.73%</b>



## อัตราผลตอบแทน



### สถานะภาพของกองทุน ณ 31 พ.ค. 60

ยอดสินทรัพย์รวม	2,450.04	ล้านบาท
จำนวนพนักงาน	13,780	คน
จำนวนนายจ้าง	238	บริษัท

### อัตราผลตอบแทนสะสมสุทธิ

ม.ค. - พ.ค. 60 = 3.30%

**\*\*อัตราอ้างอิงผลการดำเนินงานของกองทุนสะสม**

ม.ค. - พ.ค. 60 = 1.21%

▶ อัตราอ้างอิงผลการดำเนินงานกองทุน : 100% SET Index