

กองทุนเปิดกรุงศรีเจแปนสมอลแคปอิกวิตี-ผู้ลงทุนสถาบัน

หน่วยลงทุนชนิดผู้ลงทุนสถาบัน
KFJPSCAP-I

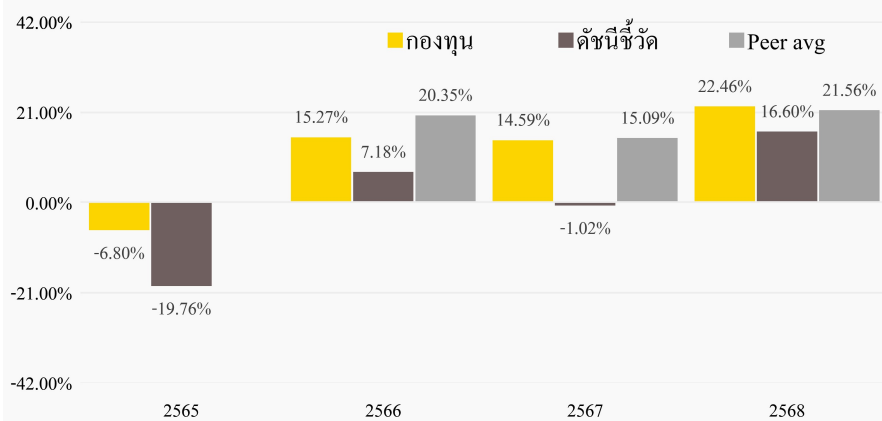
ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมตราสารทุน/ กองทุนรวมฟีดเดอร์ (Feeder Fund)
- กองทุนรวมที่เน้นลงทุนแบบมีความเสี่ยงต่างประเทศ
- กลุ่มกองทุนรวม : Japan Equity

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- ลงทุนในกองทุนรวมต่างประเทศชื่อ MUFG Japan Equity Small Cap Fund (Class I) (กองทุนหลัก) โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของ NAV
- กองทุนหลักเน้นลงทุนในหุ้นของบริษัทขนาดเล็กที่เป็นบริษัทชั้นนำและมีศักยภาพที่จดทะเบียนซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ญี่ปุ่น
- บริษัทบริหารจัดการกองทุนหลัก คือ Waystone Management Company (Lux) S.A.
- กองทุนอาจจะเข้าทำสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) เพื่อเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน (Efficient Portfolio Management) ซึ่งรวมถึงการป้องกันความเสี่ยง (Hedging) จากการลงทุน
- กองทุนไทยมุ่งหวังให้ผลประกอบการเคลื่อนไหวตามกองทุนหลัก ส่วนกองทุนหลักมุ่งหวังให้ผลประกอบการสูงกว่าดัชนีชี้วัด (Active management)

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (% ต่อปี)



* ในปีที่กองทุนจัดตั้ง ผลการดำเนินงานจะแสดงตั้งแต่วันที่จัดตั้งจนถึงสิ้นปีปฏิทิน

ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด (% ต่อปี)

	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี *
กองทุน	17.20	1.31	0.60	25.96
ดัชนีชี้วัด	21.40	2.69	5.01	21.20
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	23.82	2.48	7.92	36.78
ความผันผวนกองทุน	23.40	21.71	25.42	20.83
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	23.63	21.15	25.05	21.65
	3 ปี *	5 ปี *	10 ปี *	ตั้งแต่จัดตั้ง **
กองทุน	18.74	N/A	N/A	16.31
ดัชนีชี้วัด	12.88	N/A	N/A	9.84
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	20.37	N/A	N/A	N/A
ความผันผวนกองทุน	20.48	N/A	N/A	19.27
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	21.25	N/A	N/A	20.42

* ผลตอบแทนที่มีอายุเกินหนึ่งปีจะแสดงเป็นผลตอบแทนต่อปี

** ผลการดำเนินงานเริ่มคำนวณตั้งแต่วันที่ 25 พฤศจิกายน 2565

ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกันตามกลุ่ม Japan Equity

ระดับความเสี่ยง



เสี่ยงสูง

ลงทุนในตราสารทุนเป็นหลักโดยเฉลี่ยในรอบปี
ไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน	26 พฤษภาคม 2560
วันเริ่มต้น class	2 พฤศจิกายน 2564
นโยบายการจ่ายเงินปันผล	ไม่จ่าย
อายุกองทุน	ไม่กำหนดอายุโครงการ
การป้องกันความเสี่ยง FX	ตามดุลยพินิจของผู้จัดการกองทุน

ผู้จัดการกองทุนรวม

นาย จาตุรันต์ สอนไว (2 พฤศจิกายน 2564)

นาย ชูศักดิ์ อวยพรชัยสกุล (2 พฤศจิกายน 2564)

ดัชนีชี้วัด

ผลการดำเนินงานของกองทุนหลัก สัดส่วน 100.00% ปรับ
ด้วยอัตราแลกเปลี่ยนเพื่อเทียบเท่าค่าสกุลเงินบาท ณ วันที่
คำนวณผลตอบแทน

คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวมมิได้เป็น
สิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต: ได้รับการรับรองจาก CAC

จัดอันดับกองทุน Morningstar  (ข้อมูล ณ 31 ก.ค. 2569)

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือ
บริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่อง
ได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

www.krungsriasset.com

การซื้อขายหน่วยลงทุน	การขายคืนหน่วยลงทุน
วันทำการซื้อ: ตามวันทำการกองทุน	วันทำการขายคืน: ตามวันทำการกองทุน
เวลาทำการ: 08:30 น. - 12:00 น.	เวลาทำการ: 08:30 น. - 12:00 น.
การซื้อขายครั้งแรกขั้นต่ำ: ไม่กำหนด	การขายคืนขั้นต่ำ: ไม่กำหนด
การซื้อขายครั้งถัดไปขั้นต่ำ: ไม่กำหนด	ยอดคงเหลือขั้นต่ำ: ไม่กำหนด
	ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน: ภายใน 6 วันทำการ
	นับถัดจากวันทำการขายคืน โดยทั่วไปจะได้
	รับเงิน 5 วันทำการนับถัดจากวันทำการขายคืน
	(T+5)

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปี ของ NAV)		
ค่าธรรมเนียมต่อไปนี้จะส่งผลกระทบต่อผู้ลงทุน เนื่องจากจะทำให้ผลตอบแทนจากการลงทุนลดลง		
ดังนั้น ผู้ลงทุนควรตรวจสอบทุกครั้งก่อนตัดสินใจลงทุน		
ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	2.1400	1.3375
ค่าตอบแทนแก่ผู้สนับสนุนการขายหรือรับซื้อคืน		
หน่วยลงทุนของกองทุนรวม (trailer fee): มี		
รวมค่าใช้จ่าย	4.6545	1.5848

หมายเหตุ

ค่าตอบแทนแก่ผู้สนับสนุนการขายหรือรับซื้อคืนหน่วยลงทุน (trailer fee) เป็นส่วนหนึ่งของค่าธรรมเนียมการจัดการ

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย) ผู้ลงทุนจะถูก		
เรียกเก็บค่าธรรมเนียมต่อไปนี้อย่างตรงทุกครั้งที่เมื่อทำการซื้อขายหรือสับเปลี่ยนหน่วยลงทุน		
ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การขาย	ไม่เกิน 2.00	ไม่เรียกเก็บ
การรับซื้อคืน	ไม่เกิน 2.00	ไม่เรียกเก็บ
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า	ไม่เกิน 2.00	ไม่เรียกเก็บ
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก	ไม่เกิน 2.00	ไม่เรียกเก็บ
การโอนหน่วย	10 บาทต่อ 1,000 หน่วย	10 บาทต่อ 1,000 หน่วย

หมายเหตุ

- ค่าธรรมเนียมดังกล่าวเป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว
- ยังไม่เปิดให้สับเปลี่ยนหน่วยลงทุนระหว่างกันของกองทุนเปิดกรุงศรีเจแปนสมอลแคปอิคิวดี-สะสมมูลค่า และ
- กองทุนเปิดกรุงศรีเจแปนสมอลแคปอิคิวดีปันผล
- บริษัทจัดการขอสงวนสิทธิในการยกเว้นโดยไม่เรียกเก็บค่าธรรมเนียมการสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนระหว่างชนิดหน่วย
- ลงทุนภายใต้กองทุนนี้ โดยขึ้นอยู่กับดุลยพินิจของบริษัทจัดการ
- บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายใน
- การบริหารจัดการ
- บริษัทจัดการอาจยกเว้นไม่เรียกเก็บค่าธรรมเนียมการ โอนหน่วยลงทุน โดยขึ้นอยู่กับดุลยพินิจของบริษัทจัดการ

ข้อมูลเชิงสถิติ	
Maximum Drawdown	-23.41 %
Recovering Period	22 วัน
FX Hedging	89.31 %
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน	1.03 เท่า
Sharpe Ratio	0.85
Alpha	5.86 %
Beta	N/A

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน (% NAV)	
MUFG Japan Equity Small Cap Fund (Class I)	98.58
ทรัพย์สินอื่น	1.94
เงินฝาก หรือตราสารหนี้ที่สถาบันการเงิน	1.02
เป็นผู้ออก	
หนี้สินอื่น	-1.53

การจัดสรรการลงทุนในต่างประเทศ (% NAV)	
Japan	100.00
ข้อมูลกองทุนหลัก ณ 31 กรกฎาคม 2569	
การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม/	
ทรัพย์สิน (% NAV)	
Industrials	28.70
Information Technology	21.30
Financials	14.80
Materials	10.60
Consumer Discretionary	9.70
ข้อมูลกองทุนหลัก ณ 31 กรกฎาคม 2569	

ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก

Holding	% NAV
TOCALO	2.69
KAGA ELECTRONICS	2.56
FUJIBO HOLDINGS	2.41
HACHIJUNI NAGANO BANK	2.39
77 BANK	2.24
ข้อมูลกองทุนหลัก ณ 31 กรกฎาคม 2569	

การลงทุนในกองทุนอื่นเกินกว่า 20% (กองในประเทศและกองต่างประเทศ)

ชื่อกอง : MUFG Japan Equity Small Cap Fund, Class I	ISIN code : LU1163552489
	Bloomberg code : MJESCIYI LX

- บริษัทจัดการจะปฏิบัติตามกฎเกณฑ์ของกองทุนหลัก โดยรายงานการถือครองหน่วยลงทุนตั้งแต่ร้อยละ 25 ของจำนวนหน่วยลงทุนที่จำหน่ายได้แล้วทั้งหมดของกองทุนให้กับผู้มีอำนาจหน้าที่ของกองทุนหลัก และอาจนำส่งข้อมูลส่วนตัวของผู้ถือหน่วยลงทุนดังกล่าวเช่น สำเนาบัตรประจำตัวประชาชนและ/หรือสำเนาหนังสือเดินทาง เป็นต้น และ/หรือขอข้อมูลหรือเอกสารเพิ่มเติมอื่นใดจากผู้ถือหน่วยลงทุนในภายหลังก็ได้ เพื่อให้เป็นไปตามที่กองทุนหลักร้องขอ หากผู้ถือหน่วยลงทุนรายใดปฏิเสธการให้ข้อมูลหรือเอกสารเพิ่มเติมดังกล่าวหรือมีพฤติกรรมเข้าข่ายและ/หรือมีความผิดตามกฎหมายอันมีผลทำให้บริษัทจัดการไม่สามารถปฏิบัติตามกฎเกณฑ์ของกองทุนหลักได้ บริษัทจัดการขอสงวนสิทธิที่จะระงับหรือหยุดให้บริการและดำเนินการคืนเงินลงทุนตามมูลค่าหน่วยลงทุนให้แก่ผู้ถือหน่วยลงทุน โดยถือว่าได้รับความเห็นชอบจากผู้ถือหน่วยลงทุนแล้ว ทั้งนี้ ผู้ถือหน่วยลงทุนจะไม่สามารถนำเรื่องดังกล่าวมาใช้เป็นสิทธิเรียกร้องความเสียหายจากเหตุดังกล่าวจากบริษัทจัดการได้แต่อย่างใด
- ผู้ลงทุนสามารถซื้อกรรมธรรม์ประกันชีวิตควบหน่วยลงทุน(Unit-Linked) ของกองทุนนี้ได้โดยติดต่อกับบริษัทประกันชีวิตที่บริษัทจัดการกำหนด ทั้งนี้การซื้อกรรมธรรม์ประกันชีวิตควบหน่วยลงทุนอาจมีข้อกำหนดและวิธีปฏิบัติที่แตกต่างกันไปจากผู้ถือหน่วยลงทุนปกติที่ซื้อขายหน่วยลงทุนของกองทุนนี้เพียงอย่างเดียว ผู้ลงทุนจึงควรศึกษารายละเอียดในเอกสารประกอบการขายกรรมธรรม์ประกันชีวิตควบหน่วยลงทุนให้เข้าใจก่อนการตัดสินใจลงทุน

คำอธิบาย

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

Recovering Period ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาดังแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลานานเท่าใด

FX Hedging เปรอ์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพ์ในพอร์ตกองทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลานึง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อหลักทรัพ์กับผลรวมของมูลค่าการขายหลักทรัพ์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 1 ปีหารด้วยมูลค่า NAV ของกองทุนรวมเฉลี่ยในรอบระยะเวลาเดียวกัน กองทุนรวมที่มีค่า portfolio turnover สูง บ่งชี้ถึงการซื้อขายหลักทรัพ์บ่อยครั้งของผู้จัดการกองทุนและทำให้มีต้นทุนการซื้อขายหลักทรัพ์ที่สูง จึงต้องพิจารณาเปรียบเทียบกับผลการดำเนินงานของกองทุนรวมเพื่อประเมินความคุ้มค่าของการซื้อขายหลักทรัพ์ดังกล่าว

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 ซึ่งเป็นผลจากประสิทธิภาพของผู้จัดการกองทุน ในการคัดเลือกหรือหาจังหวะเข้าลงทุนในหลักทรัพ์ได้อย่างเหมาะสม

Beta ระดับและทิศทางการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพ์ในพอร์ตการลงทุน โดยเปรียบเทียบกับอัตราการเปลี่ยนแปลงของตลาด Beta น้อยกว่า 1 แสดงว่าหลักทรัพ์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนน้อยกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพ์ของตลาด Beta มากกว่า 1 แสดงว่า หลักทรัพ์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนมากกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพ์ของตลาด

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

Yield to Maturity อัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในตราสารหนี้โดยถือจนครบกำหนดอายุ ซึ่งคำนวณจากดอกเบี้ยที่จะได้รับในอนาคตตลอดอายุตราสารและเงินต้นที่จะได้รับคืนนำมาคิดลดเป็นมูลค่าปัจจุบัน โดยใช้วัดอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมตราสารหนี้ คำนวณจากค่าเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักของ Yield to Maturity ของตราสารหนี้แต่ละตัวที่กองทุนมีการลงทุน และเนื่องจาก Yield to Maturity มีหน่วยมาตรฐานเป็นเปอร์เซ็นต์ต่อปี จึงสามารถนำไปใช้เปรียบเทียบอัตราผลตอบแทนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีนโยบายถือครองตราสารหนี้จนครบกำหนดอายุและมีลักษณะการลงทุนที่ใกล้เคียงกันได้

บริษัทหลักทรัพ์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด
ที่อยู่ 898 อาคารเพลินจิตทาวเวอร์ ชั้น 1-2 โซนเอ ชั้น 12 ชั้น 18 โซนบี
ถนนเพลินจิต แขวงลุมพินี เขตปทุมวัน กรุงเทพฯ 10330
โทรศัพท์ 0-2657-5757 โทรสาร 0-2657-5777
เว็บไซต์: www.krungsriasset.com