PEA.PVDFUND

HOT NEWS

ฉบับที่ 4/2565 วันที่ 29 พฤศจิกายน 2565

กสช.กฟภ. ขอรายงานข้อมูลอัตราผลตอบแทนและความเสี่ยงคาดหวัง (Expected Return & Risk) ในแต่ละนโยบายการลงทุนของ กสช.กฟภ. โดยมีวัตถุประสงค์เพื่อให้สมาชิกกองทุนได้รับทราบและนำข้อมูลดังกล่าวไปใช้ประกอบการพิจารณากำหนดสัดส่วนการลงทุนให้เหมาะสมกับตนเอง

อัตราผลตอบแทนและความเสี่ยงคาดหวังในแต่ละนโยบายการลงทุน รอบวันที่ 1 ธันวาคม 2565 ถึงวันที่ 28 กุมภาพันธ์ 2566

บริหารโดย	สถานการณ์ Scenario	โอกาสที่จะเกิดขึ้น Probability	อัตราผลตอบแทนคาดหวัง Expected Return		ความเสี่ยงคาดหวัง Expected Risk (ส่วนเบี่ยงเบนมาตรฐาน)
กองทุนนโยบายการลงทุนประเภทตราสารหนี้					
หลักทรัพย์จัดการกองทุนกรุงไทย Krungthai Asset Management	Base Case	0.60	0.23%	0.27%	0.40%
	Best Case	0.20	0.80%		
	Worst Case	0.20	-0.17%		
krungsri Asset Management	Base Case	0.50	0.55%	0.55%	0.44%
	Best Case	0.25	0.99%		
	Worst Case	0.25	0.11%		
กองทุนนโยบายการลงทุนประเภทตราสารทุน					
One Asset Management	Base Case	0.50	1.67%	1.63%	0.67%
	Best Case	0.20	2.74%		
	Worst Case	0.30	0.81%		
MFC Asset Management plc.	Base Case	0.60	2.08%	2.17%	1.89%
	Best Case	0.25	4.62%		
	Worst Case	0.15	-1.54%		
กองทุนนโยบายการลงทุนประเภทตราสารทุนต่างประเทศ					
บลจ.บัวหลวง	Base Case	0.60	1.70%	2.03%	5.27%
	Best Case	0.25	6.80%		
	Worst Case	0.15	-4.80%		
กองทุนนโยบายการลงทุนประเภทอสังหาริมทรัพย์ทั่วโลก					
MFC Asset Management plc.	Base Case	0.65	4.00%	2.08%	12.00%
	Best Case	0.15	7.20%		
	Worst Case	0.20	-8.00%		

ข้อมูลอัตราผลตอบแทนและความเสี่ยงคาดหวัง เป็นการประมาณการจากพอร์ตการลงทุนที่แต่ละบริษัทจัดการกองทุนได้บริหารเงินลงทุนให้กับ กสช.กฟภ. และเป็นการคำนวณภายใต้เงื่อนไขของสมมติฐานตามโอกาสที่อาจจะเกิดขึ้น (Probability) (Total Probability=1)

ข้อสงวนสิทธิ์ : วัตถุประสงค์การจัดทำรายงาน เพื่อเป็นข้อมูล โดยมิใช่การแนะนำหรือรับรองผลการดำเนินงาน หากไม่สามารถลงทุนให้เป็นไปตามที่กำหนดได้ เนื่องจากสภาวะตลาดมีการเปลี่ยนแปลงไป ผู้ลงทนอาจไม่ได้รับผลตอบแทนที่ระบุไว้

ข้อมูลจากบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนที่บริหารเงินลงทุนให้กับ กสช.กฟภ. และคณะกรรมการนโยบายตราสารทุน
จัดทำและออกแบบโดยแผนกสมาชิกสัมพันธ์และกฎหมายกองทุน กองจัดการกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ (กทช.)