



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

**อัตราผลตอบแทนและความเสี่ยงคาดหวังในแต่ละนโยบายการลงทุน
รอบวันที่ 1 มีนาคม 2566 ถึงวันที่ 31 พฤษภาคม 2566**

บริหารโดย	สถานการณ์ Scenario	โอกาส ที่จะเกิดขึ้น Probability	อัตราผลตอบแทนคาดหวัง Expected Return		ความเสี่ยงคาดหวัง Expected Risk (ส่วนเบี่ยงเบนมาตรฐาน)
กองทุนนโยบายการลงทุนประเภทตราสารหนี้					
	Base Case	0.65	0.39%	0.36%	0.37%
	Best Case	0.15	0.84%		
	Worst Case	0.20	-0.06%		
	Base Case	0.50	0.59%	0.59%	0.38%
	Best Case	0.25	0.98%		
	Worst Case	0.25	0.21%		
กองทุนนโยบายการลงทุนประเภทตราสารทุน					
	Base Case	0.50	1.77%	1.75%	1.5876%
	Best Case	0.25	3.98%		
	Worst Case	0.25	-0.51%		
	Base Case	0.60	1.96%	2.05%	3.31%
	Best Case	0.25	6.23%		
	Worst Case	0.15	-4.57%		
กองทุนนโยบายการลงทุนประเภทตราสารทุนต่างประเทศ					
	Base Case	0.60	0.80%	0.97%	5.60%
	Best Case	0.25	5.43%		
	Worst Case	0.15	-5.77%		
กองทุนนโยบายการลงทุนประเภทอสังหาริมทรัพย์ทั่วโลก					
	Base Case	0.65	1.26%	1.26%	5.50%
	Best Case	0.15	2.00%		
	Worst Case	0.20	-1.80%		

ข้อมูลอัตราผลตอบแทนและความเสี่ยงคาดหวัง เป็นการประมาณการจากพอร์ตการลงทุนที่แต่ละบริษัทจัดการกองทุนได้บริหารเงินลงทุนให้กับ กสช.กฟก. และเป็นการคำนวณภายใต้เงื่อนไขของสมมติฐานตามโอกาสที่อาจเกิดขึ้น (Probability) (Total Probability=1)

ข้อสงวนสิทธิ์ : วัตถุประสงค์การจัดทำรายงาน เพื่อเป็นข้อมูล โดยมีใช้การแนะนำหรือรับรองผลการดำเนินงาน หากไม่สามารถลงทุนให้เป็นไปตามที่กำหนดได้เนื่องจากสภาพตลาดมีการเปลี่ยนแปลงไป ผู้ลงทุนอาจไม่ได้รับผลตอบแทนที่ระบุไว้