การดำเนินงานและปริมาณการสับเปลี่ยนนโยบายตราสารทุนต่างประเทศ หลังจากใช้มาตรการ Trade Date T+2

ตามที่คณะกรรมการกองทุนได้ประกาศเปลี่ยนแปลงหลักเกณฑ์การปรับสัดส่วนนโยบายการลงทุนที่มีผลกระทบต่อนโยบายตราสารทุนต่างประเทศตามประกาศ กส.กฟผ. ที่ 2/2566 หรือ "มาตรการ T+2" เพื่อลดผลกระทบจากการคำนวนมูลค่าหน่วยลงทุนที่ใช้ราคาปิดล่าสุดของกองทุนต่างประเทศในการคำนวณมูลค่าทรัพย์สิน ซึ่งเป็นราคาของวันทำการก่อนหน้า (Backward Pricing) โดยมีผลตั้งแต่วันที่ 1 มีนาคม 2566 เป็นต้นมา นั้น

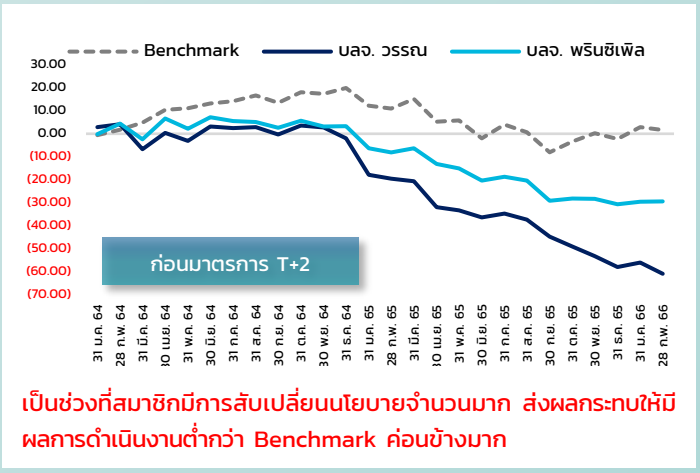
คณะกรรมการกองทุนได้ติดตามผลการดำเนินงานของบริษัทจัดการและปริมาณการสับเปลี่ยนนโยบายการลงทุน ตลอดจนสภาพคล่องของพอร์ตการลงทุนนโยบายตราสารทุนต่างประเทศอย่างต่อเนื่อง โดยพบว่าตั้งแต่เริ่มมาตรการ T+2 มีการเปลี่ยนแปลงเมื่อเปรียบเทียบกับช่วงก่อนการประกาศใช้มาตรการดังกล่าว ดังนี้

- ผลการดำเนินงานของบริษัทจัดการไม่ต่ำกว่า Benchmark
- ปริมาณการสับเปลี่ยนนโยบายการลงทุนของสมาชิกลดลงอย่างมีนัยสำคัญ
- สัดส่วนการถือครองสินทรัพย์สภาพคล่องในพอร์ตการลงทุนมีความผันผวนลดลง

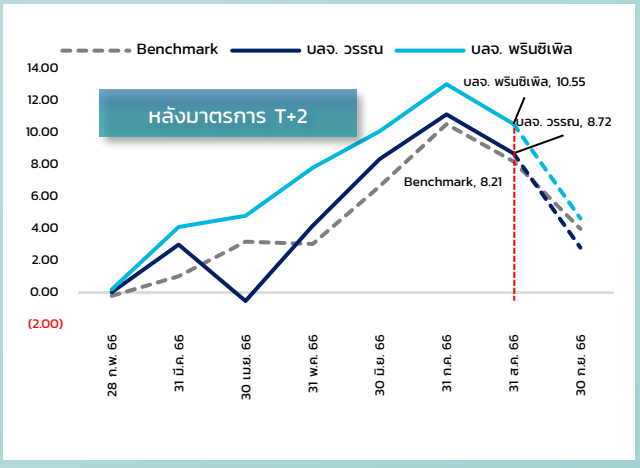
คณะกรรมการกองทุนได้พิจารณาอัตราผลตอบแทนสะสมตั้งแต่เริ่มใช้มาตรการ T+2 ถึงวันที่ 31 พฤษภาคม 2566 และวันที่ 31 สิงหาคม 2566 และมีมติให้โอกาสทั้ง 2 บริษัทจัดการบริหารต่อไปอีก 3 เดือนจนถึงวันที่ 30 พฤศจิกายน 2566 เนื่องจากผลการดำเนินงานในช่วงเวลาดังกล่าวสูงกว่า Benchmark

ทั้งนี้ หากพิจารณาผลตอบแทนสะสมตั้งแต่เริ่มใช้มาตรการ T+2 ถึงวันที่ 30 กันยายน 2566 พบว่าผลตอบแทนสะสมของ บลจ.วรรณ ต่ำกว่า Benchmark -1.17% ส่วน บลจ.พรินซิเพิล สูงกว่า Benchmark 0.65% โดยคณะกรรมการกองทุนจะยังคงติดตามผลการดำเนินงานของบริษัทจัดการอย่างใกล้ชิดต่อไป เพื่อประโยชน์สูงสุดแก่สมาชิกกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ กฟผ. ทุกท่าน

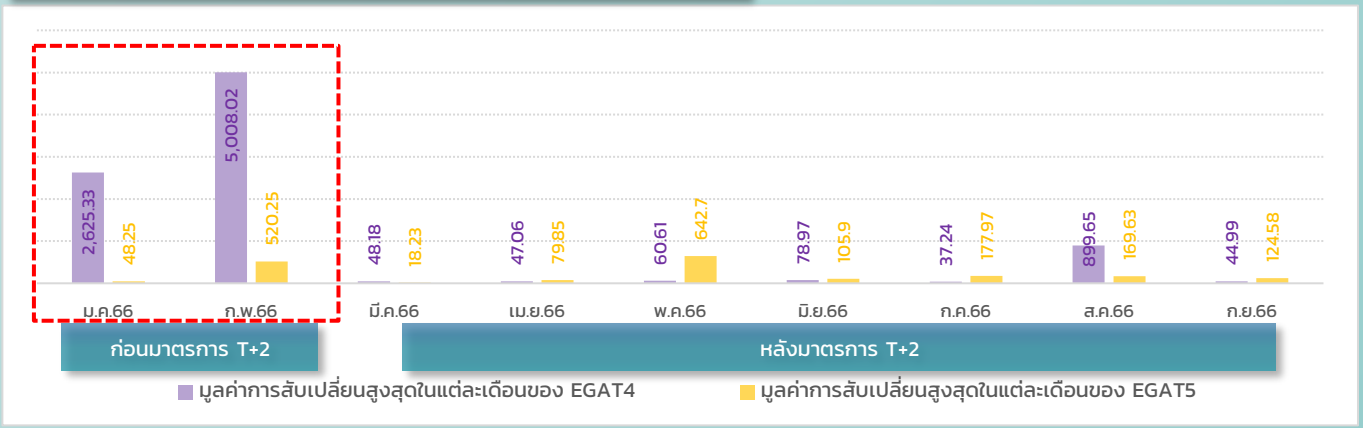
ผลการดำเนินงานของบริษัทจัดการ



เป็นช่วงที่สมาชิกมีการสับเปลี่ยนนโยบายจำนวนมาก ส่งผลกระทบให้มีผลการดำเนินงานต่ำกว่า Benchmark ค่อนข้างมาก



ปริมาณการสับเปลี่ยนนโยบายของสมาชิก



วันที่ 9 ตุลาคม 2566

กองทุนสำรองเลี้ยงชีพพนักงาน กฟผ.

สอบถามข้อมูลเพิ่มเติมที่ คุณภัทรวดี 65536 คุณศิริญญา/คุณอุดมลักษณ์ 65576 คุณสิริมา 65533