

กองทุนสำรองเลี้ยงชีพ กฟผ.

นโยบายตราสารทุนต่างประเทศแบบอิงดัชนี (EGAT5)

นโยบายใหม่ ที่มีรูปแบบการลงทุนแบบ passive หรือลงทุนให้ผลตอบแทนใกล้เคียงกับดัชนีอ้างอิงมากที่สุด โดยลงทุนผ่านกองทุนรวมประเภท ETF ชื่อ iShares MSCI ACWI ETF

หุ้นในพอร์ต iShares ACWI ETF มีบริษัทอะไรบ้าง?

ในสิบห้าอันดับแรกของพอร์ตการลงทุน จะเป็นหุ้นบริษัทขนาดใหญ่ที่เราคุ้นเคยกันเป็นอย่างดีและมีการกระจายความเสี่ยงของรายได้ ไปยังหลายภูมิภาคทั่วโลก มูลค่าบริษัทรวมกว่าแสนล้านถึงหลักล้านล้านบาท

| ระยะเวลาการลงทุน | 1Y | 3Y | 5Y | 10Y |
|-------------------|-------|-------|-------|-------|
| ผลตอบแทนสะสม (%) | -19.9 | 15.25 | 29.76 | 118.8 |
| ระยะเวลาการลงทุน | 1Y | 3Y | 5Y | 10Y |
| ผลตอบแทนต่อปี (%) | -19.9 | 4.85 | 5.35 | 8.14 |
| รวมปีปฏิทิน | 2017 | 2018 | 2019 | 2020 |
| ผลตอบแทน (%) | 24.35 | -9.15 | 26.7 | 16.38 |



สถิติสำคัญที่เกี่ยวข้องกับพอร์ตการลงทุนของ iShares MSCI ACWI ETF

- กองทุนมีทรัพย์สินรวม 1.75 หมื่นล้าน USD หรือราว 6.4 แสนล้านบาท
- กองทุนจดทะเบียนในตลาด NASDAQ ในสหรัฐฯ และซื้อขายเป็นสกุล USD
- มีมูลค่าซื้อขายในตลาดเฉลี่ย (30 วันย้อนหลัง) ตกวันละกว่า 5 ล้าน USD
- หุ้นในพอร์ตการลงทุนปัจจุบันมีจำนวนทั้งสิ้น 2,332 บริษัท
- พอร์ตกระจุกตัวต่ำ มีน้ำหนักหุ้น 10 และ 20 ตัวแรกเพียง 14% และ 20% เท่านั้น
- มีอัตราการปันผลในช่วง 12 เดือนที่ผ่านมา ที่ระดับ 2.34% (ณ 31 ตุลาคม 2556)
- ซื้อขายที่อัตราส่วน ราคา/กำไรสุทธิ หรือ PE Ratio ที่ราว 16 เท่า
- ในช่วง 10 ปีที่ผ่านมา กองทุนให้ผลตอบแทนสะสมรวม 118% หรือ 8.14% ต่อปี
- กองทุนมีค่าใช้จ่ายและค่าธรรมเนียมการบริหาร รวมกันสุทธิที่ 0.32% ต่อปี