

# กองทุนเปิดกรุงศรีแอคทีฟตราสารหนี้-สะสมมูลค่า

หน่วยลงทุนชนิดสะสมมูลค่า  
KFAFIX-A

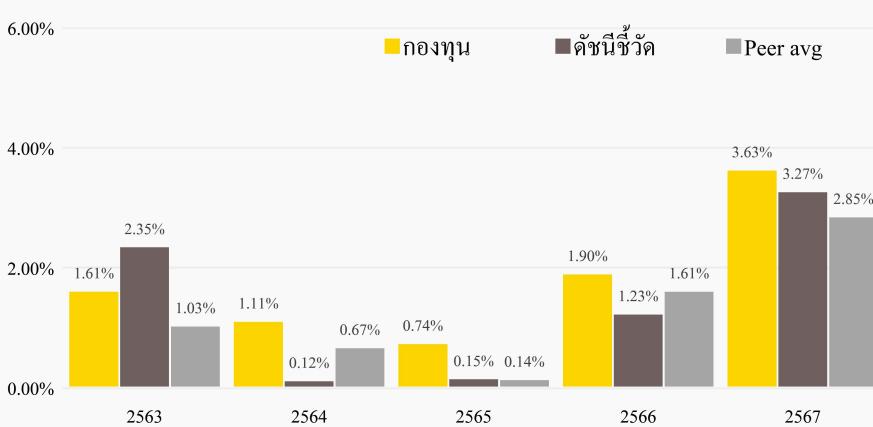
## ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมตราสารหนี้ กองทุนรวมที่มีนโยบายเปิดให้มีการลงทุนในกองทุนรวมอื่นภายใต้บลจ.เดียวกัน
- กองทุนรวมที่ลงทุนแบบมีความเสี่ยงพื้นฐานและต่างประเทศ
- กลุ่มกองทุนรวม : Mid Term General Bond

## นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- เน้นลงทุนในประเทศและ/หรือต่างประเทศ ในตราสารหนี้ และ/หรือ เงินฝากหรือตราสาร เทียบเท่าเงินฝาก ที่ออก รับรอง รับวัสดุ หรือค้ำประกันการจ่ายเงิน โดยภาครัฐบาล รัฐวิสาหกิจ สถาบันการเงิน และ/หรือภาคเอกชน
- กองทุนอาจลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมภายใต้การจัดการของบริษัทจัดการ ในสัดส่วนไม่เกินร้อยละ 100 ของ NAV
- กองทุนอาจจะเข้าทำสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) เพื่อเพิ่มประสิทธิภาพการบริหาร การลงทุน (Efficient Portfolio Management) ซึ่งรวมถึงการป้องกันความเสี่ยง (Hedging) จากการลงทุน
- กองทุนมุ่งหวังให้ผลประกอบการสูงกว่าดัชนีชี้วัด (Active management)
- ป้องกันความเสี่ยงจากการคาดคะเนเปลี่ยนไปมือยกเว่อร์อย่างละ 90 ของมูลค่าเงินลงทุนในต่างประเทศ

## ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (%) ต่อปี



\* ในปีที่กองทุนจัดตั้ง ผลการดำเนินงานจะแสดงตั้งแต่วันที่จัดตั้งจนถึงสิ้นปีปฏิทิน

## ระดับความเสี่ยง

ต่ำ	1	2	3	4	5	6	7	8	สูง
-----	---	---	---	---	---	---	---	---	-----

เสี่ยงปานกลางค่อนข้างต่ำ

ลงทุนในพันธบัตรรัฐบาล และตราสารหนี้อekoชน โดยมีตราสาร non-investment grade /unrated ไม่เกิน 20% ของ NAV

## ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน	21 ตุลาคม 2559
วันเริ่มต้น class	21 ตุลาคม 2559
นโยบายการจ่ายเงินปั้นผล	ไม่จ่าย
อายุกองทุน	ไม่กำหนดอายุโครงการ

## ผู้จัดการกองทุนรวม

นาย ชีรภพ จรัสกัยกุล (30 ธันวาคม 2564)  
น.ส. พฤทิพา หนึ่งนำใจ (1 ตุลาคม 2564)

## ดัชนีชี้วัด

- ผลตอบแทนรวมสุทธิของดัชนีพันธบัตรรัฐบาลอายุน้อยกว่าเท่ากับ 10 ปี ของสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย สัดส่วน (%): 50.00 และ
- ผลตอบแทนรวมสุทธิของดัชนีตราสารหนี้ภาคเอกชน Mark-to-Market ที่มีอัันดับความน่าเชื่อถือของผู้ออกตราสาร ออยู่ในระดับ BBB+ ขึ้นไป อายุ 1 - 3 ปี ของสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย สัดส่วน (%): 30.00 และ
- อัตราดอกเบี้ยเงินฝากประจำ 1 ปี วงเงินน้อยกว่า 5 ล้านบาท เคลี่ยงของ 3 ธนาคารพาณิชย์ขนาดใหญ่ ได้แก่ ธนาคารกรุงเทพ ธนาคารกสิกรไทย และธนาคารไทยพาณิชย์ หลังหักภาษี สัดส่วน (%): 10.00 และ
- ดัชนีอัตราดอกเบี้ยอ้างอิง THOR หลังหักภาษี สัดส่วน (%): 10.00

\* เริ่มใช้ดัชนีชี้วัดผลการดำเนินงานใหม่หลังหักภาษี (Net TRN Index) มีผลตั้งแต่วันที่ 31 ตุลาคม 2562

วัดคุณประสิทธิภาพอ้างอิงดัชนีชี้วัด: บริษัทจัดการใช้ดัชนีชี้วัดดังกล่าวเพื่อบรรลุเป้าหมายที่ขับเคลื่อนผลการดำเนินงานของกองทุนรวม

## คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวมมิได้เป็นสิ่งที่บ่งชี้ถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อศักดิ์ทุน: ได้รับการรับรองจาก CAC

จัดอันดับกองทุน Morningstar ★★★★☆ (ข้อมูล ณ 31 มี.ค. 2568)

หนังสือชี้ชวนฉบับเดิม



ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเพิ่มเติม  
บริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่อง  
ได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเดิม

## ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบบีกหมุด (%) ต่อปี)

	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี *
กองทุน	1.63	1.52	2.45	4.55
ดัชนีชี้วัด	1.74	1.62	2.35	4.36
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	1.61	1.47	2.22	3.90
ความผันผวนกองทุน	0.83	0.88	0.74	0.64
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	0.75	0.79	0.66	0.62
	3 ปี *	5 ปี *	10 ปี *	ตั้งแต่จัดตั้ง
กองทุน	2.93	1.97	N/A	2.28
ดัชนีชี้วัด	2.71	1.55	N/A	2.06
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	2.37	1.48	N/A	N/A
ความผันผวนกองทุน	0.77	0.79	N/A	0.85
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	0.99	0.94	N/A	0.92

\* ผลตอบแทนที่มีอายุกึ่งหนึ่งปีจะแสดงเป็นผลตอบแทนต่อปี

ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกันตามกู้ณ Mid Term General Bond

### การซื้อหุ้นน่าวัยลงทุน

วันทำการซื้อ: ทุกวันทำการของธนาคาร

เวลาทำการ: 08:30 น. - 15:30 น.

การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ: 500 บาท

การซื้อครั้งต่อไปขั้นต่ำ: 500 บาท

### การขายคืนหุ้นน่าวัยลงทุน

วันทำการขายคืน: ทุกวันทำการของธนาคาร

เวลาทำการ: 08:30 น. - 15:30 น.

การขายคืนขั้นต่ำ: 500 บาท หรือ 50 หน่วย

ยอดคงเหลือขั้นต่ำ: 50 หน่วย

ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน: ภายใน 5 วันทำการ  
นับตั้งจากวันทำการขายคืน โดยทั่วไปจะได้  
รับเงิน 2 วันทำการนับตั้งจากวันทำการขายคืน  
(T+2)

### ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (%) ต่อปี ของ NAV)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	1.6050	0.3210
รวมค่าใช้จ่าย	2.9425	0.4134

### ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ซื้อหุ้น (% ของมูลค่าซื้อขาย)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การขาย	1.00	ไม่เรียกเก็บ
การรับซื้อคืน	1.00	ไม่เรียกเก็บ
การสับเปลี่ยนหุ้นน่าวัยลงทุนเข้า	1.00	ไม่เรียกเก็บ
การสับเปลี่ยนหุ้นน่าวัยลงทุนออก	1.00	ไม่เรียกเก็บ
การโอนหน่วย	10 บาทต่อ 1,000 หน่วย	10 บาทต่อ 1,000 หน่วย

### หมายเหตุ

- ค่าธรรมเนียมดังกล่าวเป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว
- หากกองทุนลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมภายใต้การจัดการเดียวกัน บริษัทจัดการจะไม่เรียกเก็บค่าธรรมเนียม การจัดการ ค่าธรรมเนียมการขายและ/หรือรับซื้อคืนหน่วยลงทุนซึ่งก่อน
- บริษัทจัดการขอสงวนสิทธิ์ในการยกเว้นโดยข้อกำหนดพิเศษของบริษัทจัดการ ลงทุนภายใต้กองทุนนี้ โดยข้อจำกัดคุณลักษณะพิเศษของบริษัทจัดการ
- บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายใน การบริหารจัดการ
- บริษัทจัดการอาจยกเว้นไม่เรียกเก็บค่าธรรมเนียมการโอนหน่วยลงทุน โดยข้อจำกัดคุณลักษณะของบริษัทจัดการ

## ข้อมูลเชิงสถิติ

Maximum Drawdown	-1.73 %
Recovering Period	3 เดือน 9 วัน
FX Hedging	99.09 %
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน	1.12 เท่า
อายุเฉลี่ยของตราสารหนี้	2 ปี 5 เดือน 12 วัน
<b>Yield to Maturity</b>	<b>2.08</b>

\* Yield to Maturity (YTM) อัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในตราสารหนี้ คำนวณจากดอกเบี้ยที่ได้รับจริง โดยมีໄodicปรับสัดส่วนเครื่องมือปัจจุบัน ความเสี่ยงจากอัตราดอกเบี้ยขึ้นซึ่งอาจทำให้ผลตอบแทนจริงลดลง/หรือเพิ่มขึ้น จาก YTM ในรูปสกุลเงินบาทได้

### สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน (%) NAV)

ตราสารหนี้ที่ออกโดยบริษัทหรือภาคเอกชน	40.18
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย	21.46
เงินฝาก หรือตราสารหนี้ที่สถาบันการเงิน เป็นผู้ออก	18.25
ตราสารภาครัฐหรือองค์กรระหว่างประเทศ	16.61
ทรัพย์สินอื่น	3.40
หน่วย CIS ต่างประเทศ - ตราสารหนี้ หนี้สินอื่น	1.13
	-1.03

### การจัดสรรการลงทุนในต่างประเทศ (%) NAV)

Singapore	4.32
Qatar	2.75
Japan	2.12
United Kingdom	2.04
China	1.51

### การจัดสรรการลงทุนใน

### ผู้ออกตราสาร 5 อันดับแรก (%) NAV)

ธนาคารแห่งประเทศไทย	21.46
กระทรวงการคลัง	16.61
The Saudi National Bank, Singapore Branch	4.32
ธนาคารอาคารสงเคราะห์ บมจ.บ้านปู	3.43
	3.22

### การจัดสรรการลงทุนตามอันดับความน่าเชื่อถือ (%)

	ในประเทศไทย	National	International
AAA	47.13		
AA	9.58		
A	24.08		14.23
BBB		1.48	

## ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก

Holding	% NAV
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย品种ที่ 3/FRB364/68	4.58
ธ.ธนาคารสงเคราะห์	3.43
พันธบัตรรัฐบาลเพื่อการบริหารหนี้ ในปีงบประมาณ พ.ศ. 2564 ครั้งที่ 4	2.84
ตัวเงินคลังงวดที่ (DM)14/182/68	2.81
หุ้นกู้ของบริษัท โกลบลอด เพาเวอร์ ชินเนอร์ซี จำกัด (มหาชน) ครั้งที่ 1/2562 ชุดที่ 4	2.76

- ผู้ลงทุนสามารถซื้อขายในวันเดียวกัน (Same-day) ของกองทุนนี้ได้โดยติดต่อกับบริษัทประกันชีวิตที่บริษัทจัดการกำหนด ทั้งนี้ในการซื้อขายในวันเดียวกันจะมีค่าธรรมเนียมเพิ่มขึ้น 2% ของจำนวนเงินที่ซื้อขาย สำหรับผู้ซื้อขายในวันเดียวกัน ผู้ลงทุนจะต้องชำระภาษีอากรตามกฎหมายที่กำหนดไว้ในสัญญาซื้อขาย ผู้ลงทุนจึงควรศึกษารายละเอียดในเอกสารประกอบการขายของกองทุนนี้

### คำอธิบาย

**Maximum Drawdown** เปอร์เซ็นต์ผลขาดทุนสูงสุดของกองทุนรวมในระยะเวลา 5 ปีข้อนหลัง (หรือตั้งแต่จัดตั้งกองทุนกรณีที่ตั้งไม่ครบ 5 ปี) โดยหักจากระดับ NAV ต่อหน่วยที่จุดสูงสุดไปจนถึงจุดต่ำสุดในช่วงที่ NAV ต่อหน่วยปรับตัวลดลง ค่า Maximum Drawdown เป็นข้อมูลที่ช่วยให้ทราบถึงความเสี่ยงที่อาจจะมาจากการลงทุนในกองทุนรวม

**Recovering Period** ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อปืนข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาตั้งแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นให้รีบากลับมาเท่าไหร่

**FX Hedging** เปอร์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการบีบอุ้นความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตคงทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลาหนึ่ง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์กับผลรวมของมูลค่าการขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 1 ปีหารด้วยมูลค่า NAV ของกองทุนรวมเฉลี่ยในรอบระยะเวลาเดียวกัน กองทุนรวมที่มีค่า portfolio turnover สูง ปัจจัยการซื้อขายหลักทรัพย์บ่อยครั้งของผู้จัดการกองทุนและทำให้มีต้นทุนการซื้อขายหลักทรัพย์ที่สูง จึงต้องพิจารณาเปรียบเทียบกับผลการดำเนินงานของกองทุนรวมเพื่อประเมินความถูกต้องของการซื้อขายหลักทรัพย์ตั้งแต่ล่า

**Sharpe Ratio** อัตราส่วนระหว่างผลตอบแทนส่วนต่างเพิ่มของกองทุนรวมเบริกน์เทียบกับความเสี่ยงจากการลงทุน โดยคำนวณจากผลต่อ百分ต์ของกองทุนรวมกับอัตราผลตอบแทนที่ปราศจากความเสี่ยง (risk-free rate) เปรียบเทียบกับค่าเบี่ยงเบนมาตรฐาน (standard deviation) ของกองทุนรวม ค่า Sharpe Ratio จะต้องถูกคำนวณโดยใช้ตัวผลตอบแทนที่กองทุนรวมควรได้รับเพิ่มขึ้นเพื่อชดเชยกับความเสี่ยงที่กองทุนรวมรับมา โดยกองทุนรวมที่มีค่า Sharpe Ratio สูงกว่าจะเป็นกองทุนที่มีประสิทธิภาพในการบริหารจัดการลงทุนที่ดีกว่าเนื่องจากได้รับผลตอบแทนส่วนต่างเพิ่มที่สูงกว่ากลางได้รับความเสี่ยงเดียวกัน

**Alpha** ผลตอบแทนส่วนต่างเกินของกองทุนรวมเมื่อเปรียบเทียบกับดัชนีชี้วัด (benchmark) โดยค่า Alpha ที่สูง หมายถึง กองทุนสามารถสร้างผลตอบแทนได้สูงกว่าดัชนีชี้วัด ซึ่งเป็นผลจากประสิทธิภาพของผู้จัดการกองทุนในการคาดเดาหรือคาดคะเนทิศทางของหุ้นในตลาด

**Beta** ระดับแล้วกิจกรรมการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุน โดยเบริกน์เทียบกับอัตราผลตอบแทนของตลาด Beta น้อยกว่า 1 แสดงว่า หลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนน้อยกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกุญแจหลักทรัพย์ของตลาด Beta มากกว่า 1 แสดงว่า หลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนมากกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกุญแจหลักทรัพย์ของตลาด

**Tracking Error** อัตราผลตอบแทนของกองทุนมีประสิทธิภาพในการเลือกแบบดัชนีชี้วัด โดยหาก tracking error ต่ำ หมายถึงกองทุนรวมมีประสิทธิภาพในการสร้างผลตอบแทนให้ใกล้เคียงกับดัชนีชี้วัด กองทุนรวมที่มีค่า tracking error สูง จะมีอัตราผลตอบแทนโดยเฉลี่ยห่างจากดัชนีชี้วัดมากที่สุด

**Yield to Maturity** อัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในตราสารหนี้โดยอัตราดอกเบี้ยที่จะได้รับในอนาคตตลอดอายุตราสารและเงินเดือนที่จะได้รับคืนนำมายังค่าปัจจุบัน โดยใช้ตัวตั้งอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมตราสารหนี้ คำนวณจากค่าเฉลี่ยต่อเดือนของ Yield to Maturity ของตราสารหนี้ต่อเดือนที่กองทุนมีการลงทุน และเนื่องจาก Yield to Maturity มีหน่วยมาตราฐานเป็นเปอร์เซ็นต์ต่อปี จึงสามารถนำไปใช้เปรียบเทียบอัตราผลตอบแทนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีนโยบายเดียวกัน

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

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด

## กองทุนเปิดกรุงศรีแอกtifตราสารหนี้-ผู้ลงทุนกลุ่ม

หน่วยลงทุนชนิดผู้ลงทุนกลุ่ม  
KFAFIX-C

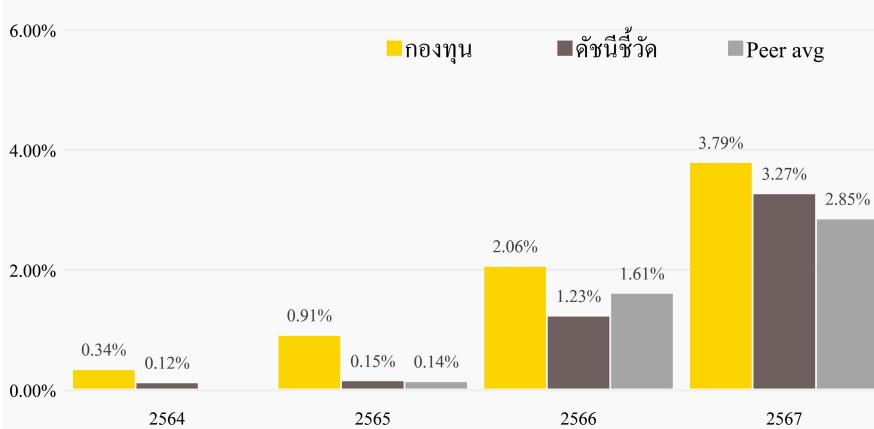
### ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมตราสารหนี้ กองทุนรวมที่มีนโยบายปิดให้มีการลงทุนในกองทุนรวมอื่นภายใต้บลจ.เดียวกัน
- กองทุนรวมที่ลงทุนแบบมีความเสี่ยงพื้นฐานและต่างประเทศ
- กลุ่มกองทุนรวม : Mid Term General Bond

### นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- เน้นลงทุนในประเทศและ/หรือต่างประเทศ ในตราสารหนี้ และ/หรือ เงินฝากหรือตราสาร เทียบเท่าเงินฝาก ที่ออก รับรอง รับอาวาล หรือค้ำประกันการจ่ายเงิน โดยภาครัฐบาล รัฐวิสาหกิจ สถาบันการเงิน และ/หรือภาคเอกชน
- กองทุนอาจลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมภายใต้การจัดการของบริษัทจัดการ ในสัดส่วนไม่เกินร้อยละ 100 ของ NAV
- กองทุนอาจจะเข้าทำสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) เพื่อเพิ่มประสิทธิภาพการบริหาร การลงทุน (Efficient Portfolio Management) ซึ่งรวมถึงการป้องกันความเสี่ยง (Hedging) จากการลงทุน
- กองทุนมุ่งหวังให้ผลประกอบการสูงกว่าดัชนีชี้วัด (Active management)
- ป้องกันความเสี่ยงจากอัตราดอกเบี้ยที่ไม่น้อยกว่าร้อยละ 90 ของมูลค่าเงินลงทุนใน ต่างประเทศ

### ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (%) ต่อปี



\* ในปีที่กองทุนจัดตั้ง ผลการดำเนินงานจะแสดงตั้งแต่วันที่จัดตั้งจนถึงสิ้นปีปฏิทิน

### ระดับความเสี่ยง

ต่ำ	1	2	3	4	5	6	7	8	สูง
-----	---	---	---	---	---	---	---	---	-----

เสี่ยงปานกลางค่อนข้างต่ำ

ลงทุนในพันธบัตรรัฐบาล และตราสารหนี้เอกชน โดยมีตราสาร non-investment grade /unrated ไม่เกิน 20% ของ NAV

### ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน	21 ตุลาคม 2559
วันเริ่มต้น class	21 มิถุนายน 2564
นโยบายการจ่ายเงินปั้นผล	ไม่จ่าย
อายุกองทุน	ไม่กำหนดอายุโครงการ

### ผู้จัดการกองทุนรวม

นาย ชีรภพ จรัสศักดิ์ (30 ธันวาคม 2564)  
น.ส. พฤทิพา หนึ่งนำใจ (15 มิถุนายน 2564)

### ดัชนีชี้วัด

- ผลตอบแทนรวมสุทธิของดัชนีพันธบัตรรัฐบาลอายุน้อยกว่าเท่ากับ 10 ปี ของสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย สัดส่วน (%): 50.00 และ
- ผลตอบแทนรวมสุทธิของดัชนีตราสารหนี้ภาคเอกชน Mark-to-Market ที่มีอัตราดอกเบี้ยคงที่ เช่น อัตราดอกเบี้ยของ ธนารักษ์ ธนาคารพาณิชย์ขนาดใหญ่ ได้แก่ ธนารักษ์ กรุงเทพ ธนาคารกสิกรไทย และธนาคารไทยพาณิชย์ หลังหักภาษี สัดส่วน (%): 30.00 และ
- อัตราดอกเบี้ยเงินฝากประจำ 1 ปี วงเงินน้อยกว่า 5 ล้านบาท เคลื่อนย้ายของ ธนารักษ์ ธนาคารพาณิชย์ขนาดใหญ่ ได้แก่ ธนารักษ์ กรุงเทพ ธนาคารกสิกรไทย และธนาคารไทยพาณิชย์ หลังหักภาษี สัดส่วน (%): 10.00 และ
- ดัชนีอัตราดอกเบี้ยอ้างอิง THOR หลังหักภาษี สัดส่วน (%): 10.00

วัตถุประสงค์การอ้างอิงดัชนีชี้วัด: บริษัทจัดการใช้ดัชนีชี้วัดดังกล่าวเพื่อปรับเปลี่ยนเพิ่มผลการดำเนินงานของกองทุนรวม

### คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวมมิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อด้านทุนrit: ได้รับการรับรองจาก CAC

จัดอันดับกองทุน Morningstar ★★★★ (ข้อมูล ณ 31 มี.ค. 2568)

หนังสือชี้ชวนฉบับเดิม



ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือ บริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่อง ได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเดิม

[www.krungsriasset.com](http://www.krungsriasset.com)

## ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบบีกหมุด (%) ต่อปี)

	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี *
กองทุน	1.69	1.56	2.53	4.72
ดัชนีชี้วัด	1.74	1.62	2.35	4.36
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	1.61	1.47	2.22	3.90
ความผันผวนกองทุน	0.83	0.88	0.74	0.64
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	0.75	0.79	0.66	0.62
	3 ปี *	5 ปี *	10 ปี *	ตั้งแต่จัดตั้ง
กองทุน	3.10	N/A	N/A	2.28
ดัชนีชี้วัด	2.71	N/A	N/A	1.67
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	2.37	N/A	N/A	N/A
ความผันผวนกองทุน	0.77	N/A	N/A	0.76
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	0.99	N/A	N/A	0.98

\* ผลตอบแทนที่มีอายุกันหนึ่งปีจะแสดงเป็นผลตอบแทนต่อปี  
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกันตามกุญแจ Mid Term General Bond

### การซื้อหุ้นน่วยลงทุน

วันทำการซื้อ: ทุกวันทำการของธนาคาร

เวลาทำการ: 08:30 น. - 15:30 น.

การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ: ไม่กำหนด

การซื้อครั้งต่อไปขั้นต่ำ: ไม่กำหนด

### การขายคืนหน่วยลงทุน

วันทำการขายคืน: ทุกวันทำการของธนาคาร

เวลาทำการ: 08:30 น. - 15:30 น.

การขายคืนขั้นต่ำ: ไม่กำหนด

ยอดคงเหลือขั้นต่ำ: ไม่กำหนด

ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน: ภายใน 5 วันทำการ  
นับตั้งจากวันทำการขายคืน โดยทั่วไปจะได้รับเงิน 2 วันทำการนับตั้งจากวันทำการขายคืน (T+2)

### ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (%) ต่อปี ของ NAV)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	1.6050	0.1605
รวมค่าใช้จ่าย	2.9425	0.2529

### ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ซื้อหุ้นน่วย (%) ของมูลค่าซื้อขาย)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การขาย	ไม่เกิน 1.00	ไม่เรียกเก็บ
การรับซื้อคืน	ไม่เกิน 1.00	ไม่เรียกเก็บ
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า	ไม่เกิน 1.00	ยังไม่เปิดให้สับเปลี่ยน
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก	ไม่เกิน 1.00	ยังไม่เปิดให้สับเปลี่ยน
การโอนหน่วย	10 บาทต่อ 1,000 หน่วย	10 บาทต่อ 1,000 หน่วย

### หมายเหตุ

- ค่าธรรมเนียมดังกล่าวเป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว
- หากกองทุนลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมภายใต้การจัดการเดียวกัน บริษัทจัดการจะไม่เรียกเก็บค่าธรรมเนียมการจัดการ ค่าธรรมเนียมการขายและ/หรือรับซื้อคืนหน่วยลงทุนซึ่งกัน
- บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในกระบวนการบริหารจัดการ
- บริษัทจัดการอาจยกเว้นไม่เรียกเก็บค่าธรรมเนียมการโอนหน่วยลงทุน โดยขึ้นอยู่กับดุลยพินิจของบริษัทจัดการ

### ข้อมูลเชิงสถิติ

Maximum Drawdown	-1.68 %
Recovering Period	3 เดือน 3 วัน
FX Hedging	99.09 %
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน	1.12 เท่า
อายุเฉลี่ยของตราสารหนี้	2 ปี 5 เดือน 12 วัน

### Yield to Maturity

\* Yield to Maturity (YTM) อัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในตราสารหนี้ คำนวณจากดอกเบี้ยที่ได้รับจริง โดยมีได้ปรับสัดส่วนครึ่งปีเมื่อปีก่อนกับความเสี่ยงจากอัตราดอกเบี้ยที่เปลี่ยนไปของทำให้ผลตอบแทนจริงลดลง/หรือเพิ่มขึ้น จาก YTM ในรูปสกุลเงินบาทได้

### สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน (%) NAV)

ตราสารหนี้ที่ออกโดยนิตยัพหรือภาคเอกชน	40.18
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย	21.46
เงินฝาก หรือตราสารหนี้ที่สถาบันการเงิน เป็นผู้ออก	18.25
ตราสารภาครัฐหรือองค์กรระหว่างประเทศ ทรัพย์สินอื่น	16.61
หน่วย CIS ต่างประเทศ - ตราสารหนี้ หนี้สินอื่น	3.40
	1.13
	-1.03

### การจัดสรรการลงทุนในต่างประเทศ (%) NAV)

Singapore	4.32
Qatar	2.75
Japan	2.12
United Kingdom	2.04
China	1.51

### การจัดสรรการลงทุนใน

### ผู้ออกตราสาร 5 อันดับแรก (%) NAV)

ธนาคารแห่งประเทศไทย	21.46
กระทรวงการคลัง	16.61
The Saudi National Bank, Singapore Branch	4.32
ธนาคารอาคารสงเคราะห์	3.43
บมจ.บ้านปู	3.22

### การจัดสรรการลงทุนตามอันดับความน่าเชื่อถือ (%)

	ในประเทศไทย	National	International
AAA	47.13		
AA	9.58		
A	24.08		14.23
BBB		1.48	

## ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก

Holding	% NAV
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย品种ที่ 3/FRB364/68	4.58
ธ.อาคารสงเคราะห์	3.43
พันธบัตรรัฐบาลเพื่อการบริหารหนี้ ในปีงบประมาณ พ.ศ. 2564 ครั้งที่ 4	2.84
ตัวเงินคลังงวดที่ (DM)14/182/68	2.81
หุ้นกู้ของบริษัท โกลบลอด เพาเวอร์ ชินเนอร์ซี จำกัด (มหาชน) ครั้งที่ 1/2562 ชุดที่ 4	2.76

### คำอธิบาย

**Maximum Drawdown** เปอร์เซ็นต์ผลขาดทุนสูงสุดของกองทุนรวมในระยะเวลา 5 ปีข้อนหลัง (หรือตั้งแต่จัดตั้งกองทุนกรณีที่จัดตั้งไม่ครบ 5 ปี) โดยวัดจากระดับ NAV ต่อหน่วยที่จุดสูงสุดไปจนถึงจุดต่ำสุดในช่วงที่ NAV ต่อหน่วยปรับตัวลดลง ค่า Maximum Drawdown เป็นข้อมูลที่ช่วยให้ทราบถึงความเสี่ยงที่อาจจะขาดทุนจากการลงทุนในกองทุนรวม

**Recovering Period** ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อปืนข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาตั้งแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลานานเท่าไร

**FX Hedging** เปอร์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตกองทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลาหนึ่ง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์กับผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 1 ปีหารด้วยมูลค่า NAV ของกองทุนรวมเฉลี่ยในรอบระยะเวลาเดียวกัน กองทุนรวมที่มีค่า portfolio turnover สูง บ่งชี้ถึงการซื้อขายหลักทรัพย์บ่อยครั้งของผู้จัดการกองทุนและทำให้มีต้นทุนการซื้อขายหลักทรัพย์สูง จึงต้องพิจารณาเปรียบเทียบกับผลการดำเนินงานของกองทุนรวมเพื่อประเมินความถูกต้องของการซื้อขายหลักทรัพย์ตั้งแต่ล่า

**Sharpe Ratio** อัตราส่วนระหว่างผลตอบแทนส่วนต่างเพิ่มของกองทุนรวมเบริกน์เทียบกับความเสี่ยงจากการลงทุน โดยคำนวณจากผลต่างระหว่างอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมกับอัตราผลตอบแทนที่ปราศจากความเสี่ยง (risk-free rate) เปรียบเทียบกับค่าเบี่ยงเบนมาตรฐาน (standard deviation) ของกองทุนรวม ค่า Sharpe Ratio สะท้อนถึงอัตราผลตอบแทนที่กองทุนรวมควรได้รับเพิ่มขึ้นเพื่อ补偿ความเสี่ยงที่กองทุนรวมรับมา โดยกองทุนรวมที่มีค่า Sharpe Ratio สูงกว่าจะเป็นกองทุนที่มีประสิทธิภาพในการบริหารจัดการลงทุนที่ดีกว่าเมื่อเทียบกับกองทุนอื่นๆ

**Alpha** ผลตอบแทนส่วนต่างเกินของกองทุนรวมเมื่อเปรียบเทียบกับดัชนีชี้วัด (benchmark) โดยค่า Alpha ที่สูง หมายถึง กองทุนสามารถสร้างผลตอบแทนได้สูงกว่าดัชนีชี้วัด ซึ่งเป็นผลจากประสิทธิภาพของผู้จัดการกองทุนในการคาดเลือกหุ้นที่เหมาะสม

**Beta** ระดับแลร์กทิกทางการเงินเดียวกับขนาดของอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุน โดยเบริกน์เทียบกับอัตราผลตอบแทนของตลาด Beta น้อยกว่า 1 แสดงว่า หลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุน โดยเบริกน์เทียบกับอัตราผลตอบแทนของตลาด Beta มากกว่า 1 แสดงว่า หลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนมากกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด

**Tracking Error** อัตราผลตอบแทนของกองทุนมีประสิทธิภาพในการเดินตามดัชนีชี้วัด โดยหาก tracking error ต่ำ หมายถึงกองทุนรวมมีประสิทธิภาพในการสร้างผลตอบแทนให้ใกล้เคียงกับดัชนีชี้วัด กองทุนรวมที่มีค่า tracking error สูง จะมีอัตราผลตอบแทนโดยเฉลี่ยห่างจากดัชนีชี้วัดมากที่สุด

**Yield to Maturity** อัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในตราสารหนี้โดยอัตราดอกเบี้ยที่จะได้รับในอนาคตลดลงอย่างต่อเนื่องและเงินต้นที่จะได้รับคืนนำมายิดลดเป็นมูลค่าปัจจุบัน โดยใช้ตัวชี้วัดอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมตราสารหนี้ คำนวณจากค่าอัตราดอกเบี้ยต่อปี จึงสามารถนำไปใช้เปรียบเทียบอัตราผลตอบแทนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีนโยบายต้องการลงทุน และเนื่องจาก Yield to Maturity มีหน่วยมาตราฐานเป็นเปอร์เซ็นต์ต่อปี จึงสามารถนำไปใช้เปรียบเทียบอัตราผลตอบแทนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีนโยบายต้องการลงทุนที่ใกล้เคียงกันได้

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

## กองทุนเปิดกรุงศรีแอดดิทีฟตราสารหนี้-ผู้ลงทุนสถาบัน

หน่วยลงทุนชนิดผู้ลงทุนสถาบัน

KFAFIX-I

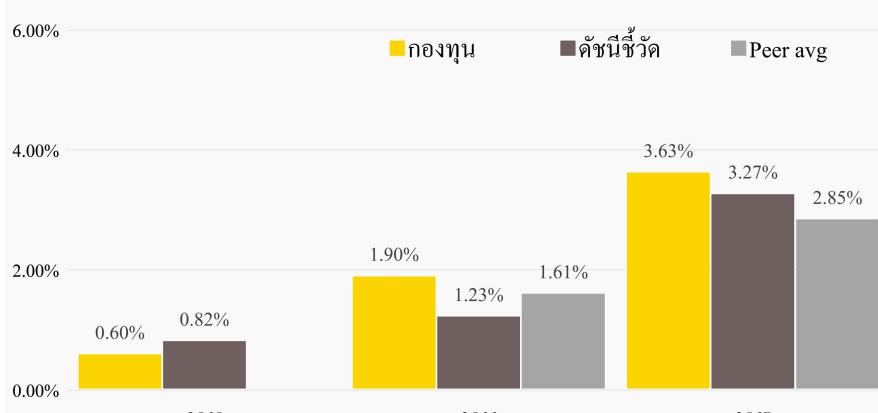
### ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมตราสารหนี้ กองทุนรวมที่มีนโยบายเปิดให้มีการลงทุนในกองทุนรวมอื่นภายใต้บลจ.เดียวกัน
- กองทุนรวมที่ลงทุนแบบมีความเสี่ยงพื้นฐานและต่างประเทศ
- กลุ่มกองทุนรวม : Mid Term General Bond

### นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- เน้นลงทุนในประเทศและ/หรือต่างประเทศ ในตราสารหนี้ และ/หรือ เงินฝากหรือตราสาร เทียบเท่าเงินฝาก ที่ออก รับรอง รับวาระ หรือค้ำประกันการจ่ายเงิน โดยภาครัฐบาล รัฐวิสาหกิจ สถาบันการเงิน และ/หรือภาคเอกชน
- กองทุนอาจลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมภายใต้การจัดการของบริษัทจัดการ ในสัดส่วนไม่เกินร้อยละ 100 ของ NAV
- กองทุนอาจจะเข้าทำสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) เพื่อเพิ่มประสิทธิภาพการบริหาร การลงทุน (Efficient Portfolio Management) ซึ่งรวมถึงการป้องกันความเสี่ยง (Hedging) จากการลงทุน
- กองทุนมุ่งหวังให้ผลประกอบการสูงกว่าดัชนีชี้วัด (Active management)
- ป้องกันความเสี่ยงจากอัตราดอกเบี้ยที่ไม่น้อยกว่าร้อยละ 90 ของมูลค่าเงินลงทุนใน ต่างประเทศ

### ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (%) ต่อปี



\* ในปีที่กองทุนจัดตั้ง ผลการดำเนินงานจะแสดงตั้งแต่วันที่จัดตั้งจนถึงสิ้นปีปฏิทิน

### ระดับความเสี่ยง

ต่ำ	1	2	3	4	5	6	7	8	สูง
-----	---	---	---	---	---	---	---	---	-----

เสี่ยงปานกลางค่อนข้างต่ำ

ลงทุนในพันธบัตรรัฐบาล และตราสารหนี้เอกชน โดยมีตราสาร non-investment grade /unrated ไม่เกิน 20% ของ NAV

### ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน	21 ตุลาคม 2559
วันเริ่มต้น class	24 พฤศจิกายน 2565
นโยบายการจ่ายเงินปัจจุบัน	ไม่จ่าย
อายุกองทุน	ไม่กำหนดอายุโครงการ

### ผู้จัดการกองทุนรวม

นาย ชีรภพ จรัสกัยกุล (24 พฤศจิกายน 2565)  
น.ส. พรพิพา หนึ่งนำใจ (24 พฤศจิกายน 2565)

### ดัชนีชี้วัด

- ผลตอบแทนรวมสุทธิของดัชนีพันธบัตรรัฐบาลอายุน้อยกว่าเท่ากับ 10 ปี ของสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย สัดส่วน (%): 50.00 และ
- ผลตอบแทนรวมสุทธิของดัชนีตราสารหนี้ภาคเอกชน Mark-to-Market ที่มีอัันดับความน่าเชื่อถือของผู้ออกตราสาร อั้งในระดับ BBB+ ขึ้นไป อายุ 1 - 3 ปี ของสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย สัดส่วน (%): 30.00 และ
- อัตราดอกเบี้ยเงินฝากประจำ 1 ปี วงเงินน้อยกว่า 5 ล้านบาท เคลี่ยงของ 3 ธนาคารพาณิชย์ขนาดใหญ่ ได้แก่ ธนาคารกรุงเทพ ธนาคารกสิกรไทย และธนาคารไทยพาณิชย์ หลังหักภาษี สัดส่วน (%): 10.00 และ
- ดัชนีอัตราดอกเบี้ยอ้างอิง THOR หลังหักภาษี สัดส่วน (%): 10.00

\* เริ่มใช้ดัชนีชี้วัดผลการดำเนินงานใหม่หลังหักภาษี (Net TRN Index) มีผลตั้งแต่วันที่ 31 ตุลาคม 2562 วัตถุประสงค์การอ้างอิงดัชนีชี้วัด: บริษัทจัดการใช้ดัชนีชี้วัดดังกล่าวเพื่อบรรลุเป้าหมายที่ขับเคลื่อนผลการดำเนินงานของกองทุนรวม

### คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวมมิได้เป็นสิ่งที่บ่งชี้ถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อศ้านทุจริต: ได้รับการรับรองจาก CAC

หนังสือชี้ชวนฉบับเดิม



ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเรื่องราวของบริษัทความเสี่ยงที่ต้องการลงทุนสถาบันได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเดิม

## ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบบีกหมุด (%) ต่อปี)

	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี *
กองทุน	1.63	1.52	2.45	4.55
ดัชนีชี้วัด	1.74	1.62	2.35	4.36
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	1.61	1.47	2.22	3.90
ความผันผวนกองทุน	0.83	0.88	0.74	0.63
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	0.75	0.79	0.66	0.62
	3 ปี *	5 ปี *	10 ปี *	ตั้งแต่จัดตั้ง
กองทุน	N/A	N/A	N/A	3.20
ดัชนีชี้วัด	N/A	N/A	N/A	2.91
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	N/A	N/A	N/A	N/A
ความผันผวนกองทุน	N/A	N/A	N/A	0.60
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	N/A	N/A	N/A	0.72

\* ผลตอบแทนที่มีอายุกันหนึ่งปีจะแสดงเป็นผลตอบแทนต่อปี  
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกันตามกุญแจ Mid Term General Bond

### การซื้อหุ้นน่วยลงทุน

วันทำการซื้อ: ทุกวันทำการของธนาคาร

เวลาทำการ: 08:30 น. - 15:30 น.

การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ: ไม่กำหนด

การซื้อครั้งต่อไปขั้นต่ำ: ไม่กำหนด

### การขายคืนหุ้นน่วยลงทุน

วันทำการขายคืน: ทุกวันทำการของธนาคาร

เวลาทำการ: 08:30 น. - 15:30 น.

การขายคืนขั้นต่ำ: ไม่กำหนด

ยอดคงเหลือขั้นต่ำ: ไม่กำหนด

ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน: ภายใน 5 วันทำการ  
นับตั้งจากวันทำการขายคืน โดยทั่วไปจะได้  
รับเงิน 2 วันทำการนับตั้งจากวันทำการขายคืน  
(T+2)

### ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (%) ต่อปี ของ NAV)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	1.6050	0.3210
รวมค่าใช้จ่าย	2.9425	0.4134

### ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ซื้อหุ้น (% ของมูลค่าซื้อขาย)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การขาย	1.00	ไม่เรียกเก็บ
การรับซื้อคืน	1.00	ไม่เรียกเก็บ
การสับเปลี่ยนหุ้นน่วยลงทุนเข้า	1.00	ไม่เรียกเก็บ
การสับเปลี่ยนหุ้นน่วยลงทุนออก	1.00	ไม่เรียกเก็บ
การโอนหน่วย	10 บาทต่อ 1,000 หน่วย	10 บาทต่อ 1,000 หน่วย

### หมายเหตุ

- ค่าธรรมเนียมดังกล่าวเป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว
- หากกองทุนลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมภายใต้การจัดการเดียวกัน บริษัทจัดการจะไม่เรียกเก็บค่าธรรมเนียม การจัดการ ค่าธรรมเนียมการขายและ/หรือรับซื้อคืนหน่วยลงทุนขึ้นชื่อ
- บริษัทจัดการขอสงวนสิทธิ์ในการยกเว้นโดยข้อความเดียวกันค่าธรรมเนียมการสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนระหว่างชนิดหน่วยลงทุนภายใต้กองทุนนี้ โดยข้อความดังกล่าวคือค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บสำหรับการซื้อขายหน่วยลงทุนที่ไม่สามารถจัดตั้งได้
- บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายใน การบริหารจัดการ
- บริษัทจัดการอาจยกเว้นไม่เรียกเก็บค่าธรรมเนียมการโอนหน่วยลงทุน โดยข้อความดังกล่าวคือค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บสำหรับการซื้อขายหน่วยลงทุนที่ไม่สามารถจัดตั้งได้

## ข้อมูลเชิงสถิติ

Maximum Drawdown	-0.34 %
Recovering Period	24 วัน
FX Hedging	99.09 %
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน	1.12 เท่า
อายุเฉลี่ยของตราสารหนี้	2 ปี 5 เดือน 12 วัน

### Yield to Maturity

2.08

\* Yield to Maturity (YTM) อัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในตราสารหนี้ คำนวณจากดอกเบี้ยที่ได้รับจริง โดยมีໄodicปรับสัดส่วนเครื่องมือปัจจัยกัน ความเสี่ยงจากอัตราดอกเบี้ยขึ้นซึ่งอาจทำให้ผลตอบแทนจริงลดลง/หรือเพิ่มขึ้น จาก YTM ในรูปสกุลเงินบาทได้

### สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน (%) NAV)

ตราสารหนี้ที่ออกโดยบริษัทหรือภาคเอกชน	40.18
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย	21.46
เงินฝาก หรือตราสารหนี้ที่สถาบันการเงิน เป็นผู้ออก	18.25
ตราสารภาครัฐหรือองค์กรระหว่างประเทศ	16.61
ทรัพย์สินอื่น	3.40
หน่วย CIS ต่างประเทศ - ตราสารหนี้ หนี้สินอื่น	1.13
	-1.03

### การจัดสรรการลงทุนในต่างประเทศ (%) NAV)

Singapore	4.32
Qatar	2.75
Japan	2.12
United Kingdom	2.04
China	1.51

### การจัดสรรการลงทุนใน

### ผู้ออกตราสาร 5 อันดับแรก (%) NAV)

ธนาคารแห่งประเทศไทย	21.46
กระทรวงการคลัง	16.61
The Saudi National Bank, Singapore Branch	4.32
ธนาคารอาคารสงเคราะห์ บมจ.บ้านปู	3.43
	3.22

### การจัดสรรการลงทุนตามอันดับความน่าเชื่อถือ (%)

	ในประเทศไทย	National	International
AAA	47.13		
AA	9.58		
A	24.08		14.23
BBB		1.48	

## ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก

Holding	% NAV
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 3/FRB364/68	4.58
ธ.อาคารสงเคราะห์	3.43
พันธบัตรรัฐบาลเพื่อการบริหารหนี้ในปีงบประมาณ พ.ศ. 2564 ครึ่งที่ 4	2.84
ตัวเงินกลังงวดที่ (DM)14/182/68	2.81
หุ้นกู้ของบริษัท โกลบลอด เพาเวอร์ ชินเนอร์ซี จำกัด (มหาชน) ครึ่งที่ 1/2562 ชุดที่ 4	2.76

- ผู้ลงทุนสามารถขอรับเงินปันผลที่มีอัตราดอกเบี้ยต่ำกว่าอัตราดอกเบี้ยของหุ้นสามัญ (Unit-Linked) ของกองทุนนี้ได้โดยคิดต่ออัตราเบี้ยรักษาภัยที่ประกันชีวิตที่บริษัทจัดการกำหนด ทั้งนี้การซื้อขายของหุ้นที่มีอัตราดอกเบี้ยต่ำกว่าอัตราดอกเบี้ยของหุ้นสามัญจะมีผลต่อผลตอบแทนของหุ้นที่ซื้อขายในแต่ละวัน

๕๖๘

**Maximum Drawdown** เปอร์เซ็นต์ลดราคาทุนสูงสุดของกองทุนรวมในระยะเวลา 5 ปีข้อนหลัง (หรือตั้งแต่ตั้งกองทุนกรณีที่ยังไม่ครบ 5 ปี) โดยวัดจากระดับ NAV ต่อหน่วยที่สูงสุดไปจนถึงต่ำสุดในช่วงเวลาที่ NAV ต่ำลงกว่าปกติแล้วลดลง ถ้า Maximum Drawdown เป็นจำนวนที่ห่วยหนาแน่นก็จะหมายความว่ามีความเสี่ยงที่กองทุนจะขาดทุนเป็นอย่างมาก

**Recovering Period** ระยะเวลาที่ต้องใช้เวลารีบูตหุ้นกลับมาอยู่ในระดับเดิมๆ หลังจากหุ้นลดลงแล้ว ค่าของหุ้นจะต้องฟื้นตัวกลับไปสู่ระดับเดิมที่เคยเป็นอยู่ก่อนหน้า

**Ex. Hedging** ปลูก เช่น เนื้อวัว คาดการณ์ว่าราคาน้ำมันสูง สลับปีนี้ต่อไป คาดว่าราคาน้ำมันจะลดลง จึงขายสินค้าในอนาคตที่ต้องขายในอดีต

**FX Hedging** เมื่อรับเข้าหุ้นการเงินทุนในต่างประเทศก็มีภาระทางการเงินมากขึ้นเรื่อยๆ ก็ต้องหาวิธีป้องกันความเสี่ยงทางการเงิน เช่น การ hedging หรือ ดักตรัพย์ กับอัตราแลกเปลี่ยนหุ้นวีเยนการลงทุน ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตคงทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลาหนึ่ง โดยคำนวนจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อหลักทรัพย์กับผลรวมของมูลค่าการขายหุ้นที่คงทุนรวมในรอบระยะเวลา 1 ปีหารด้วยมูลค่า NAV ของกองทุนรวมเฉลี่ยในรอบระยะเวลาเดียวกัน กองทุนรวมที่มีค่า portfolio turnover สูง บ่งชี้ถึงการซื้อขายหลักทรัพย์บ่อยครั้งของผู้จัดการกองทุนและทำให้มีต้นทุนการซื้อขายหลักทรัพย์ที่สูง จึงต้องพิจารณาเปรียบเทียบกับผลการดำเนินงานของกองทุนรวมเพื่อประเมินความก้าวกระโจนของกำไรซื้อขายหลักทรัพย์ดังกล่าว

**Sharpe Ratio** อัตราส่วนระหว่างผลตอบแทนส่วนเพิ่มของกองทุนรวมเบริกเทียบกับความเสี่ยงจากการลงทุน โดยคำนวณจากผลต่างระหว่างอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมกับอัตราผลตอบแทนที่ปราศจากความเสี่ยง (risk-free rate) เปรียบเทียบกับค่าเบี่ยงเบนมาตรฐาน (standard deviation) ของกองทุนรวม ค่า Sharpe Ratio จะทึบถื้งอัตราผลตอบแทนที่กองทุนรวมควรได้รับเพิ่มขึ้นเพื่อชดเชยกับความเสี่ยงที่กองทุนรวมรับไว้ โดยกองทุนรวมที่มีค่า Sharpe Ratio สูงกว่าจะเป็นกองทุนที่มีประสิทธิภาพในการบริหารจัดการลงทุนที่ดีกว่า เนื่องจากได้รับผลตอบแทนส่วนเพิ่มที่สูงกว่าภายใต้ระดับความเสี่ยงเดียวกัน

**Alpha** ผลตอบแทนส่วนต่างกันของกองทุนรวมมือเบริญที่เทียบกับดัชนีชี้วัด (benchmark) โดยค่า Alpha ที่สูง หมายถึง กองทุนสามารถสร้างผลตอบแทนได้สูงกว่าดัชนีชี้วัด ซึ่งเป็นผลจากประสิทธิภาพของผู้จัดการกองทุนในการคัดเลือกหุ้นหรือห้องประชุมที่มีประสิทธิภาพสูง

Beta ระดับและทิศทางการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุน โดยปริยมเพียงกับอัตราการเปลี่ยนแปลงของตลาด Beta น้อยกว่า 1 แสดงว่า หลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนน้อยกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด Beta มากกว่า 1 แสดงว่า หลักทรัพย์

ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนมากกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด

**Yield to Maturity** ก็ต้ารายผลตอบแทนจากการลงทุนในตราสารหนี้โดยก้อนรวมครบกำหนดอายุ ซึ่งคำนวณจากดอกเบี้ยที่จะได้รับในอนาคตตลอดอายุตราสารและเงินเดือนที่จะได้รับ

สำหรับ Yield to Maturity คือผลตอบแทนที่ได้รับจากการลงทุนในตราสารหนี้ที่มีกำหนดชำระหนี้ในอนาคต ซึ่งคำนวณโดยใช้สูตร  $\text{Yield to Maturity} = \frac{\text{จำนวนเงินที่ได้รับ} - \text{จำนวนเงินทุนเดิม}}{\text{จำนวนเงินทุนเดิม} \times \text{ระยะเวลาการลงทุน}}$  ตัวอย่างเช่น ถ้าลงทุนในตราสารหนี้ที่มีอายุ 5 ปี ให้ดอกเบี้ย 4% ต่อปี และมีมูลค่าปัจจุบัน 1,000 บาท คาดว่าจะได้รับเงิน 1,200 บาท เมื่อครบกำหนดชำระหนี้ คำนวณ Yield to Maturity ได้ดังนี้

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด  
ที่อยู่ 898 อาคารเพลินจิตทาวเวอร์ ชั้น 1-2 โซนเอ ชั้น 12 ชั้น 18 โซนบี  
ถนนเพลินจิต แขวงคลุมพินิ เขตป้อมวัน กรุงเทพฯ 10330  
โทรศัพท์ 0-2657-5757 โทรสาร 0-2657-5777  
เว็บไซต์ [www.krungsriasset.com](http://www.krungsriasset.com)

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด

## กองทุนเปิดกรุงศรีแอกซ์เพรสตราสารหนี้-เพื่อการออม

หน่วยลงทุนชนิดเพื่อการออม

KFAFIXSSF

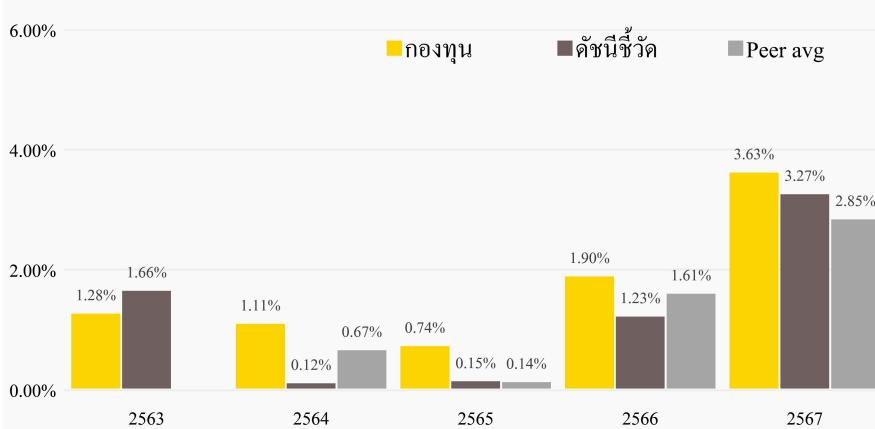
### ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมตราสารหนี้ กองทุนรวมเพื่อการออม/ กองทุนรวมที่มีนโยบายเปิดให้มีการลงทุนในกองทุนรวมอื่นภายใต้ลักษณะเดียวกัน
- กองทุนรวมที่ลงทุนแบบมีความเสี่ยงปั้นในแต่ต่างประเทศ
- กลุ่มกองทุนรวม : Mid Term General Bond

### นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- เน้นลงทุนในประเทศและ/หรือต่างประเทศ ในตราสารหนี้ และ/หรือ เงินฝากหรือตราสาร เทียบเท่าเงินฝาก ที่ออก รับรอง รับวาระ หรือค้ำประกันการจ่ายเงิน โดยภาครัฐบาล รัฐวิสาหกิจ สถาบันการเงิน และ/หรือภาคเอกชน
- กองทุนอาจลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมภายใต้การจัดการของบริษัทจัดการ ในสัดส่วนไม่เกินร้อยละ 100 ของ NAV
- กองทุนอาจจะเข้าทำสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) เพื่อเพิ่มประสิทธิภาพการบริหาร การลงทุน (Efficient Portfolio Management) ซึ่งรวมถึงการป้องกันความเสี่ยง (Hedging) จากการลงทุน
- กองทุนมุ่งหวังให้ผลประกอบการสูงกว่าดัชนีชี้วัด (Active management)
- ป้องกันความเสี่ยงจากการลดลงของเบลี่ยน ไม่น้อยกว่าร้อยละ 90 ของมูลค่าเงินลงทุนใน ต่างประเทศ

### ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (%) ต่อปี



\* ในปีที่กองทุนจัดตั้ง ผลการดำเนินงานจะแสดงตั้งแต่วันที่จัดตั้งจนถึงสิ้นปีปฏิทิน

### ระดับความเสี่ยง

ต่ำ	1	2	3	4	5	6	7	8	สูง
-----	---	---	---	---	---	---	---	---	-----

เสี่ยงปานกลางค่อนข้างต่ำ

ลงทุนในพันธบัตรรัฐบาล และตราสารหนี้อ กองชน โดยมีตราสาร non-investment grade /unrated ไม่เกิน 20% ของ NAV

### ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน	21 ตุลาคม 2559
วันเริ่มต้น class	1 เมษายน 2563
นโยบายการจ่ายเงินปั้นผล	ไม่จ่าย
อายุกองทุน	ไม่กำหนดอายุโครงการ

### ผู้จัดการกองทุนรวม

นาย ชีรภพ จรัสกุล (30 ธันวาคม 2564)  
น.ส. พฤกษา หนึ่งน้ำใจ (1 ตุลาคม 2564)

### ดัชนีชี้วัด

- ผลตอบแทนรวมสุทธิของดัชนีพันธบัตรรัฐบาลอายุ น้อยกว่าเท่ากับ 10 ปี ของสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย สัดส่วน (%): 50.00 และ
- ผลตอบแทนรวมสุทธิของดัชนีตราสารหนี้ภาคเอกชน Mark-to-Market ที่มีอัตราดอกเบี้ยคงที่ เช่น อัตราดอกเบี้ยในระดับ BBB+ ขึ้นไป อายุ 1 - 3 ปี ของสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย สัดส่วน (%): 30.00 และ
- อัตราดอกเบี้ยเงินฝากประจำ 1 ปี วงเงินน้อยกว่า 5 ล้านบาท เคลื่อนของ 3 ธนาคารพาณิชย์ขนาดใหญ่ ได้แก่ ธนาคารกรุงเทพ ธนาคารกสิกรไทย และธนาคารไทยพาณิชย์ หลังหักภาษี สัดส่วน (%): 10.00 และ
- ดัชนีอัตราดอกเบี้ยอ้างอิง THOR หลังหักภาษี สัดส่วน (%): 10.00

\* เริ่มใช้ดัชนีชี้วัดผลการดำเนินงานใหม่หลังหักภาษี (Net TRN Index) มีผลตั้งแต่วันที่ 31 ตุลาคม 2562

วัตถุประสงค์การอ้างอิงดัชนีชี้วัด: บริษัทจัดการใช้ดัชนีชี้วัดดังกล่าวเพื่อบรรลุเป้าหมายที่ขับเคลื่อนผลการดำเนินงานของกองทุนรวม

### คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวมมิได้เป็นสิ่งที่บ่งบอกถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อด้านทุจริต: ได้รับการรับรองจาก CAC

จัดอันดับกองทุน Morningstar ★★★★☆ (ข้อมูล ณ 31 มี.ค. 2568)

หนังสือชี้ชวนฉบับเดิม

ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเพิ่มเติม  
บริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่อง  
ได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเดิม



## ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบบีกหมุด (%) ต่อปี)

	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี *
กองทุน	1.63	1.52	2.45	4.55
ดัชนีชี้วัด	1.74	1.62	2.35	4.36
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	1.61	1.47	2.22	3.90
ความผันผวนกองทุน	0.83	0.88	0.74	0.64
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	0.75	0.79	0.66	0.62
	3 ปี *	5 ปี *	10 ปี *	ตั้งแต่จัดตั้ง
กองทุน	2.93	1.97	N/A	2.02
ดัชนีชี้วัด	2.71	1.55	N/A	1.60
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	2.37	1.48	N/A	N/A
ความผันผวนกองทุน	0.77	0.79	N/A	0.81
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	0.99	0.94	N/A	0.96

\* ผลตอบแทนที่มีอายุกันหนึ่งปีจะแสดงเป็นผลตอบแทนต่อปี  
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกันตามค่าเฉลี่ย Mid Term General Bond

### การซื้อหุนห่วงลงทุน

วันทำการซื้อ: ปิดรับรายการซื้อ/สับเปลี่ยนเข้า  
จากกองทุนอื่นที่มีใช้ SSF

เวลาทำการ: 08:30 น. - 15:30 น.

การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ: 500 บาท

การซื้อครั้งต่อไปขั้นต่ำ: 500 บาท

### การขายคืนหุนห่วงลงทุน

วันทำการขายคืน: ทุกวันทำการของธนาคาร

เวลาทำการ: 08:30 น. - 15:30 น.

การขายคืนขั้นต่ำ: ไม่มี

ยอดคงเหลือขั้นต่ำ: ไม่มี

ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน: ภายใน 5 วันทำการ  
นับตั้งจากวันทำการขายคืน โดยทั่วไปจะได้  
รับเงิน 2 วันทำการนับตั้งจากวันทำการขายคืน  
(T+2)

### หมายเหตุ

- บริษัทจัดการปิดรับคำสั่งซื้อ และ/หรือสับเปลี่ยนเข้ากองทุน จากกองทุนอื่นที่มีใช้กองทุนเพื่อการออม และหน่วยลงทุนชนิดเพื่อการออม ตั้งแต่วันที่ 2 มกราคม 2568 เป็นต้นไป

### ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (%) ต่อปี ของ NAV)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	1.6050	0.3210
รวมค่าใช้จ่าย	2.9425	0.4134

### ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหุนห่วง (% ของมูลค่าซื้อขาย)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การขาย	ไม่เกิน 1.00	ไม่มี
การรับซื้อคืน	ไม่เกิน 1.00	ไม่มี
การสับเปลี่ยนหุนห่วงลงทุนเข้า	ไม่เกิน 1.00	ไม่มี
การสับเปลี่ยนหุนห่วงลงทุนออก	ไม่เกิน 1.00	ไม่มี
การโอนหุนห่วง	ไม่มี	ไม่มี
ค่าปรับกรณีขายคืนและสับเปลี่ยนออก ก่อนระยะเวลาที่กำหนด	0.50	0.50 กรณีถือหุนห่วงลงทุนน้อย กว่า 3 ปี
ค่าใช้จ่ายในการซื้อขายหลักทรัพย์ เมื่อมีการสั่งซื้อขาย สับเปลี่ยนหุนห่วงลงทุน	ไม่มี	ไม่มี

### ข้อมูลเชิงสถิติ

Maximum Drawdown	-1.73 %
Recovering Period	3 เดือน 9 วัน
FX Hedging	99.09 %
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน	1.12 เท่า
อายุเฉลี่ยของตราสารหนี้	2 ปี 5 เดือน 12 วัน
<b>Yield to Maturity</b>	<b>2.08</b>

\* Yield to Maturity (YTM) อัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในตราสารหนี้ คำนวณจากดอกเบี้ยที่ได้รับจริง โดยมีได้ปรับสัดส่วนเครื่องมือป้องกัน ความเสี่ยงจากอัตราดอกเบี้ยขึ้นซึ่งอาจทำให้ผลตอบแทนจริงลดลง/หรือ เพิ่มขึ้น จาก YTM ในรูปสกุลเงินบาทได้

### สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน (%) NAV)

ตราสารหนี้ที่ออกโดยบริษัทหรือภาคเอกชน	40.18
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย	21.46
เงินฝาก หรือตราสารหนี้ที่สถาบันการเงิน เป็นผู้ออก	18.25
ตราสารภาครัฐหรือองค์กรระหว่างประเทศ	16.61
ทรัพย์สินอื่น	3.40
หน่วย CIS ต่างประเทศ - ตราสารหนี้ หนี้สินอื่น	1.13
	-1.03

### การจัดสรรการลงทุนในต่างประเทศ (%) NAV)

Singapore	4.32
Qatar	2.75
Japan	2.12
United Kingdom	2.04
China	1.51

### การจัดสรรการลงทุนใน

ผู้ออกตราสาร 5 อันดับแรก (%) NAV)	
ธนาคารแห่งประเทศไทย	21.46
กระทรวงการคลัง	16.61
The Saudi National Bank, Singapore Branch	4.32
ธนาคารอาชาร์สิงคโปร์ บมจ.บ้านปู	3.43
	3.22

### การจัดสรรการลงทุนตามอันดับความน่าเชื่อถือ (%)

	ในประเทศไทย	National	International
AAA	47.13		
AA	9.58		
A	24.08		
BBB	14.23		
	1.48		

## หมายเหตุ

- ค่าธรรมเนียมดังกล่าวเป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว
- บริษัทจัดการจะไม่เรียกเก็บค่าปรับกรณีขาดทุนและสัมปเลี่ยนออกจากกองทุน เนื่องจากกรณีที่เป็นการสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนระหว่างกองทุนรวมเพื่อการออมด้วยกัน ทั้งภายในตัวบริหารของบริษัทจัดการและบริษัทจัดการอื่น
- บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายใน การบริหารจัดการ

## ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก

Holding	% NAV
พันธบัตรธนารักษ์แห่งประเทศไทย 3/FRB364/68	4.58
ธ.ธนาคารส่งเสริมการค้า จำกัด (มหาชน) ครั้งที่ 4	3.43
พันธบัตรรัฐบาลเพื่อการบริหารหนี้ ในปีงบประมาณ พ.ศ. 2564 ครั้งที่ 4	2.84
ตัวเงินคลังภาครัฐ (DM)14/182/68	2.81
หุ้นกู้ของบริษัท โกลบล อเพเวอร์ ชิโนเนอร์ชี จำกัด (มหาชน) ครั้งที่ 1/2562 ชุดที่ 4	2.76

## คำอธิบาย

**Maximum Drawdown** เปอร์เซ็นต์ลดราคาค่าหุ้นลงสูงสุดของกองทุนรวมในระยะเวลา 5 ปีข้างหลัง (หรือตั้งแต่จัดตั้งกองทุนกรณีที่ยังไม่ครบ 5 ปี) โดยวัดจากราคาดับ NAV ต่อหน่วยที่จุดสูงสุดไปจนถึงจุดต่ำสุดในช่วงที่ NAV ต่อหน่วยปรับตัวลดลง ค่า Maximum Drawdown เป็นข้อมูลที่ช่วยให้ทราบถึงความเสี่ยงที่อาจขาดทุนจากการลงทุนในกองทุนรวม

**Recovering Period** ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาตั้งแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นได้รับผลตอบแทนเท่าไหร่

**FX Hedging** เปอร์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการบังคับความเสี่ยงจากการแลกเปลี่ยน

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตกองทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลาหนึ่ง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างหัวใจของมูลค่าการซื้อหลักทรัพย์กับผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 1 ปีหารด้วยมูลค่า NAV ของกองทุนรวมเฉลี่ยในรอบระยะเวลาเดียวกัน กองทุนรวมที่มีค่า portfolio turnover สูง บ่งชี้ถึงการซื้อขายหลักทรัพย์บ่อยครั้งของผู้จัดการกองทุนและทำให้มีค่านิรันดร์การซื้อขายหลักทรัพย์ที่สูง จึงต้องพิจารณาเปรียบเทียบกับผลการดำเนินงานของกองทุนรวมเพื่อประเมินความคุ้มค่าของการซื้อขายหลักทรัพย์ดังกล่าว

**Sharpe Ratio** อัตราส่วนระหว่างผลตอบแทนส่วนเพิ่มของกองทุนรวมเปรียบเทียบกับความเสี่ยงจากการลงทุน โดยคำนวณจากผลต่างระหว่างอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมกับอัตราผลตอบแทนที่ปราศจากความเสี่ยง (risk-free rate) เปรียบเทียบกับค่าเบี่ยงเบนมาตรฐาน (standard deviation) ของกองทุนรวม ค่า Sharpe Ratio สะท้อนถึงอัตราผลตอบแทนที่กองทุนรวมควรได้รับเพิ่มขึ้นเพื่อชดเชยกับความเสี่ยงที่กองทุนรวมรับมา โดยกองทุนรวมที่มีค่า Sharpe Ratio สูงกว่าจะเป็นกองทุนที่มีประสิทธิภาพในการบริหารจัดการลงทุนที่ดีกว่าเมื่อจากได้รับผลตอบแทนส่วนเพิ่มที่สูงกว่าภายใต้ระดับความเสี่ยงเดียวกัน

**Alpha** ผลตอบแทนส่วนเกินของกองทุนรวมเมื่อเปรียบเทียบกับดัชนีชี้วัด (benchmark) โดยค่า Alpha ที่สูง หมายถึง กองทุนสามารถสร้างผลตอบแทนได้สูงกว่าดัชนีชี้วัด ซึ่งเป็นผลจากประสิทธิภาพของผู้จัดการกองทุนในการคัดเลือกหุ้นที่อาจให้ผลตอบแทนสูงกว่าตลาดโดยรวม

**Beta** ระดับและทิศทางการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุน โดยเปรียบเทียบกับอัตราการเปลี่ยนแปลงของตลาด Beta น้อยกว่า 1 แสดงว่า หลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนน้อยกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด Beta มากกว่า 1 แสดงว่า หลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนมากกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด

**Tracking Error** อัตราผลตอบแทนของกองทุนมีประสิทธิภาพในการเลียนแบบดัชนีชี้วัด โดยหาก tracking error ต่ำ หมายถึงกองทุนรวมมีประสิทธิภาพในการสร้างผลตอบแทนให้ใกล้เคียงกับดัชนีชี้วัด กองทุนรวมที่มีค่า tracking error สูง จะมีอัตราผลตอบแทนโดยเฉลี่ยห่างจากดัชนีชี้วัดมากที่สุด

**Yield to Maturity** อัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในตราสารหนี้โดยอัตราดอกเบี้ยที่จะได้รับในอนาคตตลอดอายุตราสารและเงินต้นที่จะได้รับคืนนำมายิดด์เป็นมูลค่าปัจจุบัน โดยใช้วัดอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมตราสารหนี้ คำนวณจากค่าเฉลี่ยต่อวันของ Yield to Maturity ของตราสารหนี้เดือนต่อเดือนที่กองทุนมีการลงทุน และเนื่องจาก Yield to Maturity มีหน่วยมาตราฐานเป็นเปอร์เซ็นต์ต่อปี จึงสามารถนำไปใช้เปรียบเทียบอัตราผลตอบแทนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีนโยบายต้องการลงทุนลงทุนด้วยหุ้นและมีลักษณะการลงทุนที่ใกล้เคียงกันได้

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด  
ที่อยู่ 898 อาคารเพลินจิตทาวเวอร์ ชั้น 1-2 โซนเอ ชั้น 12 ชั้น 18 โซนบี  
ถนนเพลินจิต แขวงคลุมพินี เขตปทุมวัน กรุงเทพฯ 10330

โทรศัพท์ 0-2657-5757 โทรสาร 0-2657-5777  
เว็บไซต์: www.krungsriasset.com