

## กองทุนเปิดกรุงศรีไทยออลสตาร์-สะสมมูลค่า

หน่วยลงทุนชนิดสะสมมูลค่า  
KFTSTAR-A

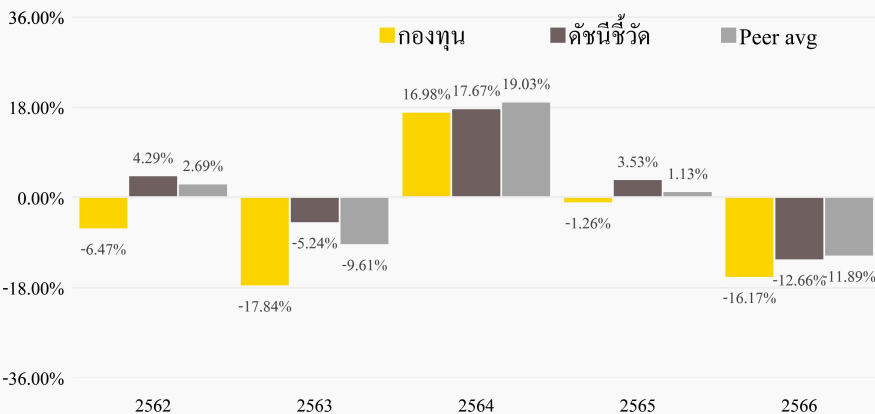
### ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมตราสารทุน
- กองทุนรวมที่เน้นลงทุนแบบไม่มีความเสี่ยงในต่างประเทศ
- กลุ่มกองทุนรวม : Equity General

### นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- ลงทุนในตราสารแห่งทุนโดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV โดยจะลงทุนในหุ้นจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET) และหรือตลาดหลักทรัพย์ MAI และ/หรือสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) ที่อ้างอิงกับผลตอบแทนของหุ้นหรือกลุ่มบริษัทจดทะเบียนฯ โดยพิจารณาบริษัทที่มีปัจจัยพื้นฐานดี และ/หรือมีแนวโน้มการเจริญเติบโตทางธุรกิจ หรือมีแนวโน้มการจ่ายปันผลที่ดี ทั้งนี้รวมถึงหุ้นที่อยู่ระหว่าง IPO ด้วย
- กองทุนอาจจะเข้าทำสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) เพื่อเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน (Efficient Portfolio Management) ซึ่งรวมถึงการป้องกันความเสี่ยง (Hedging) จากการลงทุน
- กองทุนมุ่งหวังให้ผลประกอบการสูงกว่าดัชนีชี้วัด (Active management)

### ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (% ต่อปี)



\* ในปีที่กองทุนจัดตั้ง ผลการดำเนินงานจะแสดงตั้งแต่วันที่จัดตั้งจนถึงสิ้นปีปฏิทิน

### ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด (% ต่อปี)

	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี *
กองทุน	3.04	4.99	5.66	-5.55
ดัชนีชี้วัด	-1.65	2.05	0.95	-7.50
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	-1.86	2.12	0.06	-7.62
ความผันผวนกองทุน	12.55	12.39	12.20	12.50
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	11.24	11.06	11.22	11.61
	3 ปี *	5 ปี *	10 ปี *	ตั้งแต่จัดตั้ง
กองทุน	-4.73	-6.20	N/A	-6.80
ดัชนีชี้วัด	-1.86	-0.98	N/A	-0.47
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	-2.84	-1.95	N/A	N/A
ความผันผวนกองทุน	11.70	16.39	N/A	15.53
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	11.32	16.79	N/A	15.60

\* ผลตอบแทนที่มีอายุเกินหนึ่งปีจะแสดงผลตอบแทนต่อปี

ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกันตามกลุ่ม Equity General

### ระดับความเสี่ยง



ลงทุนในตราสารทุนเป็นหลักโดยเฉลี่ยในรอบปี  
ไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV

### ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน	20 มีนาคม 2560
วันเริ่มต้น class	20 มีนาคม 2560
นโยบายการจ่ายเงินปันผล	ไม่จ่าย
อายุกองทุน	ไม่กำหนดอายุโครงการ

### ผู้จัดการกองทุนรวม

นาย ทลิต โชคทิพย์พัฒนา (1 ตุลาคม 2564)

นาย เอกชัย บุญยะพงค์ไชย (15 พฤศจิกายน 2566)

### ดัชนีชี้วัด

ดัชนีผลตอบแทนรวมตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET TRI)  
วัตถุประสงค์การอ้างอิงดัชนีชี้วัด: บริษัทจัดการใช้ดัชนีชี้วัดดังกล่าวเพื่อเปรียบเทียบผลการดำเนินงานของกองทุนรวม

### คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวมมิได้เป็น  
สิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต: ได้รับการรับรองจาก CAC

จัดอันดับกองทุน Morningstar ★ (ข้อมูล ณ 29 มี.ค. 2567)

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือ  
บริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่อง  
ได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

www.krungsriasset.com

## การซื้อขายหน่วยลงทุน

วันทำการซื้อ: ทุกวันทำการของธนาคาร

เวลาทำการ: 08:30 น. - 15:30 น.

การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ: 500 บาท

การซื้อครั้งถัดไปขั้นต่ำ: 500 บาท

## การขายคืนหน่วยลงทุน

วันทำการขายคืน: ทุกวันทำการของธนาคาร

เวลาทำการ: 08:30 น. - 15:30 น.

การขายคืนขั้นต่ำ: 500 บาทหรือ 50 หน่วย

ยอดคงเหลือขั้นต่ำ: 50 หน่วย

ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน: ภายใน 5 วันทำการ

นับถัดจากวันทำการขายคืน โดยทั่วไปจะได้

รับเงิน 3 วันทำการนับถัดจากวันทำการขายคืน

(T+3)

## ข้อมูลเชิงสถิติ

Maximum Drawdown	-43.19 %
Recovering Period	0.00
FX Hedging	ยังไม่มีการลงทุนในต่างประเทศ
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน	166.19 %
Sharpe Ratio	-0.51
Alpha	-2.87 %
Beta	1.03
Tracking Error	N/A

## ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปี ของ NAV)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	2.6750	2.1400
รวมค่าใช้จ่าย	5.0825	2.3289

## ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การขาย	ไม่เกิน 1.50	1.00
การรับซื้อคืน	ไม่เกิน 1.50	ไม่เรียกเก็บ
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า	ไม่เกิน 1.50	1.00
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก	ไม่เกิน 1.50	ไม่เรียกเก็บ
การโอนหน่วย	10 บาทต่อ 1,000 หน่วย	10 บาทต่อ 1,000 หน่วย

## หมายเหตุ

- ค่าธรรมเนียมดังกล่าวเป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว
- บริษัทจัดการขอสงวนสิทธิในการยกเว้น โดยไม่เรียกเก็บค่าธรรมเนียมการสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนระหว่างชนิดหน่วยลงทุนภายใต้กองทุนเดียวกัน ให้แก่ผู้ถือหน่วยลงทุนที่ประสงค์จะสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนระหว่างชนิดหน่วยลงทุนของกองทุนนี้

## ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก

Holding	% NAV
บมจ.ซีพี ออลล์	7.23
บมจ.ไอ-เทล คอร์ปอเรชั่น	5.01
บมจ.ไมเนอร์ อินเตอร์เนชั่นแนล	4.48
บมจ.คาราบาวกรุ๊ป	4.11
บมจ.เอสซีจี แพคเกจจิ้ง	3.97

## สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน (% NAV)

ตราสารทุนและหน่วยลงทุน	96.51
ทรัพย์สินอื่น	3.02
เงินฝาก หรือตราสารหนี้ที่สถาบันการเงินเป็นผู้ออก	2.19
หนี้สินอื่น	-1.72

## การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม (% NAV)

หมวดอาหารและเครื่องดื่ม	19.39
หมวดพาณิชย์	15.77
หมวดธนาคาร	9.82
หมวดการท่องเที่ยวและสันทนาการ	9.35
หมวดพลังงานและสาธารณูปโภค	8.80

## คำอธิบาย

**Maximum Drawdown** เปรอ์เซ็นต์ผลขาดทุนสูงสุดของกองทุนรวมในระยะเวลา 5 ปีย้อนหลัง (หรือตั้งแต่จัดตั้งกองทุนกรณีที่ยังไม่ครบ 5 ปี) โดยวัดจากระดับ NAV ต่อหน่วยที่จุดสูงสุดไปจนถึงจุดต่ำสุดในช่วงที่ NAV ต่อหน่วยปรับตัวลดลง ค่า Maximum Drawdown เป็นข้อมูลที่ช่วยให้ทราบถึงความเสี่ยงที่อาจจะขาดทุนจากการลงทุนในกองทุนรวม

**Recovering Period** ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาตั้งแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้เวลานานเท่าใด

**FX Hedging** เปรอ์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

**อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน** ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลานึง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์กับผลรวมของมูลค่าการขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 1 ปีหารด้วยมูลค่า NAV ของกองทุนรวมเฉลี่ยในรอบระยะเวลาเดียวกัน กองทุนรวมที่มีค่า portfolio turnover สูงบ่งชี้ถึงการซื้อขายหลักทรัพย์บ่อยครั้งของผู้จัดการกองทุนและทำให้มีต้นทุนการซื้อขายหลักทรัพย์ที่สูง จึงต้องพิจารณาเปรียบเทียบกับผลการดำเนินงานของกองทุนรวมเพื่อประเมิน

ความคุ้มค่าของการซื้อขายหลักทรัพย์ดังกล่าว

**Sharpe Ratio** อัตราส่วนระหว่างผลตอบแทนส่วนเพิ่มของกองทุนรวมเปรียบเทียบกับความเสี่ยงจากการลงทุน โดยคำนวณจากผลต่างระหว่างอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมกับอัตราผลตอบแทนที่ปราศจากความเสี่ยง (risk-free rate) หารด้วยค่าเบี่ยงเบนมาตรฐาน (standard deviation) ของกองทุนรวม ค่า Sharpe Ratio สะท้อนถึงอัตราผลตอบแทนที่กองทุนรวมควรได้รับเพิ่มขึ้นเพื่อชดเชยกับความเสี่ยงที่กองทุนรวมรับมา โดยกองทุนรวมที่มีค่า Sharpe Ratio สูงกว่าจะเป็นกองทุนที่มีประสิทธิภาพในการบริหารจัดการลงทุนที่ดีกว่า เนื่องจากได้รับผลตอบแทนส่วนเพิ่มที่สูงกว่าภายใต้ระดับความเสี่ยงเดียวกัน

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

**Beta** ระดับและทิศทางของการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุน โดยเปรียบเทียบกับอัตราการเปลี่ยนแปลงของตลาด Beta น้อยกว่า 1 แสดงว่าหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนน้อยกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด Beta มากกว่า 1 แสดงว่า หลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนมากกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด

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

**Yield to Maturity** อัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในตราสารหนี้โดยถือจนครบกำหนดอายุ ซึ่งคำนวณจากดอกเบี้ยที่จะได้รับในอนาคตตลอดอายุตราสารและเงินต้นที่จะได้รับคืนนำมาคิดลดเป็นมูลค่าปัจจุบัน โดยใช้ตัวอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมตราสารหนี้ คำนวณจากค่าเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักของ Yield to Maturity ของตราสารหนี้แต่ละตัวที่กองทุนมีการลงทุน และเนื่องจาก Yield to Maturity มีหน่วยมาตรฐานเป็นเปอร์เซ็นต์ต่อปี จึงสามารถนำไปใช้เปรียบเทียบอัตราผลตอบแทนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีนโยบายถือครองตราสารหนี้จนครบกำหนดอายุและมีลักษณะการลงทุนที่ใกล้เคียงกันได้

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด

ที่อยู่ 898 อาคารเพลินจิตทาวเวอร์ ชั้น 1-2 โชนเอ ชั้น 12 ชั้น 18 โชนบี

ถนนเพลินจิต แขวงลุมพินี เขตปทุมวัน กรุงเทพฯ 10330

โทรศัพท์ 0-2657-5757 โทรสาร 0-2657-5777

เว็บไซต์: www.krungsriasset.com

## กองทุนเปิดกรุงศรีไทยออลสตาร์-ปันผล

หน่วยลงทุนชนิดจ่ายปันผล  
KFTSTAR-D

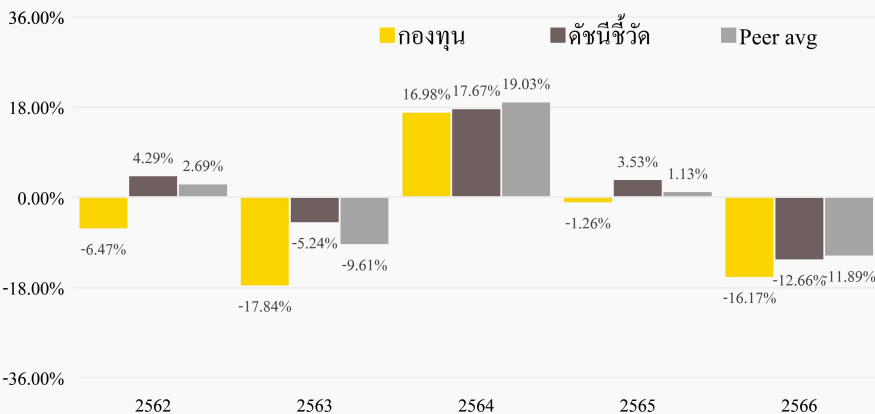
### ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมตราสารทุน
- กองทุนรวมที่เน้นลงทุนแบบไม่มีความเสี่ยงในต่างประเทศ
- กลุ่มกองทุนรวม : Equity General

### นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- ลงทุนในตราสารแห่งทุนโดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV โดยจะลงทุนในหุ้นจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET) และหรือตลาดหลักทรัพย์ MAI และ/หรือสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) ที่อ้างอิงกับผลตอบแทนของหุ้นหรือกลุ่มบริษัทจดทะเบียนฯ โดยพิจารณาบริษัทที่มีปัจจัยพื้นฐานดี และ/หรือมีแนวโน้มการเจริญเติบโตทางธุรกิจ หรือมีแนวโน้มการจ่ายปันผลที่ดี ทั้งนี้รวมถึงหุ้นที่อยู่ระหว่าง IPO ด้วย
- กองทุนอาจจะเข้าทำสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) เพื่อเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน (Efficient Portfolio Management) ซึ่งรวมถึงการป้องกันความเสี่ยง (Hedging) จากการลงทุน
- กองทุนมุ่งหวังให้ผลประกอบการสูงกว่าดัชนีชี้วัด (Active management)

### ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (% ต่อปี)



\* ในปีที่กองทุนจัดตั้ง ผลการดำเนินงานจะแสดงตั้งแต่วันที่จัดตั้งจนถึงสิ้นปีปฏิทิน

### ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด (% ต่อปี)

	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี *
กองทุน	3.04	5.00	5.66	-5.55
ดัชนีชี้วัด	-1.65	2.05	0.95	-7.50
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	-1.86	2.12	0.06	-7.62
ความผันผวนกองทุน	12.55	12.39	12.20	12.50
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	11.24	11.06	11.22	11.61
	3 ปี *	5 ปี *	10 ปี *	ตั้งแต่จัดตั้ง
กองทุน	-4.73	-6.20	N/A	-4.26
ดัชนีชี้วัด	-1.86	-0.98	N/A	1.29
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	-2.84	-1.95	N/A	N/A
ความผันผวนกองทุน	11.70	16.39	N/A	15.04
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	11.32	16.79	N/A	15.01

\* ผลตอบแทนที่มีอายุเกินหนึ่งปีจะแสดงผลตอบแทนต่อปี

ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกันตามกลุ่ม Equity General

### ระดับความเสี่ยง



ลงทุนในตราสารทุนเป็นหลักโดยเฉลี่ยในรอบปี  
ไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV

### ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน	20 มีนาคม 2560
วันเริ่มต้น class	20 มีนาคม 2560
นโยบายการจ่ายเงินปันผล	จ่าย
อายุกองทุน	ไม่กำหนดอายุโครงการ

### ผู้จัดการกองทุนรวม

นาย ทลิต โชคทิพย์พัฒนา (1 ตุลาคม 2564)

นาย เอกชัย บุญยะพงค์ไชย (15 พฤศจิกายน 2566)

### ดัชนีชี้วัด

ดัชนีผลตอบแทนรวมตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET TRI)  
วัตถุประสงค์การอ้างอิงดัชนีชี้วัด: บริษัทจัดการใช้ดัชนีชี้วัดดังกล่าวเพื่อเปรียบเทียบผลการดำเนินงานของกองทุนรวม

### คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวมมิได้เป็น  
สิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต: ได้รับการรับรองจาก CAC

จัดอันดับกองทุน Morningstar ★ (ข้อมูล ณ 29 มี.ค. 2567)

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือ  
บริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่อง  
ได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

www.krungsriasset.com

**การซื้อขายหน่วยลงทุน**

วันทำการซื้อ: ทุกวันทำการของธนาคาร

เวลาทำการ: 08:30 น. - 15:30 น.

การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ: 500 บาท

การซื้อครั้งถัดไปขั้นต่ำ: 500 บาท

**การขายคืนหน่วยลงทุน**

วันทำการขายคืน: ทุกวันทำการของธนาคาร

เวลาทำการ: 08:30 น. - 15:30 น.

การขายคืนขั้นต่ำ: 500 บาทหรือ 50 หน่วย

ยอดคงเหลือขั้นต่ำ: 50 หน่วย

ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน: ภายใน 5 วันทำการ

นับถัดจากวันทำการขายคืน โดยทั่วไปจะได้

รับเงิน 3 วันทำการนับถัดจากวันทำการขายคืน

(T+3)

**ข้อมูลเชิงสถิติ**

Maximum Drawdown	-43.19 %
Recovering Period	0.00
FX Hedging	ยังไม่มีการลงทุนในต่างประเทศ
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน	166.19 %
Sharpe Ratio	-0.51
Alpha	-2.87 %
Beta	1.03
Tracking Error	N/A

**ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปี ของ NAV)**

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	2.6750	2.1400
รวมค่าใช้จ่าย	5.0825	2.3289

**ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)**

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การขาย	ไม่เกิน 1.50	1.00
การรับซื้อคืน	ไม่เกิน 1.50	ไม่เรียกเก็บ
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า	ไม่เกิน 1.50	1.00
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก	ไม่เกิน 1.50	ไม่เรียกเก็บ
การโอนหน่วย	10 บาทต่อ 1,000 หน่วย	10 บาทต่อ 1,000 หน่วย

**หมายเหตุ**

- ค่าธรรมเนียมดังกล่าวเป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว
- บริษัทจัดการขอสงวนสิทธิในการยกเว้น โดยไม่เรียกเก็บค่าธรรมเนียมการสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนระหว่างชนิดหน่วยลงทุนภายใต้กองทุนเดียวกัน ให้แก่ผู้ถือหน่วยลงทุนที่ประสงค์จะสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนระหว่างชนิดหน่วยลงทุนของกองทุนนี้

**ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก**

Holding	% NAV
บมจ.ซีพี ออลล์	7.23
บมจ.ไอ-เทล คอร์ปอเรชั่น	5.01
บมจ.ไมเนอร์ อินเตอร์เนชั่นแนล	4.48
บมจ.คาราบาวกรุ๊ป	4.11
บมจ.เอสซีจี แพคเกจจิ้ง	3.97

**สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน (% NAV)**

ตราสารทุนและหน่วยลงทุน	96.51
ทรัพย์สินอื่น	3.02
เงินฝาก หรือตราสารหนี้ที่สถาบันการเงินเป็นผู้ออก	2.19
หนี้สินอื่น	-1.72

**การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม (% NAV)**

หมวดอาหารและเครื่องดื่ม	19.39
หมวดพาณิชย์	15.77
หมวดธนาคาร	9.82
หมวดการท่องเที่ยวและสันทนาการ	9.35
หมวดพลังงานและสาธารณูปโภค	8.80

## คำอธิบาย

**Maximum Drawdown** เปรอ์เซ็นต์ผลขาดทุนสูงสุดของกองทุนรวมในระยะเวลา 5 ปีย้อนหลัง (หรือตั้งแต่จัดตั้งกองทุนกรณีที่ยังไม่ครบ 5 ปี) โดยวัดจากระดับ NAV ต่อหน่วยที่จุดสูงสุดไปจนถึงจุดต่ำสุดในช่วงที่ NAV ต่อหน่วยปรับตัวลดลง ค่า Maximum Drawdown เป็นข้อมูลที่ช่วยให้ทราบถึงความเสี่ยงที่อาจจะขาดทุนจากการลงทุนในกองทุนรวม

**Recovering Period** ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาตั้งแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้เวลานานเท่าใด

**FX Hedging** เปรอ์เซ็นต์ของกรลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

**อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน** ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลานึง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์กับผลรวมของมูลค่าการขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 1 ปีหารด้วยมูลค่า NAV ของกองทุนรวมเฉลี่ยในรอบระยะเวลาเดียวกัน กองทุนรวมที่มีค่า portfolio turnover สูงบ่งชี้ถึงการซื้อขายหลักทรัพย์บ่อยครั้งของผู้จัดการกองทุนและทำให้มีต้นทุนการซื้อขายหลักทรัพย์ที่สูง จึงต้องพิจารณาเปรียบเทียบกับผลการดำเนินงานของกองทุนรวมเพื่อประเมิน

ความคุ้มค่าของการซื้อขายหลักทรัพย์ดังกล่าว

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

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

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

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

**Yield to Maturity** อัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในตราสารหนี้โดยถือจนครบกำหนดอายุ ซึ่งคำนวณจากดอกเบี้ยที่จะได้รับในอนาคตตลอดอายุตราสารและเงินต้นที่จะได้รับคืนนำมาคิดลดเป็นมูลค่าปัจจุบัน โดยใช้ตัวอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมตราสารหนี้ คำนวณจากค่าเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักของ Yield to Maturity ของตราสารหนี้แต่ละตัวที่กองทุนมีการลงทุน และเนื่องจาก Yield to Maturity มีหน่วยมาตรฐานเป็นเปอร์เซ็นต์ต่อปี จึงสามารถนำไปใช้เปรียบเทียบอัตราผลตอบแทนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีนโยบายถือครองตราสารหนี้จนครบกำหนดอายุและมีลักษณะการลงทุนที่ใกล้เคียงกันได้

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด

ที่อยู่ 898 อาคารเพลินจิตทาวเวอร์ ชั้น 1-2 โชนเอ ชั้น 12 ชั้น 18 โชนบี

ถนนเพลินจิต แขวงลุมพินี เขตปทุมวัน กรุงเทพฯ 10330

โทรศัพท์ 0-2657-5757 โทรสาร 0-2657-5777

เว็บไซต์: www.krungsriasset.com