

## กองทุนเปิดกรุงศรีตราสารหนี้ระยะกลาง

KFMTFI

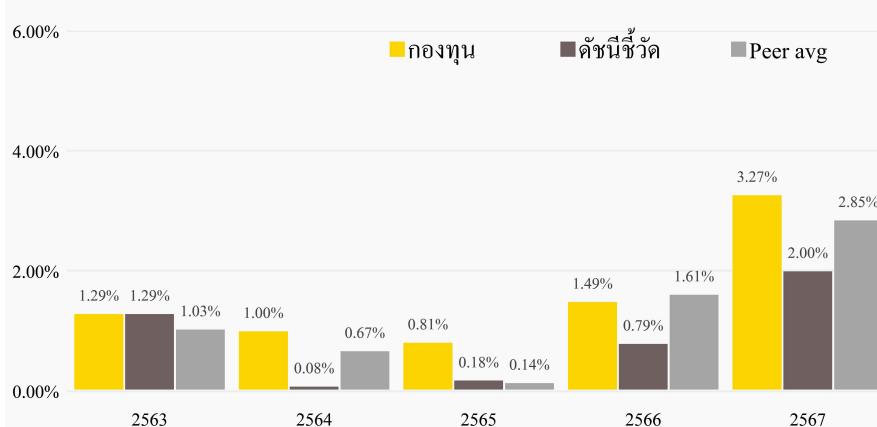
### ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมตราสารหนี้
- กองทุนรวมที่ลงทุนแบบมีความเสี่ยงปั้นในแต่ต่างประเทศ
- กลุ่มกองทุนรวม : Mid Term General Bond

### นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- ลงทุนในประเทศในตราสารหนี้ภาครัฐโดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่า 50% ของ NAV
- ส่วนที่เหลือจะลงทุนในเงินฝากธนาคาร หรือตราสารหนี้ของธนาคารพาณิชย์ รัฐวิสาหกิจ หรือบริษัทเอกชนทั่วไปซึ่งมีอัตราดอกเบี้ยไม่น้อยกว่า 2% ของ NAV ตั้งแต่ A- หรือระดับ F2, T2 ขึ้นไป
- กองทุนอาจลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเพื่อเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน (Efficient Portfolio Management) โดยหันอยู่กับคุณภาพของผู้จัดการกองทุน
- กองทุนมุ่งหวังให้ผลประกอบการสูงกว่าดัชนีชี้วัด (Active management)
- ป้องกันความเสี่ยงจากอัตราดอกเบี้ยที่สูงกว่า 90 ของมูลค่าเงินลงทุนในต่างประเทศ

### ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (%) ต่อปี)



\* ในปีที่กองทุนขาดด้วยผลการดำเนินงานจะแสดงตั้งแต่วันที่จัดตั้งจนถึงสิ้นปีปฏิทิน

### ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปั๊กหมุด (%) ต่อปี)

	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี *
กองทุน	1.18	1.18	2.20	3.65
ดัชนีชี้วัด	0.67	0.67	1.19	2.05
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	1.20	1.20	2.07	3.30
ความผันผวนกองทุน	0.77	0.77	0.68	0.62
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	0.21	0.21	0.19	0.21
	3 ปี *	5 ปี *	10 ปี *	ตั้งแต่จัดตั้ง
กองทุน	2.27	1.71	1.83	2.55
ดัชนีชี้วัด	1.27	0.89	2.23	3.07
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	1.99	1.41	1.68	N/A
ความผันผวนกองทุน	0.67	0.64	0.60	0.66
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	0.28	0.24	0.72	1.10

\* ผลตอบแทนที่มีอายุกิมหนึ่งปีจะแสดงเป็นผลตอบแทนต่อปี

ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกันตามค่าเฉลี่ย Mid Term General Bond

### ระดับความเสี่ยง

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

เสี่ยงปานกลางค่อนข้างต่ำ

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

### ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน	1 เมษายน 2548
นโยบายการจ่ายเงินปันผล	ไม่จ่าย
อายุกองทุน	ไม่กำหนดอายุโครงการ

### ผู้จัดการกองทุนรวม

นาย ชีรภพ จรัสศักดิ์ (30 ธันวาคม 2564)

น.ส. พฤทิพา หนึ่งน้ำใจ (24 กรกฎาคม 2549)

### ดัชนีชี้วัด

1. อัตราดอกเบี้ยเงินฝากประจำ 1 ปี วงเงินน้อยกว่า 5 ล้านบาท เฉลี่ยของ 3 ธนาคารพาณิชย์ขนาดใหญ่ ได้แก่ ธนาคารกรุงเทพ ธนาคารกสิกรไทย และธนาคารไทยพาณิชย์ หลังหักภาษี สัดส่วน (%):50.00 และ

2. ผลตอบแทนรวมสุทธิของดัชนีพันธบัตรรัฐบาลอายุ 1 – 3 ปี ของสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย สัดส่วน (%): 50.00

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

วัตถุประสงค์การอ้างอิงดัชนีชี้วัด: บริษัทจัดการใช้ดัชนีชี้วัดดังกล่าวเพื่อเปรียบเทียบผลการดำเนินงานของกองทุนรวม

### คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวมมิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต: ได้รับการรับรองจาก CAC

จัดอันดับกองทุน Morningstar ★★★ (ข้อมูล ณ 28 ก.พ. 2568)

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



ผู้ลงทุนสามารถเครื่องมือ  
บริการความเสี่ยงด้านสภาพคล่อง  
ได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

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

**การซื้อหน่วยลงทุน**

วันทำการซื้อ: ทุกวันทำการของธนาคาร

เวลาทำการ: 08:30 น. - 15:30 น.

การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ: 500 บาท

การซื้อครั้งต่อไปขั้นต่ำ: 500 บาท

**การขายคืนหน่วยลงทุน**

วันทำการขายคืน: ทุกวันทำการของธนาคาร

เวลาทำการ: 08:30 น. - 15:30 น.

การขายคืนขั้นต่ำ: 500 บาท หรือ 50 หน่วย

ยอดคงเหลือขั้นต่ำ: 50 หน่วย

ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน: ภายใน 2 วันทำการ  
นับถ้วนจากวันทำการขายคืน โดยทั่วไปจะได้  
รับเงิน 2 วันทำการนับถ้วนจากวันทำการขายคืน  
(T+2)

**ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (%) ต่อปี ของ NAV**

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	0.7490	0.3210
รวมค่าใช้จ่าย	0.9630	0.4531

**ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (%) ของมูลค่าซื้อขาย**

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การขาย	ไม่มี	ไม่มี
การรับซื้อคืน	ไม่มี	ไม่มี
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า	ไม่มี	ไม่มี
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก	ไม่มี	ไม่มี
การโอนหน่วย	10 บาทต่อ 1,000 หน่วย	10 บาทต่อ 1,000 หน่วย

**หมายเหตุ**

- ค่าธรรมเนียมดังกล่าวเป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว
- บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายใน การบริหารจัดการ
- บริษัทจัดการอาจยกเว้นไม่เรียกเก็บค่าธรรมเนียมการโอนหน่วยลงทุน โดยที่นักลงทุนต้องขอรับทราบก่อน

**ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก**

Holding	% NAV
พันธบัตรธนารักษ์แห่งประเทศไทยงวดที่ 12/364/67	9.86
พันธบัตรธนารักษ์แห่งประเทศไทยงวดที่ 10/364/67	9.13
หุ้นกู้ของทรัพศต์เพื่อการลงทุนในสิทธิการเช่าอสังหาริมทรัพย์โกลเด้นเวนเจอร์ (GVREIT) ครั้งที่ 1/2561	5.09
หุ้นกู้ของบริษัท ชีพีเอฟ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) ครั้งที่ 1/2568 ชุดที่ 2	4.80
พันธบัตรธนารักษ์แห่งประเทศไทยงวดที่ 53/91/67	4.65

- ผู้ลงทุนสามารถซื้อขายตามอัตราที่มีผลในแต่ละวัน (Unit-Linked) ของกองทุนนี้ได้โดยติดต่อกับบัญทึกการดำเนินการ ทั้งนี้ผู้ลงทุนต้องชำระค่าธรรมเนียมที่ต้องชำระตามอัตราที่กำหนดไว้ก่อนตัดต่อไปจากผู้ถือหน่วยลงทุนปกติที่ซื้อขายหน่วยลงทุนของกองทุนนี้ที่ยังอยู่บ้านเดียว ผู้ลงทุนจึงควรศึกษารายละเอียดในเอกสารประกอบการขายกองทุนนี้ ประจำวันที่วิเคราะห์ความหน่วยลงทุนให้เข้าใจก่อนการตัดสินใจลงทุน

**ข้อมูลเชิงสถิติ**

Maximum Drawdown	-1.55 %
Recovering Period	6 เดือน 18 วัน
FX Hedging	ยังไม่มีการลงทุนในต่างประเทศ
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน	0.63 เท่า
อายุเฉลี่ยของตราสารหนี้	2 ปี 4 เดือน 7 วัน

**Yield to Maturity** 2.21

\* Yield to Maturity (YTM) อัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในตราสารหนี้ คำนวณจากดอกเบี้ยที่ได้รับจริง โดยมิได้ปรับสัดส่วนครึ่งเมื่อปีลงกับ ความเสี่ยงจากอัตราดอกเบี้ยที่ซื้อขายทำให้ผลตอบแทนจริงลดลง/หรือ เพิ่มขึ้น จาก YTM ในรูปสกุลเงินบาทได้

**สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน (%) NAV**

ตราสารหนี้ที่ออกโดยนิตยัพัทธ์หรือภาคเอกชน	45.92
พันธบัตรธนารักษ์แห่งประเทศไทย	36.08
ตราสารภาครัฐหรือองค์กรระหว่างประเทศ	15.26
เงินฝาก หรือตราสารหนี้ที่สถาบันการเงิน เป็นผู้ออก	2.65
ทรัพย์สินอื่น	0.17
หนี้สินอื่น	-0.09

**การจัดสรรการลงทุนใน****ผู้ออกตราสาร 5 อันดับแรก (%) NAV**

ธนาคารแห่งประเทศไทย	36.08
กระทรวงการคลัง	15.26
ทรัพศต์สิทธิการเช่าอสังหาริมทรัพย์โกลเด้นเวนเจอร์	5.09
บมจ.ชีพีเอฟ (ประเทศไทย)	4.80
บมจ.บัตรกรุงไทย	4.46

**การจัดสรรการลงทุนตามอันดับความน่าเชื่อถือ (%)**

	ในประเทศไทย	National	International
AAA	56.45		
AA	10.61		
A	32.85		

## คำศัพท์

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

**Recovering Period** ระยะเวลาการฟื้นตัวเพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาตั้งแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มดีดันใช้ระยะเวลาเท่าไหร่

**FX Hedging** เปอร์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการบีบกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตของกองทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลาหนึ่ง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 1 ปีหารด้วยมูลค่า NAV ของกองทุนรวมเฉลี่ยในรอบระยะเวลาเดียวกัน กองทุนรวมที่มีค่า portfolio turnover สูง บ่งชี้ถึงการซื้อขายหลักทรัพย์บ่อยครั้งของผู้จัดการกองทุนและทำให้มีต้นทุนการซื้อขายหลักทรัพย์สูง จึงต้องพิจารณาเปรียบเทียบกับผลการดำเนินงานของกองทุนรวมเพื่อประเมินความถูกต้องของการซื้อขายหลักทรัพย์คงคล่อง

**Sharpe Ratio** อัตราส่วนระหว่างผลตอบแทนล่วงหน้าเพิ่มของกองทุนรวมเปรียบเทียบกับความเสี่ยงจากการลงทุน โดยคำนวณจากผลต่างระหว่างอัตราผลตอบแทนที่ปราศจากความเสี่ยง (risk-free rate) เปรียบเทียบกับค่าเบี่ยงเบนมาตรฐาน (standard deviation) ของกองทุนรวม ค่า Sharpe Ratio จะหักลบอัตราผลตอบแทนที่กองทุนรวมควรได้รับเพิ่มขึ้นเพื่อ补偿กับความเสี่ยงที่กองทุนรวมรับมา โดยกองทุนรวมที่มีค่า Sharpe Ratio สูงกว่าจะเป็นกองทุนที่มีประสิทธิภาพในการบริหารจัดการลงทุนที่ดีกว่า เนื่องจากได้รับผลตอบแทนส่วนเพิ่มที่สูงกว่าภายใต้ระดับความเสี่ยงเดียวกัน

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

**Beta** ระดับและพิสัยของการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุน โดยเปรียบเทียบกับอัตราการเปลี่ยนแปลงของตลาด Beta น้อยกว่า 1 แสดงว่า หลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนน้อยกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของคู่หลักทรัพย์ของตลาด Beta มากกว่า 1 แสดงว่า หลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนมากกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของคู่หลักทรัพย์ของตลาด

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

**Yield to Maturity** อัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในตราสารหนี้โดยอัตราดอกเบี้ยที่จะได้รับในอนาคตลดลงตามราคาระยะเงินที่จะได้รับคืน นำมาคิดเป็นมูลค่าปัจจุบัน โดยใช้วัดอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมตราสารหนี้ คำนวณจากค่าเฉลี่ยตั้งน้ำหนักของ Yield to Maturity ของตราสารหนี้แต่ละตัวที่กองทุนมีการลงทุน และเนื่องจาก Yield to Maturity มีหน่วยมาตราฐานเป็นเปอร์เซ็นต์ต่อปี จึงสามารถนำไปใช้เปรียบเทียบอัตราผลตอบแทนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีนโยบายต้องการลงทุนที่ลงทุนในตราสารหนี้กับตราสารหนี้และมีลักษณะการลงทุนที่ใกล้เคียงกันได้

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