



krungsri

Asset
Management

Make Life
Simple

A member of  MUFG
a global financial group

รายงานประจำปีแรก 2565

รอบระยะเวลาตั้งแต่วันที่ 1 ตุลาคม 2564 – 31 มีนาคม 2565

กองทุนรวม

KF-TRB

กองทุนเปิดกรุงศรีโทเทิลรีเทิร์นบอนด์

Krungsri Total Return Bond Fund

Krungsri Asset Management Co., Ltd.

1st-2nd Zone A, 12th, 18th Zone B Floor,
Ploenchit Tower, 898 Ploenchit Road,
Bangkok 10330 Thailand
T +66 (0) 2657 5757 F +66 (0) 2657 5777
www.krungsriasset.com

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด

ชั้น 1-2 โซนเอ ชั้น 12 ชั้น 18 โซนบี
อาคารเพลินจิตทาวเวอร์ 898 ถนนเพลินจิต แขวงลุมพินี
เขตปทุมวัน กรุงเทพฯ 10330
โทรศัพท์ +66 (0) 2657 5757 โทรสาร +66 (0) 2657 5777
www.krungsriasset.com

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด

รายงานประจำปีครั้งที่ 2565

กองทุนเปิดกรุงศรีโทเทิลรีเทิร์นบอนด์

• สารบัญจัดการ	3
• รายงานผู้ดูแลผลประโยชน์	4
• งบแสดงฐานะการเงิน งบกำไรขาดทุนเบ็ดเสร็จ และงบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน	5
• รายละเอียดเงินลงทุน การกู้ยืมเงิน และการก่อภาระผูกพันของกองทุนรวม	8
• ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม	11
• ผลการดำเนินงาน	12
• ข้อมูลอื่นๆ ที่ผู้ถือหน่วยลงทุนควรทราบ	13
- รายงานบุคคลที่เกี่ยวข้องที่มีการทำธุรกรรมในรอบเวลาที่ผ่านมา	
- รายชื่อผู้จัดการกองทุน	
- การเปิดเผยข้อมูลการถือหน่วยลงทุนเกิน 1 ใน 3	
- อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุนของกองทุน	
- ข้อมูลการลงทุน และผลการดำเนินงานของกองทุนหลัก	

สารบริษัทจัดการ

เรียน ผู้ถือหน่วยลงทุน

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด (บริษัทฯ) ขอส่งรายงานสำหรับรอบระยะเวลา 6 เดือน ของกองทุนเปิดกรุงศรี โทเทิลรีเทิร์นบอนด์ (KF-TRB) ตั้งแต่วันที่ 1 ตุลาคม 2564 ถึงวันที่ 31 มีนาคม 2565 มายังผู้ถือหน่วยลงทุน โดยมีรายละเอียดดังนี้

ผลการดำเนินงาน

กองทุนเปิดกรุงศรีโทเทิลรีเทิร์นบอนด์ มีมูลค่าทรัพย์สินสุทธิ ณ วันที่ 31 มีนาคม 2565 เท่ากับ 270.65 ล้านบาท คิดเป็นมูลค่าทรัพย์สินสุทธิต่อหน่วยลงทุนเท่ากับ 12.5656 บาท โดยมีผลการดำเนินงานย้อนหลัง 6 เดือน ลดลงร้อยละ 7.46 ลดลงมากกว่าเกณฑ์มาตรฐานการวัดผลการดำเนินงาน ที่ลดลงร้อยละ 6.09

ภาวะการลงทุนในช่วงที่ผ่านมา

ในรอบครึ่งปีที่ผ่านมา ธนาคารกลางสหรัฐฯ ปรับขึ้นอัตราดอกเบี้ยหนึ่งครั้งสู่กรอบอัตราดอกเบี้ยที่ 0.25% - 0.50% ซึ่งเป็นการปรับขึ้นครั้งแรกตั้งแต่เริ่มวิกฤต COVID-19 อันเนื่องมาจากอัตราว่างงานในสหรัฐฯ ที่ลดลงอย่างต่อเนื่องรวมถึงตำแหน่งงานเปิดใหม่เพิ่มขึ้น และอัตราเงินเฟ้อที่พุ่งสูงขึ้น จากสถานการณ์โรคระบาดที่คลี่คลายและภาวะสงครามระหว่างยูเครนและรัสเซียที่ทำให้ราคาพลังงานเพิ่มสูงขึ้น ส่งผลเสียต่อกองทุนที่มีการลงทุนส่วนใหญ่บนตราสารหนี้ภาครัฐของสหรัฐฯ การลงทุนอื่นๆ ของกองทุนหลัก เช่น ตราสารหนี้ภาคเอกชนระดับที่ลงทุนได้, Agency MBS, และ Non-Agency MBS ส่งผลต่อกองทุนในช่วงปลายปีที่ผ่านมา สำหรับสถานะพอร์ตตราสารหนี้ในยุโรปส่งผลต่อกองทุน อย่างไรก็ตามสถานะพอร์ตในภูมิภาคอื่นๆ เช่นอังกฤษและญี่ปุ่นมีส่วนช่วยเพิ่มผลตอบแทนแก่กองทุน กองทุนยังมีการลงทุนบนค่าเงินตลาดเกิดใหม่ปริมาณหนึ่งซึ่งส่งผลบวกต่อกองทุนในช่วงที่ผ่านมา

แนวโน้มการลงทุน

กองทุนหลักยังคงอายุเฉลี่ยตราสารหนี้ในระดับต่ำ โดยความเสี่ยงด้านอัตราดอกเบี้ยส่วนใหญ่อยู่ในสหรัฐฯ กองทุนเน้นลงทุนบนช่วงอายุที่เชื่อว่าจะให้ผลตอบแทนที่ดี และมีการป้องกันความเสี่ยงที่อัตราดอกเบี้ยจะปรับตัวเพิ่มขึ้นอีกโดยการมีสถานะพอร์ตบนตราสารหนี้ญี่ปุ่นและอังกฤษ กองทุนมีมุมมองเป็นลบต่อ Agency MBS และตราสารหนี้ภาคเอกชน โดยมีแนวโน้มที่จะลดน้ำหนักตราสารหนี้เหล่านี้ลง ในแง่ของการถือค่าเงินที่ไม่ใช่สกุลเงินดอลลาร์สหรัฐฯ กองทุนอาจเพิ่มหรือลดสัดส่วนเมื่อเห็นโอกาสจากค่าเงินของประเทศในตลาดเกิดใหม่หรือประเทศในตลาดพัฒนาแล้วบางประเทศที่แข็งค่าหรืออ่อนค่าผิดปกติ สำหรับปัจจัยที่คาดว่าจะส่งผลต่อการลงทุนในระยะถัดไป ได้แก่ อัตราการติดเชื้อโควิด-19 ที่เริ่มมีทิศทางขาขึ้นอีกครั้ง เงินเฟ้อในภาคสินค้าและการบริการ และนโยบายทางการเงินของธนาคารกลางที่ตึงตัวมากขึ้น

บริษัทฯ ใคร่ขอขอบพระคุณท่านผู้ถือหน่วยลงทุนที่ได้มอบความไว้วางใจให้บริษัทฯ เป็นผู้บริหารเงินลงทุนของท่าน ทั้งนี้ บริษัทฯ จะพิจารณาดำเนินนโยบายการลงทุนที่เหมาะสมกับสถานการณ์ด้วยความระมัดระวัง และคำนึงถึงผลประโยชน์สูงสุดของผู้ถือหน่วยลงทุนเป็นสำคัญ

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด

รายงานผู้ดูแลผลประโยชน์

เสนอ ผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุนกองทุนเปิดกรุงศรีโทเทลิทรีเทิร์นบอนด์

ธนาคารซีทีแบงก์ เอ็น เอ สาขากรุงเทพฯ ในฐานะผู้ดูแลผลประโยชน์ กองทุนเปิดกรุงศรีโทเทลิทรีเทิร์นบอนด์ อันมีบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด เป็นผู้จัดตั้งและจัดการกองทุน ได้ปฏิบัติหน้าที่ผู้ดูแลผลประโยชน์กองทุนรวมดังกล่าว สำหรับรอบระยะเวลาตั้งแต่วันที่ 1 ตุลาคม 2564 ถึงวันที่ 31 มีนาคม 2565 แล้วนั้น

ธนาคารฯ ได้จัดทำรายงานฉบับนี้ขึ้นบนพื้นฐานของแหล่งข้อมูลที่ได้รับ ณ วันที่ในจดหมายนี้โดยเชื่อว่าเชื่อถือได้ แต่ธนาคารไม่รับรองความถูกต้องหรือความสมบูรณ์ของข้อมูลดังกล่าว และขอสงวนสิทธิในความรับผิดชอบต่อความผิดพลาด ความละเอียด (รวมถึงไปถึงความรับผิดชอบต่อบุคคลที่สาม) อย่างชัดเจน ไม่มีการรับประกันว่าเหตุการณ์หรือผลลัพธ์ในอนาคตจะตรงกันกับรายงานดังกล่าว ธนาคารฯ กรรมการ พนักงาน หรือตัวแทนของธนาคารไม่รับประกันใดๆ ต่อการจ่ายเงินทุน การกระทำการหรือการแจกจ่ายกองทุน และไม่รับผิดชอบต่อความเสียหายที่เป็นผลมาจากการกระทำ หรือการละเอียดที่เกิดขึ้นอันเกี่ยวข้องกับรายงานฉบับนี้

ธนาคารฯ เห็นว่าบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด ได้ปฏิบัติหน้าที่ในการจัดการโดยถูกต้องตามที่ควรตามวัตถุประสงค์ที่ได้กำหนดไว้ในโครงการจัดการที่ได้รับอนุมัติจากสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ และภายใต้พระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535

ขอแสดงความนับถืออย่างสูง



(Thierry Tassenoeย์ คุณเจดจันทร์ สุนันทพงศ์ศักดิ์)



Citibank N.A.

ผู้ดูแลผลประโยชน์กองทุนรวม

ธนาคารซีทีแบงก์ เอ็น เอ สาขากรุงเทพฯ

26 เมษายน 2565 NS. 

กองทุนเปิดกรุงศรีโทเทลิทรีเทิร์นบอนด์

งบแสดงฐานะการเงิน

ณ 31 มีนาคม 2565

	Unaudited (บาท)
สินทรัพย์	
เงินลงทุนตามราคายุติธรรม (ราคาทุน 276,760,389.73 บาท)	267,032,950.75
เงินฝากธนาคาร	3,966,622.65
ลูกหนี้จากสัญญาอนุพันธ์	1,166,388.00
ลูกหนี้	
จากดอกเบี้ย	3,916.88
จากการขายหน่วยลงทุน	8,449.18
จากการรับเงินค่าตอบแทนจากเงินลงทุนในต่างประเทศ	142,228.52
รวมสินทรัพย์	272,320,555.98
หนี้สิน	
เจ้าหนี้จากสัญญาอนุพันธ์	879,861.20
เจ้าหนี้	
จากการรับซื้อคืนหน่วยลงทุน	546,778.10
ค่าธรรมเนียมสับเปลี่ยนหน่วยลงทุน	12.72
ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย	240,790.78
ภาษีเงินได้ค้างจ่าย	587.53
หนี้สินอื่น	5,724.52
รวมหนี้สิน	1,673,754.85
สินทรัพย์สุทธิ	270,646,801.13
สินทรัพย์สุทธิ:	
หน่วยลงทุนจดทะเบียน 1,000 ล้านหน่วย มูลค่าที่ตราไว้หน่วยละ 10 บาท	
ทุนที่ได้รับจากผู้ถือหน่วยลงทุน	215,386,665.41
กำไรสะสม(ขาดทุนสะสม)	393,662,562.32
บัญชีปรับสมดุล	(338,402,426.60)
สินทรัพย์สุทธิ	270,646,801.13
สินทรัพย์สุทธิต่อหน่วย	12.5656
จำนวนหน่วยลงทุนที่จำหน่ายได้แล้วทั้งหมด ณ วันสิ้นสุดงวด (หน่วย)	21,538,666.5409

กองทุนเปิดกรุงศรีโทเทลิทรีนบอนด์
งบกำไรขาดทุนเบ็ดเสร็จ
สำหรับงวดบัญชีสิ้นสุดวันที่ 31 มีนาคม 2565

	Unaudited (บาท)
รายได้จากการลงทุน	
รายได้ดอกเบี้ย	8,556.61
รายได้จากการรับเงินค่าตอบแทนจากเงินลงทุนในต่างประเทศ	992,515.69
รวมรายได้	<u>1,001,072.30</u>
ค่าใช้จ่าย	
ค่าธรรมเนียมการจัดการ	1,104,120.49
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์	49,464.57
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน	264,988.94
ค่าธรรมเนียมวิชาชีพ	<u>39,890.50</u>
รวมค่าใช้จ่าย	<u>1,458,464.50</u>
รายได้จากการลงทุนสุทธิ	<u>(457,392.20)</u>
รายการกำไร (ขาดทุน) สุทธิจากเงินลงทุน	
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิที่เกิดขึ้นจากเงินลงทุน	556,892.66
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิที่ยังไม่เกิดขึ้นจากเงินลงทุน	(23,982,527.32)
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิที่เกิดขึ้นจากสัญญาอนุพันธ์	(4,020,499.90)
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิที่ยังไม่เกิดขึ้นจากสัญญาอนุพันธ์	10,126,384.60
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิจากอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ	<u>(6,000,220.14)</u>
รวมรายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิจากเงินลงทุนที่เกิดขึ้นและยัง ไม่เกิดขึ้น	(23,319,970.10)
การเพิ่มขึ้นในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงานก่อนภาษีเงินได้	(23,777,362.30)
หัก ภาษีเงินได้	<u>(1,283.48)</u>
การเพิ่มขึ้นในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงานหลังหักภาษีเงินได้	<u>(23,778,645.78)</u>

กองทุนเปิดกรุงศรีโทเทิลรีเทิร์นบอนด์

งบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน

ณ 31 มีนาคม 2565

การแสดงรายละเอียดเงินลงทุนใช้การจัดกลุ่มตามประเภทของเงินลงทุนและประเภทของอุตสาหกรรม

ประเภทเงินลงทุน/ผู้ออกตราสาร/ผู้ออกหลักทรัพย์	หมายเลขตราสาร	อัตรา ดอกเบี้ย (%)	วันครบอายุ	เงินต้น (บาท) / จำนวนหุ้น	มูลค่ายุติธรรม (บาท)	Unaudited ร้อยละของ มูลค่า เงินลงทุน
หลักทรัพย์ในประเทศ						
เงินฝากออมทรัพย์						1.62
บมจ.ธ.ทิสโก้		0.100000	เมื่อทวงถาม	637,422.11	637,422.11	0.24
ธ.ซีทีแบงก์ สาขากรุงเทพฯ		0.180000	เมื่อทวงถาม	1,076,612.99	1,076,612.99	0.40
บมจ.ธ.ยูโอบี		0.250000	เมื่อทวงถาม	2,607,701.31	2,607,701.31	0.98
หลักทรัพย์ต่างประเทศ						
หน่วยลงทุน						98.38
PIMCO Total Return Bond Fund	PTRBDFE			272,438,653.32	262,711,214.34	98.38
จำนวน 286,456.480000 หน่วย						
มูลค่าหน่วยละ 27.5300 USD						
รวมเป็นเงิน 7,886,146.98 USD						
					267,032,950.75	100.00

กองทุนเปิดกรุงศรีโทเทิลรีเทิร์นบอนด์

รายละเอียดการลงทุน ณ 31 มีนาคม 2565

	มูลค่าตามราคาตลาด	% NAV
หลักทรัพย์หรือทรัพย์สินในประเทศ	8,292,275.94	3.06
เงินฝากธนาคาร		
TRIS		
Rate A	637,591.51	0.24
S&P		
Rate A-	5,045,375.63	1.86
FITCH_TH-LONG		
Rate AAA	2,609,308.80	0.96
หลักทรัพย์หรือทรัพย์สินต่างประเทศ	262,711,214.34	97.07
หน่วยลงทุน		
จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์	262,711,214.34	97.07
สัญญาซื้อขายล่วงหน้า	286,526.80	0.10
สัญญาที่อ้างอิงกับอัตราแลกเปลี่ยน-สัญญาแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ		
TRIS		
Rate A+	(879,861.20)	(0.33)
FITCH-LONG		
Rate AA	1,166,388.00	0.43
อื่นๆ	(643,215.95)	(0.23)
ลูกหนี้	150,677.70	0.06
เจ้าหนี้	(553,102.87)	(0.20)
ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย	(240,790.78)	(0.09)
มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ	270,646,801.13	100.00

กองทุนเปิดกรุงศรีโทเทิลรีเทิร์นบอนด์

รายละเอียดการลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ณ 31 มีนาคม 2565

ประเภทสัญญา	คู่สัญญา	วัตถุประสงค์	มูลค่าสัญญา (Notional Amount)	% NAV	วันครบกำหนด	กำไร/ขาดทุน (net gain/loss)
สัญญาที่อ้างอิงกับอัตราแลกเปลี่ยน						
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ธ.ไทยพาณิชย์	ป้องกันความเสี่ยง	124,421,750.00	0.4310	21 เม.ย. 2565	1,166,388.00
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ธ.ทหารไทยชนชาติ	ป้องกันความเสี่ยง	4,515,750.00	(0.0068)	7 เม.ย. 2565	(18,485.82)
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ธ.ทหารไทยชนชาติ	ป้องกันความเสี่ยง	130,125,608.00	(0.3183)	7 เม.ย. 2565	(861,375.38)

คำอธิบายการจัดอันดับตราสารของสถาบันจัดอันดับความน่าเชื่อถือ

• ตราสารหนี้ระยะกลางและระยะยาว

Moody's	S&P	TRIS	Fitch	คำอธิบาย	
Aaa	AAA	AAA	AAA	ความน่าเชื่อถือสูงที่สุด และมีความเสี่ยงต่ำที่สุด	ระดับการลงทุน (investment grade)
Aa1	AA+	AA+	AA+	ความน่าเชื่อถือสูงมาก และมีความเสี่ยงต่ำมาก	
Aa2	AA	AA	AA		
Aa3	AA-	AA-	AA-		
A1	A+	A+	A+	ความน่าเชื่อถือสูง และมีความเสี่ยงต่ำ	
A2	A	A	A		
A3	A-	A-	A-		
Baa1	BBB+	BBB+	BBB+	ความน่าเชื่อถืออยู่ในเกณฑ์พอใช้	
Baa2	BBB	BBB	BBB		
Baa3	BBB-	BBB-	BBB-		
Ba1	BB+	BB+	BB+	ความน่าเชื่อถือต่ำกว่าระดับปานกลาง	ระดับเก็งกำไร (speculative grade)
Ba2	BB	BB	BB		
Ba3	BB-	BB-	BB-		
B1	B+	B+	B+	ความน่าเชื่อถืออยู่ในเกณฑ์ต่ำมาก	
B2	B	B	B		
B3	B-	B-	B-		
Caa1	CCC+	C+	CCC	มีความเสี่ยงในการผิดนัดชำระหนี้สูงที่สุด	
Caa2	CCC				
Caa3	CCC-				
Ca	CC	C	CC		
	C	C-	C		
C	SD	RD	RD	อยู่ในสภาวะผิดนัดชำระหนี้ โดยผู้ออกตราสารหนี้ไม่สามารถชำระดอกเบี้ยและคืนเงินต้นได้ตามกำหนด	
	D	D	D		

• ตราสารหนี้ระยะสั้น

Moody's	S&P	TRIS	Fitch	คำอธิบาย	
P-1	A-1	T1	F1	ผู้ออกตราสารหนี้มีสถานะทั้งทางด้านการตลาดและการเงินที่แข็งแกร่งในระดับดีมาก มีสภาพคล่องที่ดีมาก และนักลงทุนจะได้รับความคุ้มครองจากการผิดนัดชำระหนี้ที่ต่ำกว่าอันดับเครดิตในระดับอื่น	
P-2	A-2	T2	F2	ผู้ออกตราสารหนี้มีสถานะทั้งทางด้านการตลาดและการเงินที่แข็งแกร่งในระดับดี และมีความสามารถในการชำระหนี้ระยะสั้นในระดับที่น่าพอใจ	
P-3	A-3	T3	F3	ผู้ออกตราสารหนี้มีความสามารถในการชำระหนี้ระยะสั้นในระดับที่ยอมรับได้	
	B	T4	B	มีความสามารถในการชำระหนี้ระยะสั้นที่ค่อนข้างอ่อนแอ ผู้ออกแสดงถึงความไม่แน่นอนอย่างสูงของความสามารถในการชำระหนี้ได้ตรงตามกำหนดเวลาที่ระบุไว้	
	C		C		
	D	D	D	เป็นระดับที่อยู่ในสภาวะผิดนัดชำระหนี้ โดยผู้ออกตราสารหนี้ไม่สามารถชำระดอกเบี้ยและคืนเงินต้นได้ตามกำหนด	

หมายเหตุ

- เครื่องหมายบวก (+) หรือ ลบ (-) หรือเลข 1 ถึง 3 ต่อท้ายนั้น เพื่อจำแนกความแตกต่างของคุณภาพของอันดับเครดิตภายในระดับเดียวกัน
- คำเสริมท้าย (tha) จะระบุไว้ต่อจากอันดับเครดิตเพื่อบอกถึงอันดับเครดิตภายในประเทศสำหรับประเทศไทย

ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (Fund's Direct Expenses)

กองทุนเปิดกรุงศรีโทเทิลรีเทิร์นบอนด์

ตั้งแต่วันที่ 1 ตุลาคม 2564 ถึงวันที่ 31 มีนาคม 2565

ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (Fund's Direct Expenses)	จำนวนเงิน (หน่วย: พันบาท)	ร้อยละของมูลค่า ทรัพย์สิน* (ต่อปี) 1/
ค่าธรรมเนียมการจัดการ (Management Fee) 2/	1,104.12	0.6688
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ (Trustee Fee)	49.46	0.0300
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน (Registrar Fee)	264.99	0.1605
ค่าที่ปรึกษาการลงทุน (Advisory Fee)	-	-
ค่าธรรมเนียมสอบบัญชี (Auditing Fee)	39.89	0.0242
ค่าใช้จ่ายอื่น ๆ (Others)	-	-
รวมค่าใช้จ่ายทั้งหมด 3/	1,458.46	0.8835

หมายเหตุ

1/ ค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวมข้างต้น เป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่มหรือภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว

2/ กองทุน PIMCO Total Return Bond Fund, Class E Acc. (USD) (กองทุนหลัก) จะคืน (rebate) ค่าธรรมเนียมการจัดการให้แก่กองทุนเปิดกรุงศรีโทเทิลรีเทิร์น บอนด์ ในอัตราร้อยละ 50 ซึ่งจะเท่ากับร้อยละ 0.625 ต่อปีของมูลค่าเงินลงทุนในกองทุน PIMCO Total Return Bond Fund, Class E Acc. (USD) โดยเก็บเข้าเป็นทรัพย์สินของกองทุนเปิดกรุงศรีโทเทิลรีเทิร์นบอนด์ ทั้งนี้ การคืนค่าธรรมเนียมดังกล่าวอาจปรับเปลี่ยนได้ตามการเปลี่ยนแปลงอัตราค่าธรรมเนียมการจัดการของกองทุนหลัก (ถ้ามี)

3/ ไม่รวมค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ และค่าธรรมเนียมต่าง ๆ ที่เกิดขึ้นจากการซื้อขายหลักทรัพย์

* มูลค่าทรัพย์สิน ในที่นี้ หมายถึง มูลค่าทรัพย์สินทั้งหมด หักด้วย มูลค่าหนี้สินทั้งหมด

เว้นแต่ค่าธรรมเนียมการจัดการ ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ ค่าธรรมเนียมนายทะเบียนหน่วยลงทุน และค่าใช้จ่ายที่เกี่ยวข้องกับการปฏิบัติการกองทุน ณ วันที่คำนวณ

ผลการดำเนินงานของกองทุนเปิดกรุงศรีโทเทิลรีเทิร์นบอนด์

ผลการดำเนินงาน สิ้นสุด ณ วันที่ 31 มีนาคม 2565	% ตามช่วงเวลา			% ต่อปี				
	Year to Date	ย้อนหลัง 3 เดือน	ย้อนหลัง 6 เดือน	ย้อนหลัง 1 ปี	ย้อนหลัง 3 ปี	ย้อนหลัง 5 ปี	ย้อนหลัง 10 ปี	นับจากวันเริ่ม โครงการ (14 ตุลาคม 2553)
KF-TRB	-6.92%	-6.92%	-7.46%	-5.34%	0.65%	0.61%	1.82%	2.01%
ดัชนีชี้วัด (Benchmark)*	-5.86%	-5.86%	-6.09%	-3.13%	2.35%	2.49%	3.48%	3.72%
ความผันผวนของผลการดำเนินงาน	6.62%	6.62%	5.46%	4.43%	4.63%	3.95%	3.56%	3.54%
ความผันผวนของดัชนีชี้วัด	6.64%	6.64%	5.66%	4.64%	4.65%	3.98%	3.62%	3.65%

หมายเหตุ : * ดัชนีชี้วัด (Benchmark) คือ ดัชนี Bloomberg Barclays US Aggregate Index ปรับด้วยต้นทุนการป้องกันความเสี่ยง
ด้านอัตราแลกเปลี่ยนเพื่อคำนวณผลตอบแทนเป็นสกุลเงินบาท

** ผลตอบแทนที่มีอายุเกินหนึ่งปีจะแสดงเป็นผลตอบแทนต่อปี

เอกสารการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวมฉบับนี้ ได้จัดทำตามมาตรฐานการวัดผลการดำเนินงานของ
กองทุนรวมของสมาคมบริษัทจัดการลงทุน

ข้อมูลอื่นๆ ที่ผู้ถือหน่วยลงทุนควรทราบ

(1) รายงานบุคคลที่เกี่ยวข้องที่มีการทำธุรกรรมในรอบเวลาที่ผ่านมา (วันที่ 1 ตุลาคม 2564 ถึงวันที่ 31 มีนาคม 2565)

ชื่อกองทุน	รายชื่อบุคคลที่เกี่ยวข้อง
กองทุนเปิดกรุงศรีโทเทิลรีเทิร์นบอนด์	ธนาคารกรุงศรีอยุธยา จำกัด (มหาชน)

หมายเหตุ: ผู้ลงทุนสามารถตรวจสอบการทำธุรกรรมกับบุคคลที่เกี่ยวข้องกับกองทุนรวมได้ที่บริษัทจัดการโดยตรง หรือที่ web site ของบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด (<http://www.krungsriasset.com>) และสำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ด. (<http://www.sec.or.th>)

(2) รายชื่อผู้จัดการกองทุน ณ วันที่ 31 มีนาคม 2565

- | | |
|---------------------|------------------|
| 1. นางสาวพรทิพา | หนึ่งน้ำใจ |
| 2. นายธีรภาพ | จิรศกยกุล |
| 3. นางสาวรัมภารัตน์ | ยูธานหัส |
| 4. นายเอกพจน์ | ภูวิบูลย์พาณิชย์ |
| 5. นายจาตุรันต์ | สอนไว |
| 6. นายชูศักดิ์ | อวยพรชัยสกุล |
| 7. นายพงศ์สันต์ | อนูรัตน์ |
| 8. นางสาววรรดา | ตันติสุนทร |

(3) การเปิดเผยข้อมูลการถือหน่วยลงทุนเกิน 1 ใน 3 ณ วันที่ 31 มีนาคม 2565

ไม่มีการถือหน่วยลงทุนเกิน 1 ใน 3 ของบุคคลใดบุคคลหนึ่ง

ผู้ถือหน่วยลงทุนสามารถตรวจสอบข้อมูลสัดส่วนการถือหน่วยลงทุนโดยตรงได้ที่ www.krungsriasset.com

(4) อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุนของกองทุน (portfolio turnover ratio) ในรอบระยะเวลาที่ผ่านมา เท่ากับ 1.62%

(5) ผลการดำเนินงานของกองทุนหลัก และ ข้อมูลการลงทุน (ข้อมูล ณ วันที่ 31/03/2022)

Performance (Net of Fees)	1 Mo.	3 Mos.	6 Mos.	1 Yr.	3 Yrs.	5 Yrs.	10 Yrs.	SI
Class E, Acc (%) ³	-3.44	-6.90	-7.37	-5.49	1.19	1.42	1.60	3.37
Net of 5% Preliminary Charge ⁴	-8.26	-11.56	-11.99	-10.21	-0.53	0.38	1.08	3.04
Class E, Inc (%) ³	-3.44	-6.94	-7.40	-5.53	1.20	1.42	1.59	3.25
Net of 5% Preliminary Charge ⁴	-8.30	-11.59	-12.06	-10.28	-0.51	0.39	1.07	2.93
Benchmark (%)	-2.78	-5.93	-5.92	-4.15	1.69	2.14	2.24	—

Past performance is not necessarily indicative of future performance. The benchmark is the Bloomberg U.S. Aggregate Index. All periods longer than one year are annualised. SI is the performance since inception. ³ Performance shown is on a NAV-to-NAV basis in the denominated currency, excluding the preliminary charge and on the assumption that distributions are reinvested, as applicable. ⁴ Performance shown is on a NAV-to-NAV basis in the denominated currency, taking into account the preliminary charge and on the assumption that distributions are reinvested, as applicable. A preliminary charge of up to 5% may or may not be deducted from the subscription amount depending on the distributor from whom you had purchased shares, as such this may not represent actual performance returns.

Top 10 Holdings (% Market Value)*	
FNMA TBA 2.0% FEB 30YR	8.6
U S TREASURY BOND	4.2
U S TREASURY BOND	3.0
FNMA TBA 2.0% FEB 15YR	2.3
U S TREASURY BOND	2.0
FNMA TBA 2.5% FEB 30YR	2.0
LLOYDS BANKING GROUP PLC JR SUB	1.7
FNMA TBA 3.5% MAR 30YR	1.5
U S TREASURY BOND	1.2
U S TREASURY BOND	1.0

*Top 10 holdings as of 31/12/2021, excluding derivatives.

