



กองทุนเปิดกรุงศรีโกลบอลไดนามิคบาลานซ์โลเคชั่นเอสอาร์ไอเพื่อการเลี้ยงชีพ

KF-GDBRMF

ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมผสม / กองทุนรวมฟีดเดอร์ (Feeder Fund) / กองทุนรวมเพื่อความยั่งยืน (SRI Fund) / กองทุนรวมเพื่อการเลี้ยงชีพ / กองทุนรวมที่มีนโยบายเปิดให้มีการลงทุนในกองทุนรวมอื่นภายใต้ บลจ. เดียวกัน (Cross Investing Fund)
- กองทุนรวมที่เน้นลงทุนแบบมีความเสี่ยงต่างประเทศ
- กลุ่ม Foreign Investment Allocation

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- ลงทุนในกองทุนรวมต่างประเทศชื่อ Allianz Dynamic Multi Asset Strategy SRI 50, Class P (EUR) (กองทุนหลัก) โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของ NAV
- กองทุนหลักมีนโยบายลงทุนในทรัพย์สินหลากหลายประเภท โดยมุ่งเน้นการลงทุนในตราสารทุน และตราสารหนี้ทั่วโลก เพื่อสร้างผลตอบแทนในระยะปานกลางถึงระยะยาว โดยมีค่าความผันผวนอยู่ในช่วง 6% ถึง 12% ต่อปี และสอดคล้องกับคุณลักษณะทางด้านสิ่งแวดล้อมและสังคม (E/S Characteristics) โดยเน้นการลงทุนในทรัพย์สินที่ส่งเสริมคุณลักษณะทางด้านสิ่งแวดล้อม และ/หรือ สังคม และธรรมาภิบาลเป็นหลัก
- บริษัทที่บริหารจัดการกองทุนหลัก คือ Allianz Global Investors GmbH
- กองทุนอาจลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมภายใต้การจัดการของบริษัทจัดการในสัดส่วนไม่เกินร้อยละ 20 ของ NAV
- กองทุนอาจจะเข้าทำสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) เพื่อลดความเสี่ยง (Hedging) จากการลงทุน โดยขึ้นอยู่กับดุลยพินิจของบริษัทจัดการ
- กองทุนไทยมุ่งหวังให้ผลประโยชน์การเคลื่อนไหวตามกองทุนหลัก โดยกองทุนหลักมีการบริหารจัดการเชิงรุกโดยไม่มีการอ้างอิงดัชนีชี้วัด (Active management)

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (%) ต่อปี

- ยังไม่มีข้อมูล -

ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปีกumul (%) ต่อปี

- ยังไม่มีข้อมูล -

ระดับความเสี่ยง

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

เสี่ยงสูง

ลงทุนในตราสารทุน ตราสารหนี้ และ/หรือทรัพย์สินทางเลือก โดยมีสัดส่วนการลงทุนในตราสารทุนไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน:	29 ตุลาคม 2569
นโยบายการจ่ายเงินปันผล:	ไม่จ่าย
อายุกองทุน:	ไม่กำหนด
การป้องกันความเสี่ยง FX:	ตามดุลยพินิจของผู้จัดการกองทุน
การเรียกเก็บค่าธรรมเนียม	ไม่มี
ตามผลการดำเนินงาน:	

ผู้จัดการกองทุนรวม

นายจาตุรนต์ สอนไ	ตั้งแต่วันที่ 29 ตุลาคม 2569
นายชูศักดิ์ อวยพรชัยสกุล	ตั้งแต่วันที่ 29 ตุลาคม 2569

ดัชนีชี้วัด :

กองทุนไม่มีดัชนีชี้วัดด้านความยั่งยืนที่สอดคล้องกับการลงทุน โดยเป็นไปตามกองทุนหลักที่มีการบริหารกองทุนแบบเชิงรุกโดยไม่มีการอ้างอิงดัชนีชี้วัด

คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวมมิได้เป็นที่ยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต: ได้รับการรับรองจาก CAC

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

“ผู้ลงทุนสามารถศึกษา
เครื่องมือบริหารความเสี่ยงด้าน
สภาพคล่องได้ในหนังสือชี้ชวน
ฉบับเต็ม”



www.krungsriasset.com

การซื้อขายหน่วยลงทุน		การขายคืนหน่วยลงทุน	
วันที่ทำการซื้อ:	● ช่วง IPO: 19 – 27 ตุลาคม 2569 ภายในเวลา 15.30 น. ของวันสุดท้าย ทั้งนี้ จะรับชำระเป็นเช็คจนถึงวันที่ 27 ตุลาคม 2569 ● หลัง IPO: เริ่มตั้งแต่วันที่ 30 ตุลาคม 2569 เป็นต้นไป ทุกวันทำการซื้อขายของกองทุน	วันที่ทำการขายคืน:	เริ่มตั้งแต่วันที่ 30 ตุลาคม 2569 ทุกวันทำการซื้อขายของกองทุน
เวลาทำการ:	8.30 - 14.30 น.	เวลาทำการ:	8.30 – 14.30 น.
การซื้อขายครั้งแรกขั้นต่ำ:	500 บาท แต่ไม่เกิน 500,000 บาท	การซื้อขายขั้นต่ำ:	ไม่กำหนด
การซื้อขายครั้งถัดไปขั้นต่ำ:	500 บาท แต่ไม่เกิน 500,000 บาท	ยอดคงเหลือขั้นต่ำ:	ไม่กำหนด
		ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน :	ภายใน 6 วันทำการนับถัดจากวันทำการขายคืน โดยทั่วไปจะได้รับเงิน 3 วันทำการนับถัดจากวันทำการขายคืน (T+3)

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)		
ค่าธรรมเนียมต่อไปนี้จะส่งผลกระทบต่อผู้ลงทุน เนื่องจากจะทำให้ผลตอบแทนจากการลงทุนลดลง ดังนั้น ผู้ลงทุนควรตรวจสอบทุกครั้งก่อนตัดสินใจลงทุน		
ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ ค่าตอบแทนแก่ผู้สนับสนุนการขายหรือรับซื้อคืนหน่วยลงทุนของกองทุนรวม (trailer fee): มี	2.1400	0.8025
รวมค่าใช้จ่าย	4.6545	0.9957

- หมายเหตุ:
- หากกองทุนลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมภายใต้การจัดการเดียวกัน (กองทุนปลายทาง) บริษัทจัดการจะไม่เรียกเก็บค่าธรรมเนียมการจัดการซ้ำซ้อนกับกองทุนปลายทาง
 - กองทุนหลักคืน (rebate) ค่าธรรมเนียมการจัดการ (ตามอัตราที่ตกลงกันระหว่างบริษัทจัดการและกองทุนหลัก) ให้แก่กองทุนไทยโดยเก็บเข้าเป็นทรัพย์สินของกองทุน
 - ค่าตอบแทนแก่ผู้สนับสนุนการขายหรือรับซื้อคืนหน่วยลงทุน (trailer fee) เป็นส่วนหนึ่งของค่าธรรมเนียมการจัดการ

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)		
ผู้ลงทุนจะถูกเรียกเก็บค่าธรรมเนียมต่อไปโดยตรงทุกครั้งเมื่อทำการซื้อขายหรือสับเปลี่ยนหน่วยลงทุน		
ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การขาย	2.00	ยังไม่เรียกเก็บ
การรับซื้อคืน	2.00	ยังไม่เรียกเก็บ
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า	2.00	ยังไม่เรียกเก็บ
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก - กรณีภายในบริษัทจัดการ - กรณีสับเปลี่ยนไปยังบริษัทจัดการอื่น	2.00 2.00 (โดยมีขั้นต่ำ 200 บาท ต่อ 1 รายการ)	ยังไม่เรียกเก็บ ยังไม่เรียกเก็บ
การโอนหน่วย	ไม่มี	ไม่มี

- หมายเหตุ :
- ค่าธรรมเนียมหรือค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม และ/หรือผู้ส่งซื้อหรือผู้ถือหน่วยลงทุนข้างต้น เป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่มหรือภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว
 - หากกองทุนลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมภายใต้การจัดการเดียวกัน บริษัทจัดการจะไม่เรียกเก็บค่าธรรมเนียมการขาย และ/หรือรับซื้อคืนหน่วยลงทุนซ้ำซ้อน
 - บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ

ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรกของกองทุนหลัก	
Holding	% NAV
PIMCO GIS-EMK OPP FND-INSAC	2.90
NVIDIA CORP	2.80
APPLE INC	2.60
MICROSOFT CORP	2.20
SCHRODER INTL EMG EUROPE-AAC	1.80

ข้อมูลกองทุนหลัก ณ วันที่ 31 สิงหาคม 2569

ข้อมูลเชิงสถิติ	
Maximum drawdown	-
Recovering Period	-
Fx Hedging	-
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน	-
Sharpe Ratio	-
Alpha	-
Beta	-
Tracking Error	-

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน*	
Breakdown	% NAV
หน่วย CIS	80.00
อื่นๆ	20.00
ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก*	
Holding	% NAV
Allianz Dynamic Multi Asset Strategy SRI 50	80.00
อื่นๆ	20.00

หมายเหตุ: * ข้อมูลการลงทุนและสัดส่วนการลงทุนดังกล่าว เป็นเพียงคาดการณ์การลงทุน ซึ่งอาจเปลี่ยนแปลงได้

การจัดสรรการลงทุนในต่างประเทศของกองทุนหลัก	
Country	% NAV
สหรัฐอเมริกา	37.00
สหราชอาณาจักร	6.50
เนเธอร์แลนด์	3.10
สเปน	2.90
เยอรมนี	2.70

ข้อมูลกองทุนหลัก ณ วันที่ 31 สิงหาคม 2569

การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม / ทรัพย์สินของกองทุนหลัก	
Sector	% NAV
Equites	73.80
Fixed Income	13.70
Others	9.00
Liquidity	3.40

ข้อมูลกองทุนหลัก ณ วันที่ 31 สิงหาคม 2569

การลงทุนในกองทุนอื่นเกินกว่า 20% (กองในประเทศ และหรือกองต่างประเทศ)

ชื่อกองทุน : Allianz Dynamic Multi Asset Strategy SRI 50, Class P (EUR)

ISIN code: LU1706852701

Bloomberg code: ADM50PE LX

ข้อมูลอื่นๆ

บริษัทจัดการจะปฏิบัติตามกฎเกณฑ์ของกองทุนหลักโดยรายงานการถือครองหน่วยลงทุนตั้งแต่ร้อยละ 10 ของจำนวนหน่วยลงทุนที่จำหน่ายได้แล้วทั้งหมดของกองทุนให้กับผู้มีอำนาจหน้าที่ของกองทุนหลัก และอาจนำเสนอข้อมูลส่วนตัวของผู้ถือหน่วยลงทุนดังกล่าวเช่น สำเนาบัตรประจำตัวประชาชนและ/หรือสำเนาหนังสือเดินทาง เป็นต้น และ/หรือขอข้อมูลหรือเอกสารเพิ่มเติมอื่นใดจากผู้ถือหน่วยลงทุนในภายหลังก็ได้ เพื่อให้เป็นไปตามที่กองทุนหลักร้องขอ หากผู้ถือหน่วยลงทุนรายใดปฏิเสธการให้ข้อมูลหรือเอกสารเพิ่มเติมดังกล่าวหรือมีพฤติกรรมเข้าข่ายและ/หรือมีความผิดตามกฎหมายอันมีผลทำให้บริษัทจัดการไม่สามารถปฏิบัติตามกฎเกณฑ์ของกองทุนหลักได้ บริษัทจัดการขอสงวนสิทธิที่จะระงับหรือหยุดให้บริการและดำเนินการคืนเงินลงทุนตามมูลค่าหน่วยลงทุนให้แก่ผู้ถือหน่วยลงทุน โดยถือว่าได้รับความเห็นชอบจากผู้ถือหน่วยลงทุนแล้ว ทั้งนี้ ผู้ถือหน่วยลงทุนจะไม่สามารถนำเรื่องดังกล่าวมาใช้เป็นสิทธิเรียกร้องความเสียหายจากเหตุดังกล่าวจากบริษัทจัดการได้แต่อย่างใด

สรุปข้อมูลด้านความยั่งยืน

(1) ประเภทของกองทุนรวม SRI และเกณฑ์การพิจารณาโดยสรุป	
ประเภท SRI ตามวัตถุประสงค์	SRI Promote
เกณฑ์การพิจารณาโดยสรุป	กองทุนเน้นลงทุนในกองทุนหลักที่มีวัตถุประสงค์การลงทุนในทรัพย์สินที่ส่งเสริมคุณลักษณะทางด้านสิ่งแวดล้อม และ/หรือ สังคม และธรรมาภิบาล โดยได้กำหนดสัดส่วนการลงทุนในทรัพย์สินที่ผ่านเกณฑ์การพิจารณาด้านความยั่งยืนของบริษัทจัดการกองทุนหลักเองเพื่อให้บรรลุวัตถุประสงค์ดังกล่าว
กองทุนปลายทาง / กองทุนหลัก	Allianz Dynamic Multi Asset Strategy SRI 50 (“กองทุนหลัก”) ซึ่งเป็นกองทุนที่อยู่ภายใต้ Article 8 of the Sustainable Finance Disclosure Regulation (SFDR) ที่เน้นลงทุนในทรัพย์สินที่สอดคล้องกับคุณลักษณะทางด้านสิ่งแวดล้อมและสังคม (E/S characteristics)
บริษัทที่บริหารจัดการกองทุน ปลายทาง / กองทุนหลัก	Allianz Global Investors GmbH
วัตถุประสงค์และนโยบายการลงทุนของกองทุนปลายทาง / กองทุนหลัก	กองทุนหลักมุ่งหวังการเติบโตของเงินลงทุนในระยะยาวโดยลงทุนในทรัพย์สินหลากหลายประเภท โดยเน้นการลงทุนในตลาดตราสารทุน และตราสารหนี้ทั่วโลก เพื่อสร้างผลตอบแทนในระยะปานกลางถึงระยะยาว โดยมีค่าความผันผวนอยู่ในช่วง 6% ถึง 12% ต่อปี และสอดคล้องกับคุณลักษณะทางด้านสิ่งแวดล้อมและสังคม (E/S Characteristics) โดยลงทุนไม่น้อยกว่าร้อยละ 70 ของทรัพย์สินของกองทุนในตราสารทุน พันธบัตร ตราสารตลาดเงิน กองทุนประเภท Target Funds และ/หรือทรัพย์สินประเภทอื่น ๆ ทั่วโลก ตามที่ระบุในวัตถุประสงค์การลงทุน ทั้งนี้ ไม่ต่ำกว่าร้อยละ 70 ของพอร์ตการลงทุนของกองทุนจะต้องได้รับการประเมินโดยใช้คะแนนภายใน (Internal Score) โดยพอร์ตการลงทุนในที่นี้จะไม่รวมสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่ไม่มีการจัดอันดับและตราสารที่ไม่มีการจัดอันดับโดยลักษณะตามธรรมชาติ (เช่น เงินสด และเงินฝากธนาคาร)
ความเชื่อมโยงกับ sustainability objective ของกองทุนรวม SRI	กองทุนหลักเป็นกองทุนที่อยู่ภายใต้ Article 8 of the Sustainable Finance Disclosure Regulation (SFDR) ที่เน้นลงทุนในทรัพย์สินที่สอดคล้องกับคุณลักษณะทางด้านสิ่งแวดล้อมและสังคม (E/S characteristics) โดยมีการคัดเลือกหลักทรัพย์ที่มีความสามารถในการเติบโตอย่างยั่งยืน ในขณะเดียวกันก็สร้างผลกระทบเชิงบวกต่อสังคมและสิ่งแวดล้อม โดยมีการใช้กรอบอ้างอิงตามหลักสากลที่เป็นที่ยอมรับ เช่น United Nations Sustainable Development Goals (UN SDGs) และ United Nations Global Impact เป็นต้น ดังนั้น กองทุนหลักจึงสอดคล้องกับวัตถุประสงค์เพื่อความยั่งยืน (Sustainability Objective) ของกองทุนรวม SRI
(2) เป้าหมายด้านความยั่งยืน	
เป้าหมายด้านความยั่งยืน	กองทุนเน้นลงทุนในกองทุนหลักที่การลงทุนมีการส่งเสริมคุณลักษณะด้านความยั่งยืนหลากหลาย ทั้งด้านสิ่งแวดล้อม และ/หรือ สังคม และธรรมาภิบาล โดยมีการกำหนดดัชนีชี้วัดความยั่งยืน (Sustainability Indicators) เพื่อประเมินการบรรลุเป้าหมายคุณลักษณะด้านสิ่งแวดล้อมและสังคม
เป้าหมายด้านความยั่งยืนของกองทุน ปลายทาง / กองทุนหลัก	กองทุนหลักประเมินการบรรลุคุณลักษณะด้านสิ่งแวดล้อมและสังคมโดยใช้ตัวชี้วัด (Sustainability Indicators) ดังต่อไปนี้ 1. ลดจำนวนผู้ออกหลักทรัพย์ใน Investment Universe การลงทุนลงอย่างน้อย 20% ผ่านเกณฑ์การคัดออก เมื่อเทียบกับ Investment Universe ตามกลยุทธ์ทั่วไปของกองทุน 2. สัดส่วนทรัพย์สินที่ได้รับคะแนนความยั่งยืนภายในตั้งแต่ 1 ขึ้นไป รวมถึงเงินลงทุนในกองทุน Target Funds ที่ปฏิบัติตามกฎระเบียบการเปิดเผยข้อมูลทางการเงินที่ยั่งยืน (SFDR Target Funds) 3. สัดส่วนการลงทุนที่ยั่งยืน 4. สัดส่วนการลงทุนที่สอดคล้องกับ EU Taxonomy

(3) กลยุทธ์การลงทุน (เพื่อการบรรลุวัตถุประสงค์ด้านความยั่งยืน)	
กลยุทธ์	กองทุนใช้กลยุทธ์การลงทุนผ่านการลงทุนในกองทุนหลักที่ใช้กลยุทธ์การลงทุนเพื่อความยั่งยืน ดังนี้ Negative Screening: ไม่ลงทุนในหลักทรัพย์ตามเกณฑ์การคัดหลักทรัพย์ที่ไม่ลงทุนออก (Exclusion Criteria) Positive Screening: คัดเลือกหลักทรัพย์ที่ลงทุนจากกลุ่มหลักทรัพย์ที่สามารถลงทุนได้นอกเหนือจากหลักทรัพย์ที่ผ่านการคัดกรองตามข้างต้น ESG Integration: นำหลักการ Exclusion Criteria และการประเมินภายใน รวมถึงการอ้างอิงหลักสากลในด้านสิ่งแวดล้อมและสังคมมาผสานเพื่อสร้างพอร์ตการลงทุน ให้เป็นไปตามวัตถุประสงค์ด้านความยั่งยืนตามที่กำหนดไว้
เหตุผลและหลักการที่เลือกใช้กลยุทธ์ดังกล่าว	กองทุนใช้กลยุทธ์การลงทุนผ่านการลงทุนในกองทุนหลัก เพื่อให้สอดคล้องกับกองทุนหลักและเป็นไปตามวัตถุประสงค์การลงทุนเพื่อความยั่งยืนของกองทุน
กลยุทธ์การลงทุนเพื่อบรรลุเป้าหมายด้านความยั่งยืนของกองทุนปลายทาง / กองทุนหลัก	กองทุนหลักใช้กลยุทธ์การลงทุนเพื่อความยั่งยืน โดยส่งเสริมการลงทุนในทรัพย์สินที่คำนึงถึงหลักเกณฑ์ทางด้านสิ่งแวดล้อม สังคม และธรรมาภิบาล ควบคู่ไปกับการใช้หลักเกณฑ์ขั้นต่ำในการคัดกรองหลักทรัพย์ที่ไม่ผ่านเกณฑ์การลงทุน (Minimum Exclusion Criteria) ออกจากพอร์ตการลงทุน และคัดเลือกหลักทรัพย์ที่มีผลการดำเนินงานด้านความยั่งยืนในระดับที่ดีกว่าจากกลุ่มหลักทรัพย์ที่สามารถลงทุนได้ที่เหลืออยู่ Negative Screening: กองทุนหลักจะไม่ลงทุนในหลักทรัพย์ตามเกณฑ์การคัดหลักทรัพย์ที่ไม่ลงทุนออก (Exclusion Criteria) Positive Screening: กองทุนหลักจะคัดเลือกหลักทรัพย์ที่ลงทุนจากกลุ่มหลักทรัพย์ที่สามารถลงทุนได้นอกเหนือจากหลักทรัพย์ที่ผ่านการคัดกรองตามข้างต้น ESG Integration: กองทุนหลักได้นำหลักการ Exclusion Criteria และการประเมินภายใน รวมถึงการอ้างอิงหลักสากลในด้านสิ่งแวดล้อมและสังคม มาผสานเพื่อสร้างพอร์ตการลงทุน ให้เป็นไปตามวัตถุประสงค์ด้านความยั่งยืนตามที่กำหนดไว้
(4) กรอบการลงทุน	
ลักษณะ/ขอบเขตการลงทุนหลัก	กองทุนเน้นลงทุนในกองทุนหลักที่อยู่ภายใต้ Article 8 of the Sustainable Finance Disclosure Regulation (SFDR) ซึ่งเน้นลงทุนในทรัพย์สินที่สอดคล้องกับคุณลักษณะทางด้านสิ่งแวดล้อมและสังคม (E/S characteristics) หลากหลายประเภท
กรอบการลงทุนของกองทุนรวม SRI และกรอบการลงทุนของกองทุนปลายทาง / กองทุนหลักโดยสรุป	กองทุนหลักจะลงทุนไม่น้อยกว่าร้อยละ 70 ของทรัพย์สินของกองทุน (ไม่รวมเงินสด เงินฝาก และตราสารอนุพันธ์ที่ไม่ได้รับการจัดอันดับ) เพื่อให้เป็นไปตามวัตถุประสงค์ด้านสิ่งแวดล้อมและสังคมตามที่กำหนดไว้ ทั้งนี้ อย่างน้อย 15% ของทรัพย์สินของกองทุนหลักจะลงทุนในหลักทรัพย์ที่ส่งเสริมความยั่งยืน โดยสัดส่วนการลงทุนขั้นต่ำที่สอดคล้องกับ EU Taxonomy เท่ากับ 0.01% อย่างไรก็ดี โดยรวมแล้วผู้จัดการลงทุนจะต้องลงทุนไม่ต่ำกว่าร้อยละ 80 ของทรัพย์สินของกองทุนหลักในหลักทรัพย์ที่ได้รับการจัดอันดับคะแนนภายใน (Internal Score) โดยตรง หรือผ่านกองทุน SFDR Target Funds นอกจากนี้ กองทุนหลักจะไม่ลงทุนในบริษัทที่มีส่วนเกี่ยวข้องกับกิจกรรมทางธุรกิจที่ก่อให้เกิดข้อโต้แย้งด้านสิ่งแวดล้อมหรือสังคม หรือบริษัทที่มีการละเมิดหลักปฏิบัติ หลักการ และแนวทางด้านการกำกับดูแลกิจการที่ร้ายแรง เช่น หลักการของข้อตกลงโลกแห่งสหประชาชาติ (UN Global Compact: UNGC) รวมทั้งจะไม่ลงทุนในกิจการที่เกี่ยวข้องกับก๊าซฟอสซิล (Fossil gas) และ/หรือพลังงานนิวเคลียร์ (Nuclear energy) ซึ่งสอดคล้องกับหลักเกณฑ์ของ EU Taxonomy เป็นต้น
เว็บไซต์ของกองทุนปลายทาง / กองทุนหลัก	https://lu.allianzgi.com/en-gb/pro/our-funds/funds/list/allianz-dynamic-multi-asset-strategy-sri-50-peur?nav=overview

คำอธิบาย

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

Recovering Period ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาดังแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลานานเท่าใด

FX Hedging เพอร์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตกองทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลาหนึ่ง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์กับผลรวมของมูลค่าการขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 1 ปีหารด้วยมูลค่า NAV ของกองทุนรวมเฉลี่ยในรอบระยะเวลาเดียวกัน กองทุนรวมที่มีค่า portfolio turnover สูง บ่งชี้ถึงการซื้อขายหลักทรัพย์บ่อยครั้งของผู้จัดการกองทุนและทำให้มีต้นทุนการซื้อขายหลักทรัพย์ที่สูง จึงต้องพิจารณาเปรียบเทียบกับผลการดำเนินงานของกองทุนรวมเพื่อประเมินความคุ้มค่าของการซื้อขายหลักทรัพย์ดังกล่าว

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 ระดับและทิศทางของการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุน โดยเปรียบเทียบกับอัตราการเปลี่ยนแปลงของตลาด Beta น้อยกว่า 1 แสดงว่า หลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนน้อยกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด Beta มากกว่า 1 แสดงว่า หลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนมากกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด

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

Yield to Maturity อัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในตราสารหนี้โดยถือจนครบกำหนดอายุ ซึ่งคำนวณจากดอกเบี้ยที่จะได้รับในอนาคตตลอดอายุตราสารและเงินต้นที่จะได้รับคืน นำมาคิดลดเป็นมูลค่าปัจจุบัน โดยใช้วัดอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมตราสารหนี้ คำนวณจากค่าเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักของ Yield to Maturity ของตราสารหนี้แต่ละตัวที่กองทุนมีการลงทุน และเนื่องจาก Yield to Maturity มีหน่วยมาตรฐานเป็นเปอร์เซ็นต์ต่อปี จึงสามารถนำไปใช้เปรียบเทียบอัตราผลตอบแทนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีนโยบายถือครองตราสารหนี้จนครบกำหนดอายุและมีลักษณะการลงทุนที่ใกล้เคียงกันได้

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด

898 อาคารเพลินจิตทาวเวอร์ ชั้นที่ 1 โชนเอ, 2 โชนเอ และ 12

ถนนเพลินจิต แขวงลุมพินี เขตปทุมวัน กรุงเทพมหานคร 10330

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

Website: www.krungsriasset.com