กองทุนเปิดกรุงศรีโอเรียนทัลเฟล็กซ์

KF-ORTFLEX

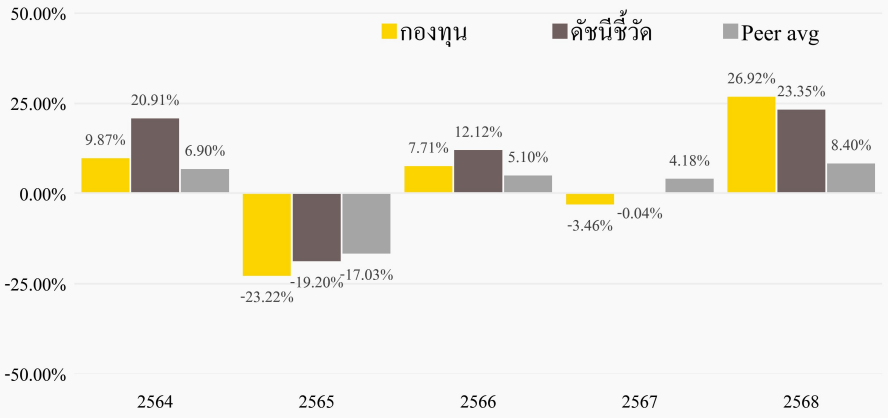
ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมผสม/ กองทุนรวมฟีดเดอร์ (Feeder Fund)
- กองทุนรวมที่เน้นลงทุนแบบมีความเสี่ยงต่างประเทศ
- กลุ่มกองทุนรวม : Foreign Investment Allocation

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- ลงทุนในกองทุนรวมต่างประเทศชื่อ Allianz Oriental Income Fund (กองทุนหลัก) โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่ต่ำกว่าร้อยละ 80 ของ NAV
- กองทุนหลักมีนโยบายเน้นลงทุนในตลาดตราสารทุน และตราสารหนี้ในภูมิภาคเอเชีย-แปซิฟิก
- บริษัทที่บริหารจัดการกองทุนหลัก คือ Allianz Global Investors GmbH
- กองทุนไทยมุ่งหวังให้ผลประกอบการเคลื่อนไหวตามกองทุนหลัก ส่วนกองทุนหลักมุ่งหวังให้ผลประกอบการสูงกว่าดัชนีชี้วัด (Active management)

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (% ต่อปี)



* ในปีที่กองทุนจัดตั้ง ผลการดำเนินงานจะแสดงตั้งแต่วันที่จัดตั้งจนถึงสิ้นปีปฏิทิน

ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด (% ต่อปี)

	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี *
กองทุน	11.47	-2.25	-9.72	12.09
ดัชนีชี้วัด	23.26	-0.47	-4.90	21.78
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	4.57	-1.09	0.38	4.15
ความผันผวนกองทุน	33.37	26.46	34.09	31.35
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	31.73	26.17	32.28	30.19
	3 ปี *	5 ปี *	10 ปี *	ตั้งแต่จัดตั้ง
กองทุน	16.12	3.15	7.87	5.26
ดัชนีชี้วัด	18.79	7.42	12.09	7.43
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	8.15	0.28	3.07	N/A
ความผันผวนกองทุน	24.06	22.88	20.32	18.38
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	24.11	22.46	20.27	18.51

* ผลตอบแทนที่มีอายุเกินหนึ่งปีจะแสดงเป็นผลตอบแทนต่อปี
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกันตามกลุ่ม Foreign Investment Allocation

ระดับความเสี่ยง

ต่ำ | 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | **6** | 7 | 8 | สูง

เสี่ยงสูง

ลงทุนในตราสารทุน ตราสารหนี้และ/หรือทรัพย์สินทางเลือก โดยมีสัดส่วนการลงทุนในตราสารทุนไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน	1 มีนาคม 2550
นโยบายการจ่ายเงินปันผล	ไม่จ่าย
อายุกองทุน	ไม่กำหนดอายุโครงการ
การป้องกันความเสี่ยง FX	ตามดุลยพินิจของผู้จัดการกองทุน

ผู้จัดการกองทุนรวม

นาย จาตุรันต์ สอนไว (13 กันยายน 2554)

นาย ชูศักดิ์ อวยพรชัยสกุล (5 มกราคม 2560)

ดัชนีชี้วัด

ผลการดำเนินงานของกองทุนหลัก สัดส่วน 100.00% ปรับด้วยอัตราแลกเปลี่ยนเพื่อเทียบเท่าค่าสกุลเงินบาท ณ วันที่คำนวณผลตอบแทน

คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวมมิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต: ได้รับการรับรองจาก CAC

ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือบริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่องได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

www.krungsriasset.com

การซื้อหน่วยลงทุน

วันทำการซื้อ: ตามวันทำการกองทุน

เวลาทำการ: 08:30 น. - 15:30 น.

การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ: 500 บาท

การซื้อครั้งถัดไปขั้นต่ำ: 500 บาท

การขายคืนหน่วยลงทุน

วันทำการขายคืน: ตามวันทำการกองทุน

เวลาทำการ: 08:30 น. - 14:30 น.

การขายคืนขั้นต่ำ: 500 บาท หรือ 50 หน่วย

ยอดคงเหลือขั้นต่ำ: 50 หน่วย

ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน: ภายใน 7 วันทำการนับถัดจากวันทำรายการขายคืน โดยทั่วไปจะได้รับเงิน 4 วันทำการนับถัดจากวันทำรายการขายคืน (T+4)

ข้อมูลเชิงสถิติ

Maximum Drawdown	**-35.63 %**
Recovering Period	**2 ปี 11 เดือน 22 วัน**
FX Hedging	**91.38 %**
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน	**0.49 เท่า**
Sharpe Ratio	**0.61**
Alpha	**-2.67 %**
Beta	**N/A**

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปี ของ NAV)

ค่าธรรมเนียมต่อไปนี้จะส่งผลกระทบต่อผู้ลงทุน เนื่องจากจะทำให้ผลตอบแทนจากการลงทุนลดลง ดังนั้น ผู้ลงทุนควรตรวจสอบทุกครั้งก่อนตัดสินใจลงทุน

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	**1.6050**	**1.0700**
ค่าตอบแทนแก่ผู้สนับสนุนการขายหรือรับซื้อคืนหน่วยลงทุนของกองทุนรวม (trailer fee): มี		
รวมค่าใช้จ่าย	**2.0437**	**1.2810**

หมายเหตุ

(1) กองทุนหลักคืนค่าธรรมเนียมการจัดการให้แก่กองทุนไทยในอัตราประมาณ 50% ของค่าธรรมเนียมการจัดการของกองทุนหลักต่อปี

(2) ค่าตอบแทนแก่ผู้สนับสนุนการขายหรือรับซื้อคืนหน่วยลงทุน (trailer fee) เป็นส่วนหนึ่งของค่าธรรมเนียมการจัดการ

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)

ผู้ลงทุนจะถูกเรียกเก็บค่าธรรมเนียมต่อไปนี้โดยตรงทุกครั้งเมื่อทำรายการซื้อขายหรือสับเปลี่ยนหน่วยลงทุน

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การขาย	3.00	1.50
การรับซื้อคืน	ไม่มี	ไม่มี
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า	3.00	1.50
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก	ไม่มี	ไม่มี
การโอนหน่วย	10 บาทต่อ 1,000 หน่วย	10 บาทต่อ 1,000 หน่วย

หมายเหตุ

- ค่าธรรมเนียมดังกล่าวเป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว
- บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ
- บริษัทจัดการอาจยกเว้นไม่เรียกเก็บค่าธรรมเนียมการโอนหน่วยลงทุน โดยขึ้นอยู่กับดุลยพินิจของบริษัทจัดการ

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน (% NAV)

Allianz Oriental Income Fund	98.73
เงินฝาก หรือตราสารหนี้ที่สถาบันการเงินเป็นผู้ออก	2.08
ทรัพย์สินอื่น	0.42
หนี้สินอื่น	-1.23

การจัดสรรการลงทุนในต่างประเทศ (% NAV)

Japan	31.20
Taiwan	23.80
Korea	18.90
China	9.50
Australia	4.70

ข้อมูลกองทุนหลัก ณ 30 กันยายน 2569

การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม/ทรัพย์สิน (% NAV)

IT	44.20
Industrials	29.60
Financials	8.50
Healthcare	7.60
Cons. Disc.	4.00

ข้อมูลกองทุนหลัก ณ 30 กันยายน 2569

ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก

Holding	% NAV
Aspeed Technology Inc	7.10
SK Hynix Inc	4.70
Mitsubishi Heavy Industries	4.50
EO Technics Co Ltd	4.20
ASE Technology Holding Co Ltd	4.00

ข้อมูลกองทุนหลัก ณ 30 กันยายน 2569

การลงทุนในกองทุนอื่นเกินกว่า 20% (กองในประเทศและกองต่างประเทศ)

ชื่อกอง : Allianz Oriental Income Fund, Class AT acc

ISIN code : LU0348784397

Bloomberg code : ALORIAA LX

ข้อมูลอื่นๆ

- ผู้ลงทุนสามารถซื้อกรมธรรม์ประกันชีวิตควบหน่วยลงทุน (Unit-Linked) ของกองทุนนี้ได้โดยติดต่อกับบริษัทประกันชีวิตที่บริษัทจัดการกำหนด ทั้งนี้ การซื้อกรมธรรม์ประกันชีวิตควบหน่วยลงทุนอาจมีข้อกำหนดและวิธีปฏิบัติที่แตกต่างไปจากผู้ถือหน่วยลงทุนปกติที่ซื้อขายหน่วยลงทุนของกองทุนนี้เพียงอย่างเดียว ผู้ลงทุนจึงควรศึกษารายละเอียดในเอกสารประกอบการขายกรมธรรม์ประกันชีวิตควบหน่วยลงทุนให้เข้าใจก่อนการตัดสินใจลงทุน
- บริษัทจัดการจะปฏิบัติตามกฎเกณฑ์ของกองทุนหลักโดยรายงานการถือครองหน่วยลงทุนตั้งแต่ร้อยละ 10 ของจำนวนหน่วยลงทุนที่จำหน่ายได้แล้วทั้งหมดของกองทุนให้กับผู้มีอำนาจหน้าที่ของกองทุนหลัก และอาจนำส่งข้อมูลส่วนตัวของผู้ถือหน่วยลงทุนดังกล่าวเช่น สำเนาบัตรประจำตัวประชาชนและ/หรือสำเนาหนังสือเดินทาง เป็นต้น และ/หรือขอข้อมูลหรือเอกสารเพิ่มเติมอื่นใดจากผู้ถือหน่วยลงทุนในภายหลังก็ได้ เพื่อให้เป็นไปตามที่กองทุนหลักร้องขอ หากผู้ถือหน่วยลงทุนรายใดปฏิเสธการให้ข้อมูลหรือเอกสารเพิ่มเติมดังกล่าวหรือมีพฤติกรรมเข้าข่ายและ/หรือมีความผิดตามกฎหมายอันมีผลทำให้บริษัทจัดการไม่สามารถปฏิบัติตามกฎเกณฑ์ของกองทุนหลักได้ บริษัทจัดการขอสงวนสิทธิที่จะระงับหรือหยุดให้บริการและดำเนินการคืนเงินลงทุนตามมูลค่าหน่วยลงทุนให้แก่ผู้ถือหน่วยลงทุน โดยถือว่าได้รับความเห็นชอบจากผู้ถือหน่วยลงทุนแล้ว ทั้งนี้ ผู้ถือหน่วยลงทุนจะไม่สามารถนำเรื่องดังกล่าวมาใช้เป็นสิทธิเรียกร้องความเสียหายจากเหตุดังกล่าวจากบริษัทจัดการได้แต่อย่างใด

คำอธิบาย

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

Recovering Period ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาตั้งแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลานานเท่าใด

FX Hedging เปอร์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตกองทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลาหนึ่ง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อหลักทรัพย์กับผลรวมของมูลค่าการขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 1 ปีหารด้วยมูลค่า NAV ของกองทุนรวมเฉลี่ยในรอบระยะเวลาเดียวกัน กองทุนรวมที่มีค่า portfolio turnover สูงบ่งชี้ถึงการซื้อขายหลักทรัพย์บ่อยครั้งของผู้จัดการกองทุนและทำให้มีต้นทุนการซื้อขายหลักทรัพย์ที่สูง จึงต้องพิจารณเปรียบเทียบกับผลการดำเนินงานของกองทุนรวมเพื่อประเมินความคุ้มค่าของการซื้อขายหลักทรัพย์ดังกล่าว

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

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 โดยใช้วัดอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมตราสารหนี้ คำนวณจากค่าเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักของ Yield to Maturity ของตราสารหนี้แต่ละตัวที่กองทุนมีการลงทุน และเนื่องจาก Yield to Maturity มีหน่วยมาตรฐานเป็นเปอร์เซ็นต์ต่อปี จึงสามารถนำไปใช้เปรียบเทียบอัตราผลตอบแทนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีนโยบายถือครองตราสารหนี้จนครบกำหนดอายุและมีลักษณะการลงทุนที่ใกล้เคียงกันได้

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด
เลขที่ 898 อาคารเพลินจิตทาวเวอร์ ชั้นที่ 1 โซนเอ, 2 โซนเอ และ 12
ถนนเพลินจิต แขวงลุมพินี เขตปทุมวัน กรุงเทพฯ 10330
โทรศัพท์ 0-2657-5757 โทรสาร 0-2657-5777
เว็บไซต์: www.krungsriasset.com