

## กองทุนเปิดกรุงศรีไชน่าเมกะเทรนด์-ผู้ลงทุนสถาบัน

หน่วยลงทุนชนิดผู้ลงทุนสถาบัน

KFCMEGA-I

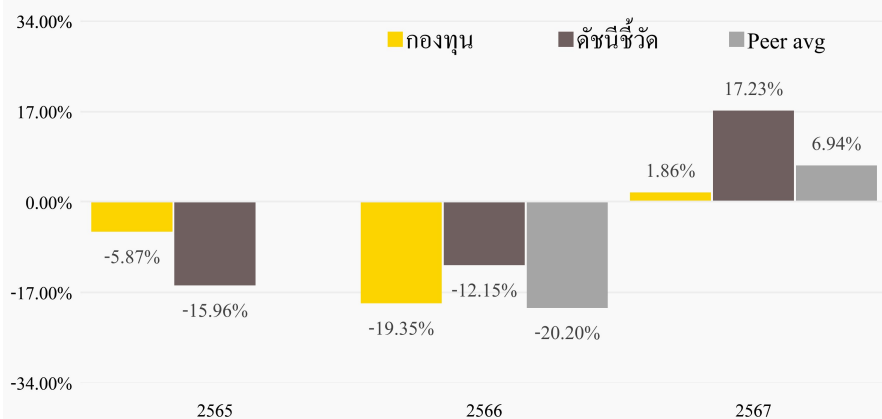
### ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมตราสารทุน/ กองทุนรวมหน่วยลงทุนประเภท Fund of Funds
- กองทุนรวมที่เน้นลงทุนแบบมีความเสี่ยงต่างประเทศ
- กลุ่มกองทุนรวม : Greater China Equity

### นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- ลงทุนในกองทุนรวมและ/หรือกองทุนรวมอิตีเอฟต่างประเทศที่มีนโยบายลงทุนในหลักทรัพย์จดทะเบียนในประเทศจีน และ/หรือมีธุรกิจหลักหรือมีรายได้ส่วนใหญ่จากการประกอบธุรกิจในประเทศจีน ได้รับประโยชน์จากการเติบโตของเมกะเทรนด์อย่างน้อย 2 กองทุน โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของ NAV ได้แก่
  1. Global X MSCI China Consumer Discretionary ETF บริหาร โดย Global X Management Company LLC.
  2. iShares China Large-Cap ETF บริหาร โดย BlackRock Fund Advisors
  3. KraneShares CSI China Internet ETF บริหาร โดย Krane Funds Advisor LLC.
  4. Invesco China Technology ETF บริหาร โดย Invesco Capital Management LLC
- กองทุนอาจลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเพื่อเพื่อเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน (Efficient Portfolio Management) โดยขึ้นอยู่กับดุลยพินิจของผู้จัดการกองทุน
- มุ่งหวังให้ผลประกอบการสูงกว่าดัชนีชี้วัด (Active Management)
- ป้องกันความเสี่ยงอัตราแลกเปลี่ยนตามดุลยพินิจของผู้จัดการกองทุน

### ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (% ต่อปี)



\* ในปีที่กองทุนจัดตั้ง ผลการดำเนินงานจะแสดงตั้งแต่วันที่จัดตั้งจนถึงสิ้นปีปฏิทิน

### ระดับความเสี่ยง



เสี่ยงสูง

ลงทุนในตราสารทุนเป็นหลักโดยเฉลี่ยในรอบปี  
ไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV

### ข้อมูลกองทุนรวม

|                        |                     |
|------------------------|---------------------|
| วันจดทะเบียนกองทุน     | 17 มิถุนายน 2564    |
| วันเริ่มต้น class      | 2 พฤศจิกายน 2564    |
| นโยบายการจ่ายเงินปันผล | ไม่จ่าย             |
| อายุกองทุน             | ไม่กำหนดอายุโครงการ |

### ผู้จัดการกองทุนรวม

นาย จาตุรันต์ สอนไว (2 พฤศจิกายน 2564)

นาย ชุตติ์ อวยพรชัยสกุล (2 พฤศจิกายน 2564)

### ดัชนีชี้วัด

Morningstar China NR (USD) Index สัดส่วน 100.00% ใน  
สกุลเงินเหรียญสหรัฐฯ ปรับด้วยอัตราแลกเปลี่ยนเพื่อ  
เทียบเท่ากับสกุลเงินบาท ณ วันที่คำนวณผลตอบแทน

วัตถุประสงค์การอ้างอิงดัชนีชี้วัด: บริษัทจัดการใช้ดัชนีชี้วัด  
ดังกล่าวเพื่อเปรียบเทียบผลการดำเนินงานของกองทุนรวม

### คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวมมิได้เป็น  
สิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต: ได้รับการรับรองจาก CAC

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



www.krungsriasset.com

ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือ  
บริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่อง  
ได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด (% ต่อปี)

|                          | YTD    | 3 เดือน | 6 เดือน | 1 ปี *            |
|--------------------------|--------|---------|---------|-------------------|
| กองทุน                   | 29.45  | 15.60   | 12.95   | 18.83             |
| ดัชนีชี้วัด              | 33.55  | 19.63   | 17.96   | 30.03             |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน | 29.14  | 17.96   | 17.81   | 21.73             |
| ความผันผวนกองทุน         | 30.04  | 19.48   | 29.56   | 35.58             |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด    | 24.67  | 14.61   | 24.62   | 26.13             |
|                          | 3 ปี * | 5 ปี *  | 10 ปี * | ตั้งแต่จัดตั้ง ** |
| กองทุน                   | 4.45   | N/A     | N/A     | 0.04              |
| ดัชนีชี้วัด              | 12.61  | N/A     | N/A     | 9.23              |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน | 6.69   | N/A     | N/A     | N/A               |
| ความผันผวนกองทุน         | 32.73  | N/A     | N/A     | 32.70             |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด    | 24.23  | N/A     | N/A     | 24.17             |

\* ผลตอบแทนที่มีอายุเกินหนึ่งปีจะแสดงเป็นผลตอบแทนต่อปี

\*\* ผลการดำเนินงานเริ่มคำนวณตั้งแต่วันที่ 14 กันยายน 2565

ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกันตามกลุ่ม Greater China Equity

การซื้อขายหน่วยลงทุน

วันทำการซื้อ: ตามวันทำการกองทุน

เวลาทำการ: 08:30 น. - 15:30 น.

การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ: ไม่กำหนด

การซื้อครั้งถัดไปขั้นต่ำ: ไม่กำหนด

การขายคืนหน่วยลงทุน

วันทำการขายคืน: ตามวันทำการกองทุน

เวลาทำการ: 08:30 น. - 15:30 น.

การขายคืนขั้นต่ำ: ไม่กำหนด

ยอดคงเหลือขั้นต่ำ: ไม่กำหนด

ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน: ภายใน 6 วันทำการ  
นับถัดจากวันทำการขายคืน โดยทั่วไปจะได้  
รับเงิน 3 วันทำการนับถัดจากวันทำการขายคืน  
(T+3)

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปี ของ NAV)

| ค่าธรรมเนียม  | สูงสุดไม่เกิน | เก็บจริง |
|---------------|---------------|----------|
| การจัดการ     | 2.1400        | 1.3375   |
| รวมค่าใช้จ่าย | 4.6545        | 1.5350   |

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)

| ค่าธรรมเนียม                | สูงสุดไม่เกิน         | เก็บจริง              |
|-----------------------------|-----------------------|-----------------------|
| การขาย                      | 2.00                  | ยังไม่เรียกเก็บ       |
| การรับซื้อคืน               | 2.00                  | ยังไม่เรียกเก็บ       |
| การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า | 2.00                  | ยังไม่เรียกเก็บ       |
| การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก  | 2.00                  | ยังไม่เรียกเก็บ       |
| การโอนหน่วย                 | 10 บาทต่อ 1,000 หน่วย | 10 บาทต่อ 1,000 หน่วย |

หมายเหตุ

- ค่าธรรมเนียมดังกล่าวเป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว
- บริษัทจัดการขอสงวนสิทธิในการยกเว้นโดยไม่เรียกเก็บค่าธรรมเนียมการสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนระหว่างชนิดหน่วยลงทุนภายใต้กองทุนนี้ โดยขึ้นอยู่กับดุลยพินิจของบริษัทจัดการ
- บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ
- บริษัทจัดการอาจยกเว้นไม่เรียกเก็บค่าธรรมเนียมการโอนหน่วยลงทุน โดยขึ้นอยู่กับดุลยพินิจของบริษัทจัดการ

ข้อมูลเชิงสถิติ

|                            |           |
|----------------------------|-----------|
| Maximum Drawdown           | -42.53 %  |
| Recovering Period          | 0.00      |
| FX Hedging                 | 95.78 %   |
| อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน | 0.21 เท่า |
| Sharpe Ratio               | 0.08      |
| Alpha                      | -8.16 %   |
| Beta                       | N/A       |

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน (% NAV)

|                                                  |       |
|--------------------------------------------------|-------|
| iShares China Large-Cap ETF                      | 33.10 |
| KraneShares CSI China Internet Fund              | 25.98 |
| Global X MSCI China Consumer Discretionary ETF   | 24.30 |
| Invesco China Technology ETF                     | 11.75 |
| เงินฝาก หรือตราสารหนี้ที่สถาบันการเงินเป็นผู้ออก | 3.03  |
| GLOBAL X China Consumer Brand ETF                | 2.21  |
| ทรัพย์สินอื่น                                    | 1.44  |
| หนี้สินอื่น                                      | -1.81 |

การจัดสรรการลงทุนในต่างประเทศ (% NAV)

|                                    |        |
|------------------------------------|--------|
| China                              | 100.00 |
| ข้อมูลกองทุนหลัก ณ 29 สิงหาคม 2568 |        |

การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม/ทรัพย์สิน (% NAV)

|                                           |       |
|-------------------------------------------|-------|
| Distribution & Retail                     | 34.50 |
| Automobiles & Components                  | 27.66 |
| Consumer Durables & Apparel               | 17.92 |
| Consumer Services                         | 15.48 |
| Materials                                 | 3.68  |
| ข้อมูลกองทุนหลัก ณ 29 สิงหาคม 2568 (CHIQ) |       |

ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก

| Holding                                   | % NAV |
|-------------------------------------------|-------|
| PDD Holdings Inc                          | 9.14  |
| Alibaba Group Holding Ltd                 | 8.32  |
| Byd Co Ltd-h                              | 7.28  |
| Meituan-class B                           | 7.23  |
| Jd.com Inc-class A                        | 5.31  |
| ข้อมูลกองทุนหลัก ณ 29 สิงหาคม 2568 (CHIQ) |       |

การลงทุนในกองทุนอื่นเกินกว่า 20% (กองในประเทศและกองต่างประเทศ)

|                                                          |                                                   |
|----------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|
| ชื่อกอง : Global X MSCI China Consumer Discretionary ETF | ISIN code : US37950E4089<br>Bloomberg code : CHIQ |
| ชื่อกอง : iShares China Large-Cap ETF                    | ISIN code : US4642871846<br>Bloomberg code : FXI  |
| ชื่อกอง : KraneShares CSI China Internet ETF             | ISIN code : US5007673065<br>Bloomberg code : KWEB |
| ชื่อกอง : Invesco China Technology ETF                   | ISIN code : US46138E8003<br>Bloomberg code : CQQQ |

- ผู้ลงทุนสามารถซื้อกรรมสิทธิ์ประกันชีวิตควบหน่วยลงทุน (Unit-Linked) ของกองทุนนี้ได้โดยติดต่อกับบริษัทประกันชีวิตที่บริษัทจัดการกำหนด ทั้งนี้ การซื้อกรรมสิทธิ์ประกันชีวิตควบหน่วยลงทุนอาจมีข้อกำหนดและวิธีปฏิบัติที่แตกต่างไปจากผู้ถือหน่วยลงทุนปกติที่ซื้อหน่วยลงทุนของกองทุนนี้เพียงอย่างเดียว ผู้ลงทุนจึงควรศึกษารายละเอียดในเอกสารประกอบการขายกรรมสิทธิ์ประกันชีวิตควบหน่วยลงทุนให้เข้าใจก่อนการตัดสินใจลงทุน
- บริษัทจัดการจะปฏิบัติตามกฎเกณฑ์ของกองทุนหลักโดยรายงานการถือครองหน่วยลงทุนตั้งแต่ร้อยละ 10 ของจำนวนหน่วยลงทุนที่จำหน่ายได้แล้วทั้งหมดของกองทุนให้กับผู้มีอำนาจหน้าที่ของกองทุนหลัก และอาจนำส่งข้อมูลส่วนตัวของผู้ถือหน่วยลงทุนดังกล่าวเช่น สำเนาบัตรประจำตัวประชาชนและ/หรือสำเนาหนังสือเดินทาง เป็นต้น และ/หรือขอข้อมูลหรือเอกสารเพิ่มเติมอื่นใดจากผู้ถือหน่วยลงทุนในภายหลังก็ได้ เพื่อให้เป็นไปตามที่กองทุนหลักร้องขอ หากผู้ถือหน่วยลงทุนรายใดปฏิเสธการให้ข้อมูลหรือเอกสารเพิ่มเติมดังกล่าวหรือมีพฤติกรรมเข้าข่ายและ/หรือมีความผิดตามกฎหมายอันมีผลทำให้บริษัทจัดการไม่สามารถปฏิบัติตามกฎเกณฑ์ของกองทุนหลักได้ บริษัทจัดการขอสงวนสิทธิ์ที่จะระงับหรือหยุดให้บริการและดำเนินการคืนเงินลงทุนตามมูลค่าหน่วยลงทุนให้แก่ผู้ถือหน่วยลงทุน โดยถือว่าได้รับความเห็นชอบจากผู้ถือหน่วยลงทุนแล้ว ทั้งนี้ ผู้ถือหน่วยลงทุนจะไม่สามารถนำเรื่องดังกล่าวมาใช้เป็นสิทธิเรียกร้องความเสียหายจากเหตุดังกล่าวจากบริษัทจัดการได้แต่อย่างใด

คำอธิบาย

**Maximum Drawdown** เปรอร์เซ็นต์ผลขาดทุนสูงสุดของกองทุนรวมในระยะเวลา 5 ปีย้อนหลัง (หรือตั้งแต่จัดตั้งกองทุนกรณีที่ยังไม่ครบ 5 ปี) โดยวัดจากระดับ NAV ต่อหน่วยที่จุดสูงสุด ไปจนถึงจุดต่ำสุดในช่วงที่ NAV ต่อหน่วยปรับตัวลดลง ค่า Maximum Drawdown เป็นข้อมูลที่จะช่วยให้ทราบถึงความเสี่ยงที่อาจจะขาดทุนจากการลงทุนในกองทุนรวม

**Recovering Period** ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาดังแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ที่เงินทุนเริ่มคืนใช้ระยะเวลานานเท่าใด

**FX Hedging** เปรอร์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

**อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน** ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตกองทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลาหนึ่ง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์กับผลรวมของมูลค่าการขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 1 ปีหารด้วยมูลค่า NAV ของกองทุนรวมเฉลี่ยในรอบระยะเวลาเดียวกัน กองทุนรวมที่มีค่า portfolio turnover สูง บ่งชี้ถึงการซื้อขายหลักทรัพย์บ่อยครั้งของผู้จัดการกองทุนและทำให้มีต้นทุนการซื้อขายหลักทรัพย์ที่สูง 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 หมายถึงกองทุนมีประสิทธิภาพในการสร้างผลตอบแทนให้ใกล้เคียงกับดัชนีชี้วัด 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**  
ที่อยู่ 898 อาคารเพลินจิตทาวเวอร์ ชั้น 1-2 โซนเอ ชั้น 12 ชั้น 18 โซนบี  
ถนนเพลินจิต แขวงลุมพินี เขตปทุมวัน กรุงเทพฯ 10330  
โทรศัพท์ 0-2657-5757 โทรสาร 0-2657-5777  
เว็บไซต์: www.krungsriasset.com

คำเตือน

ข้อมูลดัชนีของมอร์นิ่งสตาร์ ถือเป็นเอกสารที่เฉพาะของบริษัทมอร์นิ่งสตาร์ บริษัทมอร์นิ่งสตาร์ รวมถึงบริษัทในเครือและบริษัทย่อย ผู้ให้บริการข้อมูลทั้งทางตรงและทางอ้อม และบุคคลภายนอก ที่เกี่ยวข้อง หรือมีส่วนในการรวบรวม การคำนวณ หรือ การจัดทำดัชนีมอร์นิ่งสตาร์ (ซึ่งต่อไปนี้จะถูกกล่าวถึงโดยใช้คำว่า “Morningstar Parties”) ไม่รับรองความถูกต้อง ครบถ้วน และ/หรือ ความรวดเร็วในการอัปเดตข้อมูลดัชนีมอร์นิ่งสตาร์หรือข้อมูลอื่นๆที่ถูกรวมอยู่ภายใต้ดัชนีนั้นๆ และจะไม่มีส่วนในการรับผิดชอบในความผิดพลาด ไม่ครบถ้วน หรือการหยุดให้บริการข้อมูลเหล่านั้น ไม่มีบริษัทหรือบุคคลใดใน Morningstar Parties ทำหน้าที่เป็นตัวแทน หรือ รับประกันโดยชัดแจ้งหรือโดยนัย ถึงผลที่ได้รับจากการใช้งานดัชนีของมอร์นิ่งสตาร์ หรือข้อมูลอื่นๆที่ถูกรวมอยู่ภายใต้ดัชนีนั้นๆ