

กองทุนเปิดกรุงศรี Equity Sustainable Global Growth เพื่อการเลี้ยงชีพ

KFESGRMF

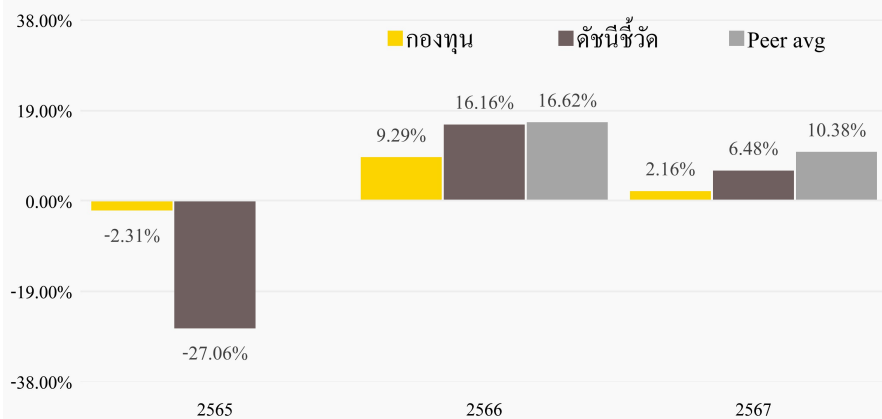
ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมตราสารแห่งทุน / กองทุนรวมฟีดเดอร์ (Feeder Fund)/ กองทุนรวมเพื่อการเลี้ยงชีพ/ กองทุนรวม ESG (non-SRI Fund)
- กองทุนรวมที่เน้นลงทุนแบบมีความเสี่ยงต่างประเทศ
- กลุ่มกองทุนรวม : Global Equity Fully FX Risk Hedge

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- ลงทุนในกองทุนรวมต่างประเทศชื่อ AB Sustainable Global Thematic Portfolio, Class S1 USD (กองทุนหลัก) โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของ NAV
- กองทุนหลักมีนโยบายลงทุนในตราสารทุนของบริษัทต่างๆ ทั่วโลกที่ให้ความสำคัญกับสิ่งแวดล้อม สังคม และบรรษัทภิบาล (ESG) และสอดคล้องกับธีมการลงทุนแบบยั่งยืนมากที่สุด
- บริษัทบริหารจัดการกองทุนหลัก คือ AllianceBernstein (Luxembourg) S.a.r.l.
- กองทุนอาจลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเพื่อเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน (Efficient Portfolio Management) โดยขึ้นอยู่กับดุลยพินิจของผู้จัดการกองทุน
- มุ่งหวังให้ผลประกอบการเคลื่อนไหวตามกองทุนหลัก ส่วนกองทุนหลักมุ่งหวังให้ผลประกอบการสูงกว่าดัชนีชี้วัด (Active management)
- ป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยนไม่น้อยกว่าร้อยละ 90 ของมูลค่าเงินลงทุนในต่างประเทศ

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (% ต่อปี)



* ในปีที่กองทุนจัดตั้ง ผลการดำเนินงานจะแสดงตั้งแต่วันที่จัดตั้งจนถึงสิ้นปีปฏิทิน

ระดับความเสี่ยง



เสี่ยงสูง

ลงทุนในตราสารทุนเป็นหลักโดยเฉลี่ยในรอบปีไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน 14 กันยายน 2565

นโยบายการจ่ายเงินปันผล ไม่จ่าย

อายุกองทุน ไม่กำหนด

ผู้จัดการกองทุนรวม

นาย จาตุรันต์ สอนไว (14 กันยายน 2565)

นาย ชุติศักดิ์ อวยพรชัยสกุล (14 กันยายน 2565)

ดัชนีชี้วัด

ผลการดำเนินงานของกองทุนหลัก สัดส่วน 100.00% ปรับด้วยต้นทุนการป้องกันความเสี่ยงด้านอัตราแลกเปลี่ยน เพื่อเทียบกับค่าสกุลเงินบาท ณ วันที่คำนวณผลตอบแทน

คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวมมิได้เป็นที่ยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต
- กองทุนรวมนี้มิได้อยู่ภายใต้ข้อกำหนดว่าด้วยการเปิดเผยข้อมูลด้านความยั่งยืน การบริหารจัดการและการจัดทำรายงานของกองทุนรวมเช่นเดียวกับ SRI Fund

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต: ได้รับการรับรองจาก CAC

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



www.krungsriasset.com

ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือ
บริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่อง
ได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด (% ต่อปี)

	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี *
กองทุน	2.21	9.52	-0.31	-1.75
ดัชนีชี้วัด	5.39	11.22	2.33	3.27
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	8.62	10.46	4.60	11.28
ความผันผวนกองทุน	22.34	13.28	23.54	18.97
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	22.19	12.78	23.23	19.23
	3 ปี *	5 ปี *	10 ปี *	ตั้งแต่จัดตั้ง
กองทุน	N/A	N/A	N/A	3.85
ดัชนีชี้วัด	N/A	N/A	N/A	9.35
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	N/A	N/A	N/A	N/A
ความผันผวนกองทุน	N/A	N/A	N/A	16.99
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	N/A	N/A	N/A	17.50

* ผลตอบแทนที่มีอายุเกินหนึ่งปีจะแสดงเป็นผลตอบแทนต่อปี
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกันตามกลุ่ม Global Equity Fully FX Risk Hedge

การซื้อขายหน่วยลงทุน	การขายคืนหน่วยลงทุน
วันทำการซื้อ: ตามวันทำการกองทุน	วันทำการขายคืน: ตามวันทำการกองทุน
เวลาทำการ: 08:30 น. - 15:30 น.	เวลาทำการ: 08:30 น. - 15:30 น.
การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ: 500 บาท แต่ไม่เกิน 500,000 บาท	การขายคืนขั้นต่ำ: ไม่กำหนด ยอดคงเหลือขั้นต่ำ: ไม่กำหนด
การซื้อครั้งถัดไปขั้นต่ำ: 500 บาท แต่ไม่เกิน 500,000 บาท	ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน: ภายใน 6 วันทำการ นับถัดจากวันทำการขายคืน โดยทั่วไปจะได้ รับเงิน 4 วันทำการนับถัดจากวันทำการขายคืน (T+4)

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปี ของ NAV)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เกินจริง
การจัดการ	2.1400	1.3375
รวมค่าใช้จ่าย	4.6545	1.6278

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เกินจริง
การขาย	2.00	ยังไม่เรียกเก็บ
การรับซื้อคืน	2.00	ยังไม่เรียกเก็บ
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า	2.00	ยังไม่เรียกเก็บ
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก	2.00	ยังไม่เรียกเก็บ
การโอนหน่วย	ไม่มี	ไม่มี
ค่าปรับกรณีขายคืนและสับเปลี่ยนออกก่อนระยะเวลาที่กำหนด	ไม่มี	ไม่มี
ค่าใช้จ่ายในการซื้อขายหลักทรัพย์ เมื่อมีการสั่งซื้อ ขาย สับเปลี่ยนหน่วยลงทุน	0.50	ยังไม่เรียกเก็บ

- หมายเหตุ
- ค่าธรรมเนียมดังกล่าวเป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว
 - บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ

ข้อมูลเชิงสถิติ

Maximum Drawdown	-23.40 %
Recovering Period	0.00
FX Hedging	94.17 %
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน	0.02 เท่า
Sharpe Ratio	0.12
Alpha	-5.50 %
Beta	N/A

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน (% NAV)

AB SICAV I-Sustainable Global Thematic Portfolio	98.31
ทรัพย์สินอื่น	2.11
หนี้สินอื่น	-0.42

การจัดสรรการลงทุนในต่างประเทศ (% NAV)

United States	63.19
United Kingdom	5.82
Brazil	5.60
Canada	5.09
Japan	2.77
ข้อมูลกองทุนหลัก ณ 30 มิถุนายน 2568	

การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม/ทรัพย์สิน (% NAV)

Information Technology	35.34
Industrials	16.85
Financials	16.24
Health Care	12.87
Consumer Discretionary	5.94
ข้อมูลกองทุนหลัก ณ 30 มิถุนายน 2568	

ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก

Holding	% NAV
Microsoft Corp.	4.17
Flex Ltd.	3.48
NVIDIA Corp.	3.42
Visa, Inc.	2.56
Taiwan Semiconductor Manufacturing	2.56
ข้อมูลกองทุนหลัก ณ 30 มิถุนายน 2568	

การลงทุนในกองทุนอื่นเกินกว่า 20% (กองในประเทศและกองต่างประเทศ)

ชื่อกอง : AB Sustainable Global Thematic Portfolio, Class S1 USD	ISIN code : LU0462791079
	Bloomberg code : ALGTS1U:LX

- บริษัทจัดการจะปฏิบัติตามกฎเกณฑ์ของกองทุนหลัก โดยรายงานการถือครองหน่วยลงทุนตั้งแต่ร้อยละ 10 ของจำนวนหน่วยลงทุนที่จำหน่ายได้แล้วทั้งหมดของกองทุนให้กับผู้มีอำนาจหน้าที่ของกองทุนหลัก และอาจนำส่งข้อมูลส่วนตัวของผู้ถือหน่วยลงทุนดังกล่าวเช่น สำเนาบัตรประจำตัวประชาชนและ/หรือสำเนาหนังสือเดินทาง เป็นต้น และ/หรือขอข้อมูลหรือเอกสารเพิ่มเติมอื่นใดจากผู้ถือหน่วยลงทุนในภายหลังก็ได้ เพื่อให้เป็นไปตามที่กองทุนหลักร้องขอ หากผู้ถือหน่วยลงทุนรายใดปฏิเสธการให้ข้อมูลหรือเอกสารเพิ่มเติมดังกล่าวหรือมีพฤติกรรมเข้าข่ายและ/หรือมีความผิดตามกฎหมายอันมีผลทำให้บริษัทจัดการไม่สามารถปฏิบัติตามกฎเกณฑ์ของกองทุนหลักได้ บริษัทจัดการขอสงวนสิทธิที่จะระงับหรือหยุดให้บริการและดำเนินการคืนเงินลงทุนตามมูลค่าหน่วยลงทุนให้แก่ผู้ถือหน่วยลงทุน โดยถือว่าได้รับความเห็นชอบจากผู้ถือหน่วยลงทุนแล้ว ทั้งนี้ ผู้ถือหน่วยลงทุนจะไม่สามารถนำเรื่องดังกล่าวมาใช้เป็นสิทธิเรียกร้องความเสียหายจากเหตุดังกล่าวจากบริษัทจัดการได้แต่อย่างใด

คำอธิบาย

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

Recovering Period ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาดังแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่เงินลงทุนเริ่มคืนใช้ระยะเวลานานเท่าใด

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 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 โดยใช้ตัวอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมตราสารหนี้ 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