

## กองทุนเปิดกรุงศรีตราสารหนี้ระยะกลางปันผล

KFMTFI-D

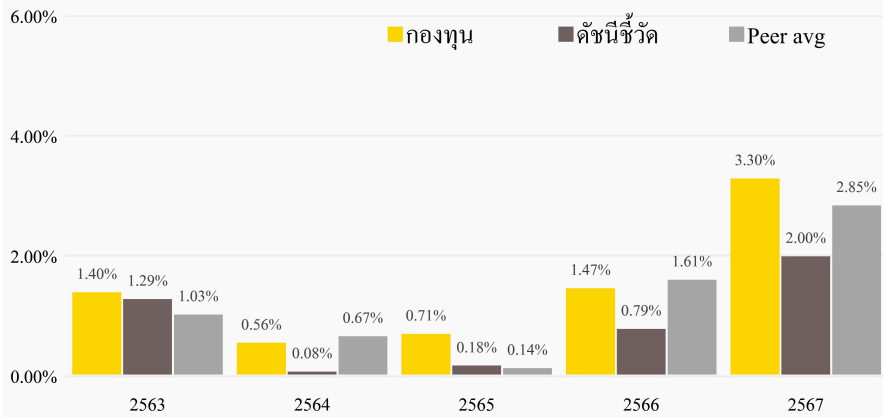
### ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมตราสารหนี้
- กองทุนรวมที่ลงทุนแบบมีความเสี่ยงทั้งในและต่างประเทศ
- กลุ่มกองทุนรวม : Mid Term General Bond

### นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- ลงทุนในประเทศในตราสารหนี้ภาครัฐโดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่า 50% ของ NAV
- ส่วนที่เหลือจะลงทุนในเงินฝากธนาคาร หรือตราสารหนี้ของธนาคารพาณิชย์ รัฐวิสาหกิจ หรือบริษัทเอกชนทั่วไปซึ่งมีอันดับความน่าเชื่อถือระยะปานกลางหรือระยะยาวในระดับตั้งแต่ A- หรือระยะสั้นในระดับ F2, T2 ขึ้นไป
- กองทุนอาจลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเพื่อเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน (Efficient Portfolio Management) โดยขึ้นอยู่กับดุลยพินิจของผู้จัดการกองทุน
- กองทุนมุ่งหวังให้ผลประกอบการสูงกว่าดัชนีชี้วัด (Active management)
- ป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยนไม่น้อยกว่าร้อยละ 90 ของมูลค่าเงินลงทุนในต่างประเทศ

### ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (% ต่อปี)



\* ในปีที่กองทุนจัดตั้ง ผลการดำเนินงานจะแสดงตั้งแต่วันที่จัดตั้งจนถึงสิ้นปีปฏิทิน

### ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด (% ต่อปี)

	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี *
กองทุน	1.14	1.14	2.16	3.67
ดัชนีชี้วัด	0.67	0.67	1.19	2.05
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	1.20	1.20	2.07	3.30
ความผันผวนกองทุน	0.78	0.78	0.69	0.63
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	0.21	0.21	0.19	0.21
	3 ปี *	5 ปี *	10 ปี *	ตั้งแต่จัดตั้ง
กองทุน	2.23	1.64	1.79	2.94
ดัชนีชี้วัด	1.27	0.89	2.23	3.57
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	1.99	1.41	1.68	N/A
ความผันผวนกองทุน	0.65	0.64	0.63	0.93
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	0.28	0.24	0.91	1.30

\* ผลตอบแทนที่มีอายุเกินหนึ่งปีจะแสดงเป็นผลตอบแทนต่อปี

ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกันตามกลุ่ม Mid Term General Bond

### ระดับความเสี่ยง



เสี่ยงปานกลางค่อนข้างต่ำ

ลงทุนในพันธบัตรรัฐบาล และตราสารหนี้เอกชน โดยมีตราสาร non-investment grade /unrated ไม่เกิน 20% ของ NAV

### ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน	26 มกราคม 2542
นโยบายการจ่ายเงินปันผล	จ่าย
อายุกองทุน	ไม่กำหนดอายุโครงการ

### ผู้จัดการกองทุนรวม

นาย ธีรภาพ จิรศักยกุล (30 ธันวาคม 2564)  
น.ส. พรทิพา หนึ่งน้ำใจ (1 ตุลาคม 2564)

### ดัชนีชี้วัด

1. อัตราดอกเบี้ยเงินฝากประจำ 1 ปี วงเงินน้อยกว่า 5 ล้านบาท เฉลี่ยของ 3 ธนาคารพาณิชย์ขนาดใหญ่ ได้แก่ ธนาคารกรุงเทพ ธนาคารกสิกรไทย และธนาคารไทยพาณิชย์ หลังหักภาษี สัดส่วน (%): 50.00 และ
  2. ผลตอบแทนรวมสุทธิของดัชนีพันธบัตรรัฐบาลอายุ 1 – 3 ปี ของสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย สัดส่วน (%): 50.00
- \* เริ่มใช้ดัชนีชี้วัดผลการดำเนินงานใหม่หลังหักภาษี (Net TRN Index) มีผลตั้งแต่วันที่ 31 ตุลาคม 2562
- วัตถุประสงค์การอ้างอิงดัชนีชี้วัด: บริษัทจัดการใช้ดัชนีชี้วัดดังกล่าวเพื่อเปรียบเทียบผลการดำเนินงานของกองทุนรวม

### คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวมมิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต: ได้รับการรับรองจาก CAC

จัดอันดับกองทุน Morningstar ★★★★★ (ข้อมูล ณ 28 ก.พ. 2568)

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือบริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่องได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

www.krungsriasset.com

**การซื้อขายหน่วยลงทุน**

วันทำการซื้อ: ทุกวันทำการของธนาคาร

เวลาทำการ: 08:30 น. - 15:30 น.

การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ: 500 บาท

การซื้อครั้งถัดไปขั้นต่ำ: 500 บาท

**การขายคืนหน่วยลงทุน**

วันทำการขายคืน: ทุกวันทำการของธนาคาร

เวลาทำการ: 08:30 น. - 15:30 น.

การขายคืนขั้นต่ำ: 500 บาท หรือ 50 หน่วย

ยอดคงเหลือขั้นต่ำ: 50 หน่วย

ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน: ภายใน 4 วันทำการ

นับถัดจากวันทำรายการขายคืน โดยทั่วไปจะได้

รับเงิน 2 วันทำการนับถัดจากวันทำรายการขายคืน

(T+2)

**ข้อมูลเชิงสถิติ**

Maximum Drawdown	-1.33 %
Recovering Period	6 เดือน 11 วัน
FX Hedging	ยังไม่มีการลงทุนในต่างประเทศ
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน	0.76 เท่า
อายุเฉลี่ยของตราสารหนี้	2 ปี 3 เดือน 19 วัน
Yield to Maturity	2.24

\* Yield to Maturity (YTM) อัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในตราสารหนี้คำนวณจากดอกเบี้ยที่ได้รับจริง โดยมีได้ปรับสัดส่วนเครื่องมือป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยนซึ่งอาจทำให้ผลตอบแทนจริงลดลงหรือเพิ่มขึ้น จาก YTM ในรูปสกุลเงินบาทได้

**ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปี ของ NAV)**

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	0.7490	0.3210
รวมค่าใช้จ่าย	1.0379	0.4710

**ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)**

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

**หมายเหตุ**

- ค่าธรรมเนียมดังกล่าวเป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว
- บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ
- บริษัทจัดการอาจยกเว้นไม่เรียกเก็บค่าธรรมเนียมการโอนหน่วยลงทุน โดยขึ้นอยู่กับดุลยพินิจของบริษัทจัดการ

**ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก**

Holding	% NAV
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยวคที่ 12/364/67	10.47
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยวคที่ 10/364/67	9.58
หุ้นกู้ของทรัสต์เพื่อการลงทุนในสิทธิการเช่าอสังหาริมทรัพย์โกลเด้นเวนเจอร์ (GVREIT) ครั้งที่ 1/2561	6.43
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยรุ่นที่ 2/2Y/66	5.09
พันธบัตรรัฐบาลเพื่อความยั่งยืนสำหรับปรับโครงสร้างหนี้ (พ.ร.ก.กู้เงิน โควิด-19) ในปีงบประมาณ พ.ศ. 2565 ครั้งที่ 5	4.20

**สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน (% NAV)**

ตราสารหนี้ที่ออกโดยบริษัทหรือภาคเอกชน	47.18
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย	36.79
ตราสารภาครัฐหรือองค์กรระหว่างประเทศ	13.01
เงินฝาก หรือตราสารหนี้ที่สถาบันการเงินเป็นผู้ออก	2.29
ทรัพย์สินอื่น	0.82
หนี้สินอื่น	-0.09

**การจัดสรรการลงทุนใน****ผู้ออกตราสาร 5 อันดับแรก (% NAV)**

ธนาคารแห่งประเทศไทย	36.79
กระทรวงการคลัง	13.01
ทรัสต์สิทธิการเช่าอสังหาริมทรัพย์โกลเด้นเวนเจอร์	6.43
บมจ.บริหารสินทรัพย์ กรุงเทพพาณิชย์	3.98
บมจ.บ้านปู	3.67

**การจัดสรรการลงทุนตามอันดับความน่าเชื่อถือ (%)**

	ในประเทศ	National	International
AAA	55.76		
AA	6.92		
A	36.58		

## คำอธิบาย

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

**Recovering Period** ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาตั้งแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้เวลานานเท่าใด

**FX Hedging** เปรอ์เซ็นต์ของกรลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

**อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน** ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลานึง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์กับผลรวมของมูลค่าการขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 1 ปีหารด้วยมูลค่า NAV ของกองทุนรวมเฉลี่ยในรอบระยะเวลาเดียวกัน กองทุนรวมที่มีค่า portfolio turnover สูงบ่งชี้ถึงการซื้อขายหลักทรัพย์บ่อยครั้งของผู้จัดการกองทุนและทำให้มีต้นทุนการซื้อขายหลักทรัพย์ที่สูง 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 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 โชนเอ ชั้น 12 ชั้น 18 โชนบี

ถนนเพลินจิต แขวงลุมพินี เขตปทุมวัน กรุงเทพฯ 10330

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

เว็บไซต์: www.krungsriasset.com