

## กองทุนเปิดกรุงศรีหุ้นธรรมชาติไทย



KFTHAICG

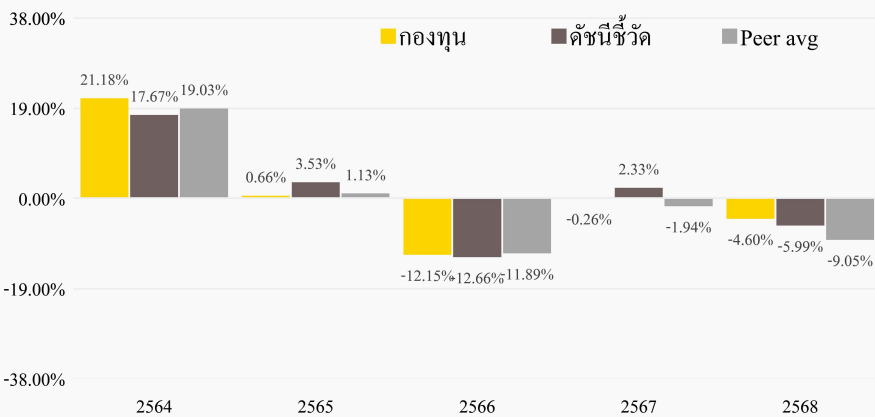
### ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมตราสารทุน
- กองทุนรวมที่เน้นลงทุนแบบไม่มีความเสี่ยงในต่างประเทศ
- กลุ่มกองทุนรวม : Equity General

### นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- ลงทุนในตราสารทุนของบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย และหรือ ตลาดหลักทรัพย์ เอ็ม เอ ไอ โดยเน้นลงทุนในบริษัทที่มีการกำกับดูแลกิจการที่ดี รวมถึงบริษัทที่ได้รับการรับรองเป็นสมาชิกแนวร่วมปฏิบัติของภาคเอกชนไทยในการต่อต้านการทุจริตคอร์รัปชัน (CAC) ซึ่งการพิจารณาการกำกับดูแลกิจการที่ดีอาจพิจารณาจากการจัดอันดับ CG Scoring ของสมาคมส่งเสริมสถาบันกรรมการบริษัทไทย หรือหน่วยงานอื่นใดที่เกี่ยวข้องโดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของ NAV
- กองทุนอาจจะเข้าทำสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) เพื่อเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน (Efficient Portfolio Management) ซึ่งรวมถึงการป้องกันความเสี่ยง (Hedging) จากการลงทุน
- กองทุนมุ่งหวังให้ผลประกอบการสูงกว่าดัชนีชี้วัด (Active management)

### ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (% ต่อปี)



\* ในปีที่กองทุนจัดตั้ง ผลการดำเนินงานจะแสดงตั้งแต่วันที่จัดตั้งจนถึงสิ้นปีปฏิทิน

### ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด (% ต่อปี)

|                          | YTD    | 3 เดือน | 6 เดือน | 1 ปี *         |
|--------------------------|--------|---------|---------|----------------|
| กองทุน                   | 33.06  | 10.82   | 13.32   | 36.17          |
| ดัชนีชี้วัด              | 31.42  | 2.34    | 7.60    | 34.82          |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน | 29.66  | 7.80    | 9.59    | 31.43          |
| ความผันผวนกองทุน         | 14.97  | 13.08   | 15.64   | 13.51          |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด    | 18.61  | 13.84   | 18.92   | 16.98          |
|                          | 3 ปี * | 5 ปี *  | 10 ปี * | ตั้งแต่จัดตั้ง |
| กองทุน                   | 5.72   | 2.61    | N/A     | 1.65           |
| ดัชนีชี้วัด              | 4.76   | 3.06    | N/A     | 3.27           |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน | 1.44   | 0.70    | N/A     | N/A            |
| ความผันผวนกองทุน         | 14.30  | 13.16   | N/A     | 14.89          |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด    | 15.54  | 13.90   | N/A     | 15.80          |

\* ผลตอบแทนที่มีอายุเกินหนึ่งปีจะแสดงผลตอบแทนต่อปี  
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกันตามกลุ่ม Equity General

### ระดับความเสี่ยง



ลงทุนในตราสารทุนเป็นหลักโดยเฉลี่ยในรอบปี  
ไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV

### ข้อมูลกองทุนรวม

|                        |                     |
|------------------------|---------------------|
| วันจดทะเบียนกองทุน     | 31 สิงหาคม 2560     |
| นโยบายการจ่ายเงินปันผล | ไม่จ่าย             |
| อายุกองทุน             | ไม่กำหนดอายุโครงการ |

### ผู้จัดการกองทุนรวม

นาย ทลิต โชคทิพย์พัฒนา (1 ตุลาคม 2564)

นาย ปิติ ประดิษฐ์พงษ์ (30 ตุลาคม 2563)

### ดัชนีชี้วัด

ดัชนีผลตอบแทนรวมตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET TRI)  
วัตถุประสงค์การอ้างอิงดัชนีชี้วัด: บริษัทจัดการใช้ดัชนีชี้วัดดังกล่าวเพื่อเปรียบเทียบผลการดำเนินงานของกองทุนรวม

### คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวมมิได้เป็น  
สิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต: ได้รับการรับรองจาก CAC

จัดอันดับกองทุน Morningstar ★★★★★ (ข้อมูล ณ 31 ก.ค. 2569)

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือ  
บริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่อง  
ได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

www.krungsriasset.com

| การซื้อขายหน่วยลงทุน               | การขายคืนหน่วยลงทุน                                                                                                                  |
|------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| วันทำการซื้อ: ทุกวันทำการของธนาคาร | วันทำการขายคืน: ทุกวันทำการของธนาคาร                                                                                                 |
| เวลาทำการ: 08:30 น. - 15:30 น.     | เวลาทำการ: 08:30 น. - 15:30 น.                                                                                                       |
| การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ: 500 บาท    | การขายคืนขั้นต่ำ: 500 บาท หรือ 50 หน่วย                                                                                              |
| การซื้อครั้งถัดไปขั้นต่ำ: 500 บาท  | ยอดคงเหลือขั้นต่ำ: 50 หน่วย                                                                                                          |
|                                    | ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน: ภายใน 5 วันทำการ นับถัดจากวันทำการขายคืน โดยทั่วไปจะได้ รับเงิน 3 วันทำการนับถัดจากวันทำการขายคืน (T+3) |

| ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปี ของ NAV)                                                                                  |               |          |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------|----------|
| ค่าธรรมเนียมต่อไปนี้จะส่งผลกระทบต่อผู้ลงทุน เนื่องจากจะทำให้ผลตอบแทนจากการลงทุนลดลง ดังนั้น ผู้ลงทุนควรตรวจสอบทุกครั้งก่อนตัดสินใจลงทุน |               |          |
| ค่าธรรมเนียม                                                                                                                            | สูงสุดไม่เกิน | เก็บจริง |
| การจัดการ                                                                                                                               | 2.6750        | 2.1400   |
| ค่าตอบแทนแก่ผู้สนับสนุนการขายหรือรับซื้อคืน หน่วยลงทุนของกองทุนรวม (trailer fee): มี                                                    |               |          |
| รวมค่าใช้จ่าย                                                                                                                           | 5.0825        | 2.4243   |

| หมายเหตุ                                                                                                                                                           |                       |                       |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------|-----------------------|
| ค่าตอบแทนแก่ผู้สนับสนุนการขายหรือรับซื้อคืนหน่วยลงทุน (trailer fee) เป็นส่วนหนึ่งของค่าธรรมเนียมการจัดการ                                                          |                       |                       |
| ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย) ผู้ลงทุนจะถูกเรียกเก็บค่าธรรมเนียมต่อไปนี้อย่างตรงทุกครั้งที่เมื่อทำการซื้อขายหรือสับเปลี่ยนหน่วยลงทุน |                       |                       |
| ค่าธรรมเนียม                                                                                                                                                       | สูงสุดไม่เกิน         | เก็บจริง              |
| การขาย                                                                                                                                                             | ไม่เกิน 1.50          | 1.00                  |
| การรับซื้อคืน                                                                                                                                                      | ไม่เกิน 1.50          | ไม่เรียกเก็บ          |
| การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า                                                                                                                                        | ไม่เกิน 1.50          | 1.00                  |
| การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก                                                                                                                                         | ไม่เกิน 1.50          | ไม่เรียกเก็บ          |
| การโอนหน่วย                                                                                                                                                        | 10 บาทต่อ 1,000 หน่วย | 10 บาทต่อ 1,000 หน่วย |

- หมายเหตุ
- ค่าธรรมเนียมดังกล่าวเป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว
  - ค่าธรรมเนียมการจัดการที่เรียกเก็บ บริษัทจัดการจะนำไปบริจาคในอัตราร้อยละ 40 ของค่าธรรมเนียมการจัดการที่เรียกเก็บจากกองทุน ให้กับหน่วยงานที่ส่งเสริมกรมการภิบาลไทย และหรือหน่วยงานที่ส่งเสริมการต่อต้านคอร์รัปชัน และหรือองค์กรอื่นใดที่เกี่ยวข้องกับหน่วยงานดังกล่าว
  - บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ
  - บริษัทจัดการอาจยกเว้นไม่เรียกเก็บค่าธรรมเนียมการ โอนหน่วยลงทุน โดยขึ้นอยู่กับดุลยพินิจของบริษัทจัดการ

| ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก |       |
|-------------------------------|-------|
| Holding                       | % NAV |
| บมจ.ซีพี ออลล์                | 8.84  |
| บมจ.กัลฟ์ ดีเวลลอปเม้นท์      | 7.88  |
| บมจ.ทุนธนาชาติ                | 7.49  |
| บมจ.ปตท.                      | 6.07  |
| บมจ.ศรีตรังแอโกรอินดัสทรี     | 5.84  |

| ข้อมูลเชิงสถิติ            |                              |
|----------------------------|------------------------------|
| Maximum Drawdown           | -29.44 %                     |
| Recovering Period          | 1 ปี 9 วัน                   |
| FX Hedging                 | ยังไม่มีการลงทุนในต่างประเทศ |
| อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน | 1.49 เท่า                    |
| Sharpe Ratio               | 0.28                         |
| Alpha                      | 0.96 %                       |
| Beta                       | 0.80                         |
| Tracking Error             | N/A                          |

| สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน (% NAV)            |       |
|---------------------------------------------------|-------|
| ตราสารทุนและหน่วยลงทุน                            | 97.37 |
| ทรัพย์สินอื่น                                     | 2.78  |
| เงินฝาก หรือตราสารหนี้ที่สถาบันการเงิน เป็นผู้ออก | 0.50  |
| หนี้สินอื่น                                       | -0.65 |

| การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม (% NAV) |       |
|--------------------------------------------|-------|
| หมวดพลังงานและสาธารณูปโภค                  | 24.18 |
| หมวดธนาคาร                                 | 19.74 |
| หมวดพัฒนาอสังหาริมทรัพย์                   | 11.12 |
| หมวดพาณิชย์                                | 9.50  |
| หมวดการแพทย์                               | 9.24  |

คำอธิบาย

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

**Recovering Period** ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาตั้งแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลานานเท่าใด

**FX Hedging** เปรี่เซ้นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

**อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน** ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตกองทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลานึง 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 โซนเอ ชั้น 12 ชั้น 18 โซนบี  
ถนนเพลินจิต แขวงลุมพินี เขตปทุมวัน กรุงเทพฯ 10330  
โทรศัพท์ 0-2657-5757 โทรสาร 0-2657-5777  
เว็บไซต์: www.krungsriasset.com