# กองทุนเปิดกรุงศรีโทเทิลรีเทิร์นบอนด์-สะสมมูลค่า

หน่วยลงทุนชนิดสะสมมูลค่า
KFTRB-A

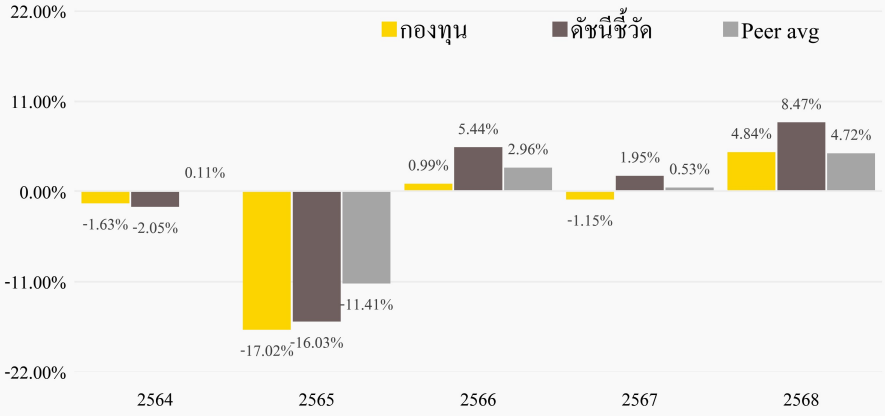
## ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมตราสารหนี้/ กองทุนรวมฟีดเดอร์ (Feeder Fund)
- กองทุนรวมที่เน้นลงทุนแบบมีความเสี่ยงต่างประเทศ
- กลุ่มกองทุนรวม : Global Bond Fully F/X Hedge

## นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- ลงทุนในกองทุนรวมต่างประเทศชื่อ PIMCO Total Return Bond Fund (กองทุนหลัก) โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่ต่ำกว่าร้อยละ 80 ของ NAV
- กองทุนหลักมีนโยบายเน้นลงทุนในตราสารหนี้ทั่วโลกไม่น้อยกว่า 2 ใน 3 ของ NAV
- บริษัทที่บริหารจัดการกองทุนหลัก คือ PIMCO Funds: Global Investors Series plc
- กองทุนไทยมุ่งหวังให้ผลประกอบการเคลื่อนไหวตามกองทุนหลัก ส่วนกองทุนหลักมุ่งหวังให้ผลประกอบการสูงกว่าดัชนีชี้วัด (Active management)

## ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (% ต่อปี)




* ในปีที่กองทุนจัดตั้ง ผลการดำเนินงานจะแสดงตั้งแต่วันที่จัดตั้งจนถึงสิ้นปีปฏิทิน

## ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด (% ต่อปี)

| | YTD | 3 เดือน | 6 เดือน | 1 ปี * |
|---|---|---|---|---|
| กองทุน | -4.22 | -1.12 | -2.67 | -4.36 |
| ดัชนีชี้วัด | -1.55 | -0.35 | -1.04 | -0.98 |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน | -2.30 | -0.98 | -1.64 | -2.18 |
| ความผันผวนกองทุน | 5.12 | 5.95 | 5.42 | 4.84 |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด | 5.09 | 5.84 | 5.39 | 4.82 |

| | 3 ปี * | 5 ปี * | 10 ปี * | ตั้งแต่จัดตั้ง |
|---|---|---|---|---|
| กองทุน | 2.20 | -3.62 | -0.91 | 0.72 |
| ดัชนีชี้วัด | 5.81 | -0.74 | 0.99 | 1.34 |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน | 2.74 | -1.29 | 0.28 | N/A |
| ความผันผวนกองทุน | 5.35 | 6.00 | 4.98 | 4.39 |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด | 5.30 | 6.04 | 5.04 | 4.43 |

* ผลตอบแทนที่มีอายุเกินหนึ่งปีจะแสดงเป็นผลตอบแทนต่อปี
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกันตามกลุ่ม Global Bond Fully F/X Hedge

## ระดับความเสี่ยง

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

เสี่ยงปานกลางค่อนข้างต่ำ

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

## ข้อมูลกองทุนรวม

| | |
|---|---|
| วันจดทะเบียนกองทุน | 14 ตุลาคม 2553 |
| วันเริ่มต้น class | 14 ตุลาคม 2553 |
| นโยบายการจ่ายเงินปันผล | ไม่จ่าย |
| อายุกองทุน | ไม่กำหนดอายุโครงการ |
| การป้องกันความเสี่ยง FX | ป้องกันทั้งหมด |

## ผู้จัดการกองทุนรวม

นาย จาตุรันต์ สอนไว (13 กันยายน 2554)
นาย พงศ์สัณห์ อนุรัตน์ (17 กรกฎาคม 2560)

## ดัชนีชี้วัด

ผลการดำเนินงานของกองทุนหลัก สัดส่วน 100.00% ปรับด้วยต้นทุนการป้องกันความเสี่ยงด้านอัตราแลกเปลี่ยน เพื่อเทียบกับค่าสกุลเงินบาท ณ วันที่คำนวณผลตอบแทน

## คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวมมิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต: ได้รับการรับรองจาก CAC

จัดอันดับกองทุน Morningstar ★★ (ข้อมูล ณ 30 ก.ย. 2569)

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. - 15:30 น.**

**การขายคืนขั้นต่ำ: 500 บาท หรือ 50 หน่วย**

**ยอดคงเหลือขั้นต่ำ: 50 หน่วย**

**ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน: ภายใน 7 วันทำการนับถัดจากวันทำรายการขายคืน โดยทั่วไปจะได้รับเงิน 3 วันทำการนับถัดจากวันทำรายการขายคืน (T+3)**

## ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปี ของ NAV)

ค่าธรรมเนียมต่อไปนี้จะส่งผลกระทบต่อผู้ลงทุน เนื่องจากจะทำให้ผลตอบแทนจากการลงทุนลดลง ดังนั้น ผู้ลงทุนควรตรวจสอบทุกครั้งก่อนตัดสินใจลงทุน

| ค่าธรรมเนียม | สูงสุดไม่เกิน | เก็บจริง |
|---|---|---|
| **การจัดการ** | **1.0700** | **0.6688** |
| **ค่าตอบแทนแก่ผู้สนับสนุนการขายหรือรับซื้อคืนหน่วยลงทุนของกองทุนรวม (trailer fee): มี** | | |
| **รวมค่าใช้จ่าย** | **1.6050** | **0.8691** |

**หมายเหตุ**

(1) กองทุนหลักคืนค่าธรรมเนียมการจัดการให้แก่กองทุนไทยในอัตราประมาณ 50% ของค่าธรรมเนียมการจัดการของกองทุนหลักต่อปี

(2) ค่าตอบแทนแก่ผู้สนับสนุนการขายหรือรับซื้อคืนหน่วยลงทุน (trailer fee) เป็นส่วนหนึ่งของค่าธรรมเนียมการจัดการ

## ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)

ผู้ลงทุนจะถูกเรียกเก็บค่าธรรมเนียมต่อไปนี้โดยตรงทุกครั้งเมื่อทำรายการซื้อขายหรือสับเปลี่ยนหน่วยลงทุน

| ค่าธรรมเนียม | สูงสุดไม่เกิน | เก็บจริง |
|---|---|---|
| **การขาย** | 1.50 | . |
| น้อยกว่า 100 ล้านบาท | | เก็บจริง 0.75 |
| ตั้งแต่ 100 ล้านบาท | | เก็บจริง 0.50 |
| ตั้งแต่ 300 ล้านบาท | | เก็บจริง 0.25 |
| **การรับซื้อคืน** | ไม่มี | ไม่มี |
| **การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า** | 1.50 | เท่าค่าธรรมเนียมการขาย |
| **การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก** | ไม่มี | ไม่มี |
| **การโอนหน่วย** | 10 บาทต่อ 1,000 หน่วย | 10 บาทต่อ 1,000 หน่วย |

**หมายเหตุ**

- ค่าธรรมเนียมดังกล่าวเป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว
- บริษัทจัดการขอสงวนสิทธิในการยกเว้นโดยไม่เรียกเก็บค่าธรรมเนียมการสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนระหว่างชนิดหน่วยลงทุนภายใต้กองทุนนี้
- บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ
- บริษัทจัดการอาจยกเว้นไม่เรียกเก็บค่าธรรมเนียมการโอนหน่วยลงทุน โดยขึ้นอยู่กับดุลยพินิจของบริษัทจัดการ

## ข้อมูลเชิงสถิติ

| | |
|---|---|
| **Maximum Drawdown** | **-23.13 %** |
| **Recovering Period** | **0.00** |
| **FX Hedging** | **99.47 %** |
| **อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน** | **0.10 เท่า** |
| **อายุเฉลี่ยของตราสารหนี้** | **7 ปี 3 เดือน 10 วัน** |
| **Yield to Maturity** | **7.40** |

## สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน (% NAV)

| | |
|---|---|
| PIMCO Total Return Bond Fund | 98.23 |
| ทรัพย์สินอื่น | 1.88 |
| เงินฝาก หรือตราสารหนี้ที่สถาบันการเงินเป็นผู้ออก | 1.40 |
| หนี้สินอื่น | -1.51 |

## การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม/ทรัพย์สิน (% NAV)

| | |
|---|---|
| Banks | 7.40 |
| Electric Utility | 3.40 |
| Financial Other | 3.20 |
| Technology | 2.20 |
| Brokerage | 1.20 |

ข้อมูลกองทุนหลัก ณ 30 กันยายน 2569

## ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก

| Holding | % NAV |
|---|---|
| FNMA TBA 5.0% AUG 30YR | 7.70 |
| FNMA TBA 4.5% AUG 30YR | 2.80 |
| FNMA TBA 3.0% AUG 30YR | 2.70 |
| FNMA TBA 5.5% AUG 30YR | 2.20 |
| FNMA TBA 6.0% AUG 30YR | 1.90 |

ข้อมูลกองทุนหลัก ณ 30 มิถุนายน 2569

## การลงทุนในกองทุนอื่นเกินกว่า 20% (กองในประเทศและกองต่างประเทศ)

**ชื่อกอง : PIMCO Total Return Bond Fund (Class E Acc)**

**ISIN code : IE00B11XZ988**

**Bloomberg code : PTRBDFE ID**

### 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