

กองทุนเปิดกรุงศรีแอสทีฟตราสารหนี้เพื่อการเลี้ยงชีพ

KFAFIXRMF

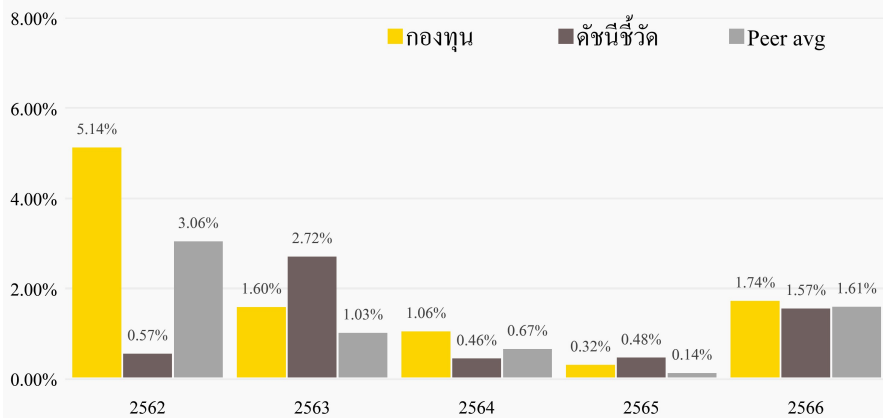
ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมตราสารหนี้/ กองทุนรวมเพื่อการเลี้ยงชีพ/ กองทุนรวมที่มิใช่ นโยบายเปิดให้มีการลงทุนในกองทุนรวมอื่นภายใต้บลจ.เดียวกัน
- กองทุนรวมที่ลงทุนแบบมีความเสี่ยงทั้งในและต่างประเทศ
- กลุ่มกองทุนรวม : Mid Term General Bond

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- เน้นลงทุนในประเทศและ/หรือต่างประเทศ ในตราสารหนี้และ/หรือ เงินฝากหรือตราสารเทียบเท่าเงินฝาก ที่ออก รับรอง รับอวัล หรือค้ำประกันการจ่ายเงิน โดยภาครัฐบาล รัฐวิสาหกิจ สถาบันการเงิน และ/หรือภาคเอกชน
- กองทุนอาจจะลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมภายใต้การจัดการของบริษัทจัดการ ในสัดส่วนไม่เกินร้อยละ 100 ของ NAV
- กองทุนอาจจะเข้าทำสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) เพื่อเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน (Efficient Portfolio Management) ซึ่งรวมถึงการป้องกันความเสี่ยง (Hedging) จากการลงทุน
- กองทุนมุ่งหวังให้ผลประกอบการสูงกว่าดัชนีชี้วัด (Active management)
- ป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยนไม่น้อยกว่าร้อยละ 90 ของมูลค่าเงินลงทุนในต่างประเทศ

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (% ต่อปี)



* ในปีที่กองทุนจัดตั้ง ผลการดำเนินงานจะแสดงตั้งแต่วันที่จัดตั้งจนถึงสิ้นปีปฏิทิน

ระดับความเสี่ยง



เสี่ยงปานกลางค่อนข้างต่ำ

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

ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน	23 พฤศจิกายน 2561
นโยบายการจ่ายเงินปันผล	ไม่จ่าย
อายุกองทุน	ไม่กำหนดอายุโครงการ

ผู้จัดการกองทุนรวม

นาย ชีรภาพ จิรศักดิ์กุล (30 ธันวาคม 2564)
น.ส. พรทิพา หนึ่งน้ำใจ (1 ตุลาคม 2564)

ดัชนีชี้วัด

- ดัชนีชี้วัดของกองทุนรวมประกอบด้วย
- (1) ดัชนีพันธบัตรรัฐบาลอายุน้อยกว่า 10 ปี ของสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย สัดส่วน 50% และ
 - (2) ดัชนีตราสารหนี้ภาคเอกชน Mark-to-Market ที่มีอันดับความน่าเชื่อถือของผู้ออกตราสารอยู่ในระดับ BBB+ ขึ้นไป อายุ 1 - 3 ปี สัดส่วน 30% และ
 - (3) อัตราดอกเบี้ยเงินฝากประจำ 1 ปี เฉลี่ยประเภทบุคคลธรรมดาวงเงิน 1 ล้านบาท ของธนาคารกรุงเทพ, ธนาคารกสิกรไทย, และธนาคารไทยพาณิชย์ สัดส่วน 10% และ
 - (4) ดัชนีอัตราดอกเบี้ยอ้างอิง THOR หลังหักภาษี สัดส่วน 10%

วัตถุประสงค์การอ้างอิงดัชนีชี้วัด: บริษัทจัดการใช้ดัชนีชี้วัดดังกล่าวเพื่อเปรียบเทียบผลการดำเนินงานของกองทุนรวม

คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวมมิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต: ได้รับการรับรองจาก CAC

จัดอันดับกองทุน Morningstar ★★★★★ (ข้อมูล ณ 30 เม.ย. 2567)

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือบริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่องได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

www.krungsriasset.com

ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปีกลม (% ต่อปี)

	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี *
กองทุน	0.81	0.22	1.28	2.22
ดัชนีชี้วัด	1.07	0.15	1.70	2.15
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	0.95	0.35	1.45	2.17
ความผันผวนกองทุน	0.60	0.73	0.61	0.55
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	0.73	0.76	0.74	0.77
	3 ปี *	5 ปี *	10 ปี *	ตั้งแต่จัดตั้ง
กองทุน	1.17	1.82	N/A	2.02
ดัชนีชี้วัด	1.25	1.93	N/A	2.09
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	1.04	1.33	N/A	N/A
ความผันผวนกองทุน	0.70	1.08	N/A	1.06
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	1.06	1.10	N/A	1.06

* ผลตอบแทนที่มีอายุเกินหนึ่งปีจะแสดงเป็นผลตอบแทนต่อปี

ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกันตามกลุ่ม Mid Term General Bond

การซื้อขายหน่วยลงทุน

วันทำการซื้อ: ทุกวันทำการของธนาคาร

เวลาทำการ: 08:30 น. - 15:30 น.

การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ: 500 บาท สูงสุดไม่เกิน 500,000 บาท

การซื้อครั้งถัดไปขั้นต่ำ: 500 บาท สูงสุดไม่เกิน 500,000 บาท

การขายคืนหน่วยลงทุน

วันทำการขายคืน: ทุกวันทำการของธนาคาร

เวลาทำการ: 08:30 น. - 15:30 น.

การขายคืนขั้นต่ำ: ไม่มี

ยอดคงเหลือขั้นต่ำ: ไม่มี

ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน: ภายใน 5 วันทำการ นับถัดจากวันทำรายการขายคืน โดยทั่วไปจะได้รับการรับเงิน 2 วันทำการนับถัดจากวันทำรายการขายคืน (T+2)

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปี ของ NAV)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	1.6050	0.3210
รวมค่าใช้จ่าย	2.9425	0.4177

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การขาย	1.00	ไม่เรียกเก็บ
การรับซื้อคืน	1.00	ไม่เรียกเก็บ
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า	1.00	ไม่เรียกเก็บ
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก	1.00	ไม่เรียกเก็บ
การโอนหน่วย	10 บาทต่อ 1,000 หน่วย	ไม่เรียกเก็บ

หมายเหตุ

- ค่าธรรมเนียมดังกล่าวเป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว
- หากกองทุนลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมภายใต้การจัดการเดียวกัน บริษัทจัดการจะไม่เรียกเก็บค่าธรรมเนียมการจัดการ ค่าธรรมเนียมการขายและ/หรือรับซื้อคืนหน่วยลงทุนซ้ำซ้อน

ข้อมูลเชิงสถิติ

Maximum Drawdown	-2.44 %
Recovering Period	1 ปี 7 วัน
FX Hedging	ยังไม่มีการลงทุนในต่างประเทศ
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน	127.44 %
อายุเฉลี่ยของตราสารหนี้	2 ปี 6 เดือน 25 วัน
Yield to Maturity	2.85

* Yield to Maturity (YTM) อัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในตราสารหนี้ที่คำนวณจากดอกเบี้ยที่ได้รับจริง โดยมีได้ปรับสัดส่วนเครื่องมือป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยนซึ่งอาจทำให้ผลตอบแทนจริงลดลงหรือเพิ่มขึ้น จาก YTM ในรูปสกุลเงินบาทได้

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน (% NAV)

ตราสารหนี้ที่ออกโดยบริษัทหรือภาคเอกชน	52.41
ตราสารภาครัฐหรือองค์กรระหว่างประเทศ	21.49
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย	20.47
เงินฝาก หรือตราสารหนี้ที่สถาบันการเงินเป็นผู้ออก	5.64
ทรัพย์สินอื่น	0.05
หนี้สินอื่น	-0.05

การจัดสรรการลงทุนใน

ผู้ออกตราสาร 5 อันดับแรก (% NAV)

กระทรวงการคลัง	21.49
ธนาคารแห่งประเทศไทย	20.47
บจก. โด โยต้า ลีสซิ่ง (ประเทศไทย)	8.12
บมจ.เมืองไทย แคปปิตอล	5.82
บมจ.เงินติดล้อ	4.44

การจัดสรรการลงทุนตามอันดับความน่าเชื่อถือ (%)

	ในประเทศ	National	International
AAA	56.45		
AA	5.56		
A	32.17		
BBB	5.82		

ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก

Holding	% NAV
หุ้นกู้มีประกันของ บริษัท โตโยต้า ลีสซิ่ง (ประเทศไทย) จำกัด ครั้งที่ 3/2567 ชุดที่ 2 อายุ 3 ปี 1 เดือน	7.87
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยวคที่ 21/91/67	5.82
พันธบัตรรัฐบาลเพื่อความยั่งยืนสำหรับปรับโครงสร้างหนี้ (พ.ร.ก. กู้เงิน โควิด-19) ในปีงบประมาณ พ.ศ. 2565 ครั้งที่ 5	5.56
พันธบัตรรัฐบาลเพื่อการบริหารหนี้ ในปีงบประมาณ พ.ศ. 2566 ครั้งที่ 25	5.19
หุ้นกู้ของบริษัท เมืองไทย แคปปิตอล จำกัด (มหาชน) ครั้งที่ 2/2567 ชุดที่ 2	3.94

คำอธิบาย

Maximum Drawdown เปรอ์เซ็นต์ผลขาดทุนสูงสุดของกองทุนรวมในระยะเวลา 5 ปีย้อนหลัง (หรือตั้งแต่จัดตั้งกองทุนกรณีที่ยังไม่ครบ 5 ปี) โดยวัดจากระดับ NAV ต่อหน่วยที่จุดสูงสุด ไปจนถึงจุดต่ำสุดในช่วงที่ NAV ต่อหน่วยปรับตัวลดลง ค่า Maximum Drawdown เป็นข้อมูลที่ช่วยให้ทราบถึงความเสี่ยงที่อาจจะขาดทุนจากการลงทุนในกองทุนรวม

Recovering Period ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาดังแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่เงินลงทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลานานเท่าใด

FX Hedging เปรอ์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตกองทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลานึง 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 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