

## กองทุนเปิดกรุงศรีหุ้นไดนามิก

KFDYNAMIC

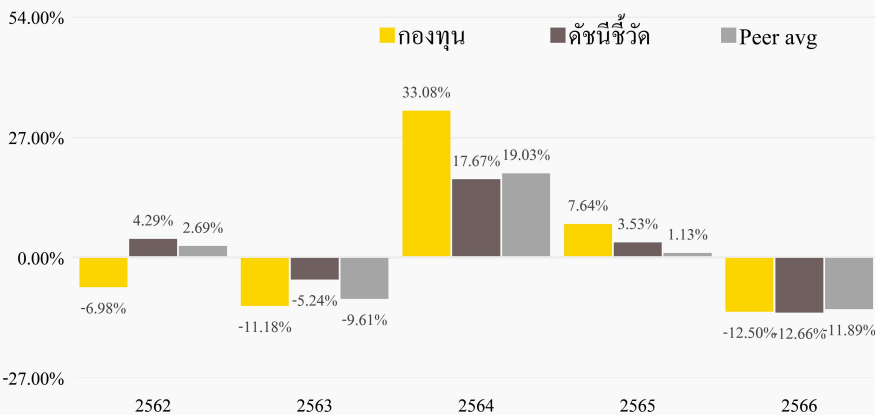
### ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมตราสารทุน
- กองทุนรวมที่เน้นลงทุนแบบไม่มีความเสี่ยงในต่างประเทศ
- กลุ่มกองทุนรวม : Equity General

### นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- ลงทุนในตราสารทุนในประเทศโดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV โดยเน้นลงทุนในหุ้นที่มีปัจจัยพื้นฐานดี มีแนวโน้มการเติบโตสูง
- ส่วนที่เหลือจะลงทุนในตราสารหนี้ภาครัฐ สถาบันการเงิน บริษัทเอกชน หรือเงินฝากธนาคาร
- กองทุนอาจจะเข้าทำสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) เพื่อเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน (Efficient Portfolio Management) ซึ่งรวมถึงการป้องกันความเสี่ยง (Hedging) จากการลงทุน
- กองทุนมุ่งหวังให้ผลประกอบการสูงกว่าดัชนีชี้วัด (Active management)

### ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (% ต่อปี)



\* ในปีที่กองทุนจัดตั้ง ผลการดำเนินงานจะแสดงตั้งแต่วันที่จัดตั้งจนถึงสิ้นปีปฏิทิน

### ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปีกลม (% ต่อปี)

	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี *
กองทุน	3.59	2.15	-2.09	5.46
ดัชนีชี้วัด	4.25	5.52	7.31	7.02
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	-0.15	3.62	3.21	2.63
ความผันผวนกองทุน	13.07	14.26	14.21	12.91
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	11.10	11.83	11.61	10.97
	3 ปี *	5 ปี *	10 ปี *	ตั้งแต่จัดตั้ง
กองทุน	0.63	2.97	3.28	6.44
ดัชนีชี้วัด	-0.13	0.90	2.02	7.42
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	-2.05	-0.98	0.40	N/A
ความผันผวนกองทุน	12.44	17.26	15.81	19.57
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	11.31	16.86	14.50	18.64

\* ผลตอบแทนที่มีอายุเกินหนึ่งปีจะแสดงเป็นผลตอบแทนต่อปี

ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกันตามกลุ่ม Equity General

### ระดับความเสี่ยง



เสี่ยงสูง

ลงทุนในตราสารทุนเป็นหลักโดยเฉลี่ยในรอบปี  
ไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV

### ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน	6 พฤศจิกายน 2546
นโยบายการจ่ายเงินปันผล	ไม่จ่าย
อายุกองทุน	ไม่กำหนดอายุโครงการ

### ผู้จัดการกองทุนรวม

นาย ชลิต โชคทวีพัฒนา (3 มกราคม 2549)  
นาย ปิติ ประดิษฐ์พงษ์ (1 ตุลาคม 2564)

### ดัชนีชี้วัด

ดัชนีผลตอบแทนรวมตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET TRI)  
วัตถุประสงค์การอ้างอิงดัชนีชี้วัด: บริษัทจัดการใช้ดัชนีชี้วัดดังกล่าวเพื่อเปรียบเทียบผลการดำเนินงานของกองทุนรวม

### คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวมมิได้เป็น  
สิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต: ได้รับการรับรองจาก CAC

จัดอันดับกองทุน Morningstar ★★★★★ (ข้อมูล ณ 31 ต.ค. 2567)

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือ  
บริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่อง  
ได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

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

นับถัดจากวันทำการขายคืน โดยทั่วไปจะได้

รับเงิน 3 วันทำการนับถัดจากวันทำการขายคืน

(T+3)

**ข้อมูลเชิงสถิติ**

Maximum Drawdown	-36.67 %
Recovering Period	11 เดือน 7 วัน
FX Hedging	ยังไม่มีการลงทุนในต่างประเทศ
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน	0.51 เท่า
Sharpe Ratio	-0.07
Alpha	0.76 %
Beta	1.01
Tracking Error	N/A

**ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปี ของ NAV)**

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	2.1400	2.1400
รวมค่าใช้จ่าย	2.3754	2.3323

**ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)**

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การขาย	ไม่เกิน 0.50	0.50
การรับซื้อคืน	ไม่เกิน 0.50	0.50
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า	ไม่เกิน 0.50	0.50
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก	ไม่เกิน 0.25	0.25
การโอนหน่วย	10 บาทต่อ 1,000 หน่วย	10 บาทต่อ 1,000 หน่วย

**หมายเหตุ**

- ค่าธรรมเนียมดังกล่าวเป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว
- บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ
- บริษัทจัดการอาจยกเว้นไม่เรียกเก็บค่าธรรมเนียมการโอนหน่วยลงทุน โดยขึ้นอยู่กับดุลยพินิจของบริษัทจัดการ

**ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก**

Holding	% NAV
บมจ.ซีพี ออลล์	7.62
บมจ.คาราบาวกรุ๊ป	4.82
บมจ.สยาม โกลบอลเฮ้าส์	4.70
บมจ.เอ็ม บี เค	4.66
บมจ.เอสซีบี เอกซ์	4.46

- ผู้ลงทุนสามารถซื้อกรมธรรม์ประกันชีวิตควบหน่วยลงทุน (Unit-Linked) ของกองทุนนี้ได้ โดยติดต่อกับบริษัทประกันชีวิตที่บริษัทจัดการกำหนด ทั้งนี้ การซื้อกรมธรรม์ประกันชีวิตควบหน่วยลงทุน อาจมีข้อกำหนดและวิธีปฏิบัติที่แตกต่างไปจากผู้ถือหน่วยลงทุนปกติที่ซื้อขายหน่วยลงทุนของกองทุนนี้เพียงอย่างเดียว ผู้ลงทุนจึงควรศึกษารายละเอียดในเอกสารประกอบการขายกรมธรรม์ประกันชีวิตควบหน่วยลงทุนให้เข้าใจก่อนการตัดสินใจลงทุน

**สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน (% NAV)**

ตราสารทุนและหน่วยลงทุน	97.52
เงินฝาก หรือตราสารหนี้ที่สถาบันการเงินเป็นผู้ออก	2.36
ทรัพย์สินอื่น	0.43
หนี้สินอื่น	-0.31

**การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม****(% NAV)**

หมวดพาณิชย์	16.10
หมวดขนส่งและโลจิสติกส์	15.68
หมวดธนาคาร	11.76
หมวดพัฒนาอสังหาริมทรัพย์	8.98
หมวดเงินทุนและหลักทรัพย์	7.77

## คำอธิบาย

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

**Recovering Period** ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาตั้งแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้เวลานานเท่าใด

**FX Hedging** เปรอ์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

**อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน** ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลานึง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์กับผลรวมของมูลค่าการขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 1 ปีหารด้วยมูลค่า NAV ของกองทุนรวมเฉลี่ยในรอบระยะเวลาเดียวกัน กองทุนรวมที่มีค่า portfolio turnover สูง บ่งชี้ถึงการซื้อขายหลักทรัพย์บ่อยครั้งของผู้จัดการกองทุนและทำให้มีต้นทุนการซื้อขายหลักทรัพย์ที่สูง 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** ระดับและทิศทางของการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุน 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

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