

กองทุนเปิดกรุงศรีมิคซ์พลัส 2TM

KFMXPLS2TM

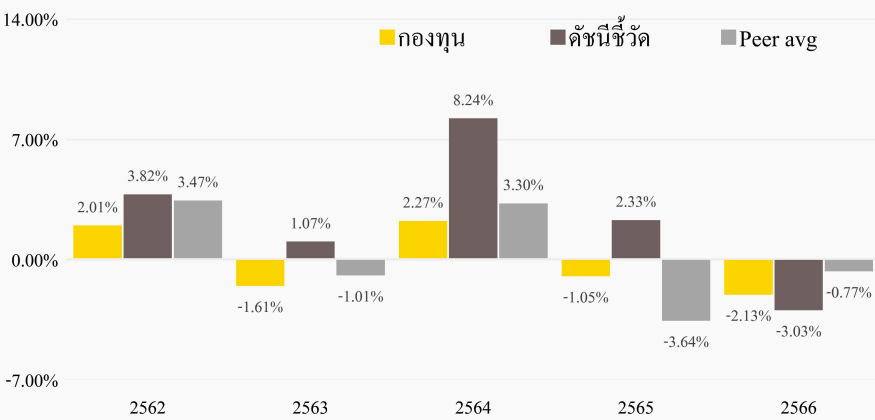
ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมผสม
- กองทุนรวมที่ลงทุนแบบมีความเสี่ยงทั้งในและต่างประเทศ
- กลุ่มกองทุนรวม : Conservative Allocation

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- ลงทุนในตราสารหนี้ที่ออกในประเทศ ทั้งภาครัฐ เงินฝากธนาคาร ตราสารหนี้ของบริษัทเอกชนที่อยู่ในอันดับที่สามารถลงทุนได้
- ลงทุนในตราสารทุนในประเทศโดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่เกินร้อยละ 40 ของ NAV โดยเน้นลงทุนในหุ้นที่มีแนวโน้มจ่ายปันผลดี
- ลงทุนในกองทุนรวมต่างประเทศชื่อ SPDR Gold Trust โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่เกินร้อยละ 10 ของ NAV
- กองทุนอาจลงทุนหรือมีไว้ซึ่งสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) เพื่อป้องกันความเสี่ยงและอาจลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) ที่แฝงอยู่ในธุรกรรม Structure note ที่เป็น Puttable / Callable bond เท่านั้น
- กองทุนมุ่งหวังให้ผลประกอบการสูงกว่าดัชนีชี้วัด (Active management)
- ป้องกันความเสี่ยงอัตราแลกเปลี่ยนตามดุลยพินิจของผู้จัดการกองทุน

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (% ต่อปี)



* ในปีที่กองทุนจัดตั้ง ผลการดำเนินงานจะแสดงตั้งแต่วันที่จัดตั้งจนถึงสิ้นปีปฏิทิน

ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปิดกumul (% ต่อปี)

| | YTD | 3 เดือน | 6 เดือน | 1 ปี * |
|--------------------------|--------|---------|---------|----------------|
| กองทุน | 3.40 | 3.26 | 2.68 | 4.59 |
| ดัชนีชี้วัด | 7.11 | 6.11 | 5.13 | 8.31 |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน | 2.38 | 1.66 | 2.08 | 4.92 |
| ความผันผวนกองทุน | 2.80 | 3.36 | 2.90 | 2.79 |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด | 4.76 | 5.46 | 4.92 | 4.68 |
| | 3 ปี * | 5 ปี * | 10 ปี * | ตั้งแต่จัดตั้ง |
| กองทุน | 0.15 | 0.07 | 0.68 | 1.00 |
| ดัชนีชี้วัด | 2.55 | 3.21 | 2.96 | 3.52 |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน | -0.73 | 0.14 | 1.12 | N/A |
| ความผันผวนกองทุน | 2.77 | 3.98 | 3.26 | 3.32 |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด | 4.53 | 6.78 | 5.86 | 6.15 |

* ผลตอบแทนที่มีอายุเกินหนึ่งปีจะแสดงผลตอบแทนต่อปี
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกันตามกลุ่ม Conservative Allocation

ระดับความเสี่ยง



เสี่ยงปานกลางค่อนข้างสูง

ลงทุนในตราสารทุน ตราสารหนี้และ/หรือทรัพย์สินทางเลือก โดยมีสัดส่วนการลงทุนในตราสารทุนน้อยกว่า 80% ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม

| | |
|------------------------|---------------------|
| วันจดทะเบียนกองทุน | 25 ตุลาคม 2555 |
| นโยบายการจ่ายเงินปันผล | ไม่จ่าย |
| อายุกองทุน | ไม่กำหนดอายุโครงการ |

ผู้จัดการกองทุนรวม

นาย ชลิต โชคทิพย์พัฒนา (1 ตุลาคม 2564)
น.ส. พรทิพา หนึ่งน้ำใจ (25 ตุลาคม 2555)

ดัชนีชี้วัด

1. ดัชนีผลตอบแทนรวมตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET TRI) สัดส่วนตัว (%) : 40.00
 2. ดัชนีพันธบัตรที่มีอายุคงที่ (ZRR) อายุประมาณ 1 ปี สัดส่วนตัว (%) : 30.00
 3. ดัชนีตราสารหนี้ภาคเอกชนที่มีอายุคงที่มีอันดับความน่าเชื่อถืออยู่ในระดับ BBB อายุ 1 ปี สัดส่วนตัว (%) : 10.00
 4. อัตราดอกเบี้ยเงินฝากประจำ 1 ปีวงเงินน้อยกว่า 5 ล้านบาท เฉลี่ยของ 3 ธนาคารพาณิชย์ขนาดใหญ่ได้แก่ ธนาคารกรุงเทพ ธนาคารกสิกรไทย และธนาคารไทยพาณิชย์ หลังหักภาษี สัดส่วนตัว (%) : 10.00
 5. ผลการดำเนินงานของ SPDR Gold Share ETF ในสกุลเงินดอลลาร์สหรัฐ ปรับด้วยอัตราแลกเปลี่ยนเพื่อเทียบกับค่าสกุลเงินบาท ณ วันที่คำนวณผลตอบแทน สัดส่วนตัว (%) : 10.00
- * เริ่มใช้ดัชนีชี้วัดผลการดำเนินงานใหม่หลังหักภาษี (Net TRN Index) มีผลตั้งแต่วันที่ 31 ตุลาคม 2562
วัตถุประสงค์การอ้างอิงดัชนีชี้วัด: บริษัทจัดการใช้ดัชนีชี้วัดดังกล่าวเพื่อเปรียบเทียบผลการดำเนินงานของกองทุนรวม

คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวมมิได้เป็นที่ยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต: ได้รับการรับรองจาก CAC

จัดอันดับกองทุน Morningstar **★★★★** (ข้อมูล ณ 30 ก.ย. 2567)

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือบริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่องได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

www.krungsriasset.com

การซื้อขายหน่วยลงทุน

วันทำการซื้อ: ทุกวันทำการของธนาคาร

เวลาทำการ: 08:30 น. - 15:30 น.

การซื้อขายครั้งแรกขั้นต่ำ: 500 บาท

การซื้อขายครั้งถัดไปขั้นต่ำ: 500 บาท

การขายคืนหน่วยลงทุน

วันทำการขายคืน: เดือนละ 2 ครั้ง ทุกวันที่ 1 และ 16

เวลาทำการ: 08:30 น. - 15:30 น.

การขายคืนขั้นต่ำ: 500 บาท หรือ 50 หน่วย

ยอดคงเหลือขั้นต่ำ: 50 หน่วย

ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน: ภายใน 5 วันทำการ

นับถัดจากวันทำการขายคืน โดยทั่วไปจะได้

รับเงิน 3 วันทำการนับถัดจากวันทำการขายคืน

(T+3)

ข้อมูลเชิงสถิติ

| | |
|----------------------------|---------------------|
| Maximum Drawdown | -9.69 % |
| Recovering Period | 1 ปี 2 เดือน 20 วัน |
| FX Hedging | 90.93 % |
| อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน | 0.60 เท่า |
| Sharpe Ratio | -0.46 |
| Alpha | -2.40 % |
| Beta | 0.99 |
| Tracking Error | N/A |

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปี ของ NAV)

| ค่าธรรมเนียม | สูงสุดไม่เกิน | เก็บจริง |
|---------------|---------------|----------|
| การจัดการ | 2.1400 | 0.7490 |
| รวมค่าใช้จ่าย | 4.1195 | 0.9475 |

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)

| ค่าธรรมเนียม | สูงสุดไม่เกิน | เก็บจริง |
|---|-----------------------|-----------------------|
| การขาย | ไม่เกิน 1.50 | ไม่เรียกเก็บ |
| การรับซื้อคืน | ไม่มี | ไม่มี |
| การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า | ไม่เกิน 1.50 | ไม่เรียกเก็บ |
| การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก | ไม่มี | ไม่มี |
| การโอนหน่วย | 10 บาทต่อ 1,000 หน่วย | 10 บาทต่อ 1,000 หน่วย |
| ค่าปรับกรณีขายคืนและสับเปลี่ยนออกก่อนระยะเวลาที่กำหนด | ไม่มี | ไม่มี |
| ค่าใช้จ่ายในการซื้อขายหลักทรัพย์เมื่อมีการสั่งซื้อ ขาย สับเปลี่ยนหน่วยลงทุน | ไม่เกิน 0.30 | 0.045 |

หมายเหตุ

- ค่าธรรมเนียมดังกล่าวเป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว
- บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ
- บริษัทจัดการอาจยกเว้นไม่เรียกเก็บค่าธรรมเนียมการโอนหน่วยลงทุน โดยขึ้นอยู่กับดุลยพินิจของบริษัทจัดการ

ตราสารหนี้ - ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก

| Holding | % NAV |
|--|-------|
| พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 12/FRB364/66 | 7.50 |
| พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 8/FRB182/67 | 5.46 |
| พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 1/FRB364/67 | 3.87 |
| พันธบัตรรัฐบาลเพื่อการบริหารหนี้ ในปีงบประมาณ พ.ศ. 2566 ครั้งที่ 25 | 2.38 |
| พันธบัตรรัฐบาลเพื่อความยั่งยืนสำหรับปรับโครงสร้างหนี้ (พ.ร.ก.กู้เงิน โควิด-19) ในปีงบประมาณ พ.ศ. 2565 ครั้งที่ 5 | 2.31 |

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน (% NAV)

| | |
|--|-------|
| ตราสารหนี้ที่ออกโดยบริษัทหรือภาคเอกชน | 30.24 |
| พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย | 26.89 |
| ตราสารทุนและหน่วยลงทุน | 20.94 |
| ตราสารภาครัฐหรือองค์กรระหว่างประเทศ | 12.93 |
| หน่วย CIS | 5.54 |
| เงินฝาก หรือตราสารหนี้ที่สถาบันการเงินเป็นผู้ออก | 3.47 |
| ทรัพย์สินอื่น | 0.22 |
| หนี้สินอื่น | -0.23 |

การจัดสรรการลงทุนในต่างประเทศ (% NAV)

| | |
|-----------|------|
| Singapore | 5.54 |
|-----------|------|

การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม (% NAV)

| | |
|---------------------------|-------|
| หมวดพลังงานและสาธารณูปโภค | 10.53 |
| หมวดพัฒนาอสังหาริมทรัพย์ | 7.35 |
| หมวดเงินทุนและหลักทรัพย์ | 6.22 |
| หมวดพาณิชย์ | 6.15 |
| หมวดหน่วยลงทุน | 5.54 |

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

| | |
|---------------------------------------|-------|
| ธนาคารแห่งประเทศไทย | 26.89 |
| กระทรวงการคลัง | 12.93 |
| บมจ.ช.ยูโอบี | 3.45 |
| บมจ.เงินติดล้อ | 2.30 |
| บมจ.กอล์ฟ เอ็นเนอร์จี้ ดีเวลลอปเม้นท์ | 2.27 |

การจัดสรรการลงทุนตามอันดับความน่าเชื่อถือ (%)

| | ในประเทศ | National | International |
|-----|----------|----------|---------------|
| AAA | 43.27 | | |
| AA | 5.58 | | |
| A | 24.69 | | |

ตราสารทุน - ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก

| Holding | % NAV |
|-----------------------------------|-------|
| SPDR Gold Trust | 5.54 |
| บมจ.เอสซีบี เอกซ์ | 1.19 |
| บมจ.ปตท. | 1.13 |
| บมจ.ท่าอากาศยานไทย | 0.89 |
| บมจ.เคแอลไอ เทคโนโลยี (ประเทศไทย) | 0.87 |

คำอธิบาย

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

Recovering Period ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาตั้งแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้เวลานานเท่าใด

FX Hedging เปอร์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลานึง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์กับผลรวมของมูลค่าการขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 1 ปีหารด้วยมูลค่า NAV ของกองทุนรวมเฉลี่ยในรอบระยะเวลาเดียวกัน กองทุนรวมที่มีค่า portfolio turnover สูงบ่งชี้ถึงการซื้อขายหลักทรัพย์บ่อยครั้งของผู้จัดการกองทุนและทำให้มีต้นทุนการซื้อขายหลักทรัพย์ที่สูง จึงต้องพิจารณาเปรียบเทียบกับผลการดำเนินงานของกองทุนรวมเพื่อประเมินความคุ้มค่าของการซื้อขายหลักทรัพย์ดังกล่าว

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 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 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