



krungsri

Asset  
Management

Make Life  
Simple

A member of  MUFJ  
a global financial group

# รายงานประจำครึ่งปีแรก 2567

รอบระยะเวลาตั้งแต่วันที่ 1 ตุลาคม 2566 - 31 มีนาคม 2567

กองทุนรวม

KFTRB

กองทุนเปิดกรุงศรีโทเทิลรีเทิร์นบอนด์

Krungsri Total Return Bond Fund

กองทุนนี้มีการแบ่งชนิดหน่วยลงทุนเป็น 2 ชนิด ได้แก่

1. หน่วยลงทุนชนิดสะสมมูลค่า :

กองทุนเปิดกรุงศรีโทเทิลรีเทิร์นบอนด์-สะสมมูลค่า (KFTRB-A)

2. หน่วยลงทุนชนิดผู้ลงทุนสถาบัน :

กองทุนเปิดกรุงศรีโทเทิลรีเทิร์นบอนด์-ผู้ลงทุนสถาบัน (ชื่อย่อ : KFTRB-I)

**Krungsri Asset Management Co., Ltd.**

1<sup>st</sup>-2<sup>nd</sup> Zone A, 12<sup>th</sup>, 18<sup>th</sup> Zone B Floor,  
Ploenchit Tower, 898 Ploenchit Road,  
Bangkok 10330 Thailand  
T +66 (0) 2657 5757 F +66 (0) 2657 5777  
www.krungsriasset.com

**บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด**

ชั้น 1-2 โซนเอ ชั้น 12 ชั้น 18 โซนบี  
อาคารเพลีนจิตทาวเวอร์ 898 ถนนเพลินจิต แขวงลุมพินี  
เขตปทุมวัน กรุงเทพฯ 10330  
โทรศัพท์ +66 (0) 2657 5757 โทรสาร +66 (0) 2657 5777  
www.krungsriasset.com

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด

## รายงานประจำปีครั้งแรก 2567

### กองทุนเปิดกรุงศรีโทเทิลรีเทิร์นบอนด์

- สารบัญที่จัดการ 3
- รายงานผู้ดูแลผลประโยชน์ 4
- งบแสดงฐานะการเงิน งบกำไรขาดทุนเบ็ดเสร็จ และงบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน 5
- รายละเอียดเงินลงทุน การกู้ยืมเงิน และการก่อภาระผูกพันของกองทุนรวม 8
- ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม 11
- ผลการดำเนินงาน 12
- ข้อมูลอื่นๆ ที่ผู้ถือหน่วยลงทุนควรทราบ 14
  - รายงานบุคคลที่เกี่ยวข้องที่มีการทำธุรกรรมในรอบเวลาที่ผ่านมา
  - รายชื่อผู้จัดการกองทุน
  - การเปิดเผยข้อมูลการถือหน่วยลงทุนเกิน 1 ใน 3
  - อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุนของกองทุน
  - ข้อมูลการลงทุน และผลการดำเนินงานของกองทุนหลัก

## สารบริษัทจัดการ

เรียน ผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุน

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด (บริษัทฯ) ขอส่งรายงานสำหรับรอบระยะเวลา 6 เดือน ของกองทุนเปิดกรุงศรี เทเลลิเทิร์นบอนด์ (KFTRB) ตั้งแต่วันที่ 1 ตุลาคม 2566 ถึงวันที่ 31 มีนาคม 2567 มายังผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุน โดยมีรายละเอียดดังนี้

### ผลการดำเนินงาน

กองทุนเปิดกรุงศรีเทเลลิเทิร์นบอนด์ มีมูลค่าทรัพย์สินสุทธิ ณ วันที่ 31 มีนาคม 2567 ซึ่งแบ่งตามชนิดหน่วยลงทุน ดังนี้

- KFTRB-A จำนวน 1,103.50 ล้านบาท คิดเป็นมูลค่าทรัพย์สินสุทธิต่อหน่วยลงทุน 11.2220 บาท
  - KFTRB-I จำนวน 3.02 ล้านบาท คิดเป็นมูลค่าทรัพย์สินสุทธิต่อหน่วยลงทุน 11.1010 บาท
- และมีผลการดำเนินงานย้อนหลัง 6 เดือน โดยแบ่งตามชนิดหน่วยลงทุน ได้แก่
- KFTRB-A เพิ่มขึ้นร้อยละ 4.25 น้อยกว่าเกณฑ์มาตรฐานการวัดผลการดำเนินงาน ที่เพิ่มขึ้นร้อยละ 6.36
  - KFTRB-I เพิ่มขึ้นร้อยละ 3.07 น้อยกว่าเกณฑ์มาตรฐานการวัดผลการดำเนินงาน ที่เพิ่มขึ้นร้อยละ 6.36

### ภาวะการลงทุนในช่วงที่ผ่านมา

ในรอบรอบครึ่งปีบัญชีที่ผ่านมา ธนาคารกลางสหรัฐฯ (Fed) คงอัตราดอกเบี้ยนโยบายในกรอบ 5.25% - 5.50% สินทรัพย์เสี่ยงประเภทตราสารทุนสหรัฐฯ มีราคาเพิ่มขึ้นในช่วงที่ผ่านมา นำโดยหุ้นกลุ่มเทคโนโลยีจากความคาดหวังเชิงบวกเกี่ยวกับความสามารถของ AI ปัจจัยด้านตลาดแรงงานสหรัฐฯ ที่แข็งแกร่ง ปริมาณการจ้างงานนอกภาคการเกษตรที่เพิ่มขึ้นเหนือความคาดหมาย และอัตราเงินเฟ้อที่ยังคงอยู่เหนือ 2% ปัจจัยต่างๆ เหล่านี้ยังคงไม่มีทีท่าว่าจะลดความร้อนแรงลง เป็นผลให้ทิศทางผลตอบแทนของตลาดตราสารหนี้และตราสารทุนเป็นไปคนละทางกัน โดยตราสารหนี้ภาครัฐระยะยาวถูกเทขายจากความต้องการสินทรัพย์เสี่ยงที่เพิ่มขึ้น และตราสารหนี้ระยะสั้นและระยะกลางยังคงให้ผลตอบแทนที่ดีจากความคาดหวังว่า Fed จะลดอัตราดอกเบี้ยซ้ำลง ช่วงที่ผ่านมากองทุนหลักได้รับผลดีจากกลยุทธ์ด้านอัตราดอกเบี้ยในสหรัฐฯ แต่ได้รับผลเสียจากการลงทุนในแคนาดาจากผลตอบแทนที่ยังเพิ่มขึ้น และสถานะชอร์ตในญี่ปุ่นที่ได้รับผลเสียจากผลตอบแทนตราสารหนี้ระยะยาวที่ลดลงช่วงต้นปี ในขณะที่ตราสารหนี้ MBS และตราสารหนี้ภาคเอกชนส่งผลบวกต่อกองทุนหลัก

ข้อมูลล่าสุดกองทุนหลักมีการลงทุนใน Agency และ Non Agency MBS 55.2% ตราสารหนี้ภาคเอกชนระดับลงทุนได้ 28.1% พันธบัตรรัฐบาลสหรัฐฯ 16.3% และมีสถานะชอร์ตตราสารหนี้ High Yield 2%

### แนวโน้มการลงทุน

กองทุนหลักมีอายุเฉลี่ยของตราสารหนี้ต่ำกว่าตลาดในภาพรวม โดยมีมุมมองปานกลางต่อตราสารหนี้ในสหรัฐฯ และยังคงสถานะการลงทุนตราสารหนี้ระยะสั้นของแคนาดา และสถานะชอร์ตตราสารหนี้ญี่ปุ่น กองทุนหลักยังคงให้น้ำหนักตราสารหนี้ภาคเอกชนต่ำกว่าตลาดโดยเน้นการลงทุนไปที่ภาคการเงิน และให้น้ำหนัก Agency MBA เหนือตลาด จากผลตอบแทนที่สูงอันเนื่องมาจาก Fed ลดการถือครองตราสารดังกล่าว พันธบัตรชดเชยเงินเฟ้อยังเป็นหลักทรัพย์หนึ่งที่กองทุนหลักถือครองเพื่อป้องกันความเสี่ยงจากอัตราเงินเฟ้อที่อาจเพิ่มขึ้นอย่างไม่คาดคิด ในแง่ของมุมมองการลดอัตราดอกเบี้ยนโยบายของ Fed กองทุนหลักเชื่อว่าจะมีการลดอัตราดอกเบี้ยเกิดขึ้นอย่างแน่นอนในระยะถัดไป แต่อาจลดอย่างรวดเร็วหากดัชนีทางเศรษฐกิจต่างๆ อ่อนแอลง หรือ ลดอย่างช้าๆ หากดัชนีทางเศรษฐกิจต่างไม่ได้ได้อ่อนแอลงในระยะถัดไป สำหรับมุมมองค่าเงิน กองทุนหลักมีสถานะซื้อสุทธิกับสกุลเงินของประเทศที่ให้อัตราผลตอบแทนที่แท้จริงสูง ทั้งในตลาดเกิดใหม่และตลาดพัฒนาแล้ว

บริษัทฯ ใคร่ขอขอบพระคุณท่านผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุนที่ได้มอบความไว้วางใจให้บริษัทฯ เป็นผู้บริหารเงินลงทุนของท่าน ทั้งนี้ บริษัทฯ จะพิจารณาดำเนินนโยบายการลงทุนที่เหมาะสมกับสถานการณ์ด้วยความระมัดระวัง และคำนึงถึงผลประโยชน์สูงสุดของผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุนเป็นสำคัญ

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด

### รายงานผู้ดูแลผลประโยชน์

เสนอ ผู้ถือหุ้นวงลงทุนกองทุนเปิดกรุงศรี โทเทิลรีเทิร์นบอนด์

ธนาคารซีทีแบงก์ เอ็น เอ สาขากรุงเทพฯ ในฐานะผู้ดูแลผลประโยชน์ กองทุนเปิดกรุงศรี โทเทิลรีเทิร์นบอนด์ อันมีบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด เป็นผู้จัดตั้งและจัดการกองทุน ได้ปฏิบัติหน้าที่ดูแลผลประโยชน์กองทุนรวมดังกล่าว สำหรับรอบระยะเวลาตั้งแต่วันที่ 1 ตุลาคม 2566 ถึงวันที่ 31 มีนาคม 2567 แล้วนั้น

ธนาคารฯ ได้จัดทำรายงานฉบับนี้ขึ้นบนพื้นฐานของแหล่งข้อมูลที่ได้รับ ณ วันที่ในจดหมายนี้โดยเชื่อว่าเชื่อถือได้ แต่ธนาคารไม่รับรองความถูกต้องหรือความสมบูรณ์ของข้อมูลดังกล่าว และขอสงวนสิทธิในความรับผิดชอบต่อความผิดพลาด ความละเอียด (รวมถึงไปถึงความรับผิดชอบต่อบุคคลที่สาม) อย่างชัดเจน ไม่มีการรับประกันว่าเหตุการณ์หรือผลลัพธ์ในอนาคตจะตรงกันกับรายงานดังกล่าว ธนาคารฯ กรรมการ พนักงาน หรือตัวแทนของธนาคารไม่รับประกันใดๆ ต่อการจ่ายเงินทุน การกระทำการ หรือการแจกจ่ายกองทุน และไม่รับผิดชอบต่อความเสียหายที่เป็นผลมาจากการกระทำ หรือการละเอียดที่เกิดขึ้นอันเกี่ยวข้องกับรายงานฉบับนี้

ธนาคารฯ เห็นว่าบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด ได้ปฏิบัติหน้าที่ในการจัดการ โดยถูกต้องตามที่ควรตามวัตถุประสงค์ที่ได้กำหนดไว้ในโครงการจัดการที่ได้รับอนุมัติจากสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ และภายใต้พระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535

ขอแสดงความนับถืออย่างสูง



(คุณสุวดี ชรรมาวดี คุณเจดจันทร์ สุนันทพงษ์ศักดิ์)

Citibank N.A.

ผู้ดูแลผลประโยชน์กองทุนรวม

ธนาคารซีทีแบงก์ เอ็น เอ สาขากรุงเทพฯ

23 เมษายน 2567 pp. ns.

กองทุนเปิดกรุงศรีโทเทิลรีเทิร์นบอนด์

งบแสดงฐานะการเงิน

ณ 31 มีนาคม 2567

	Unaudited (บาท)
สินทรัพย์	
เงินลงทุนตามราคายุติธรรม (ราคาทุน 1,139,282,594.88 บาท)	1,137,471,127.28
เงินฝากธนาคาร	2,661,510.93
ลูกหนี้จากสัญญาอนุพันธ์	342,870.84
ลูกหนี้	
จากดอกเบี้ย	69,004.17
จากการขายหน่วยลงทุน	100,327.14
จากการรับเงินค่าตอบแทนจากเงินลงทุนในต่างประเทศ	587,708.82
รวมสินทรัพย์	<u>1,141,232,549.18</u>
หนี้สิน	
เจ้าหนี้จากสัญญาอนุพันธ์	30,671,802.05
เจ้าหนี้	
จากการรับซื้อคืนหน่วยลงทุน	5,838,419.83
ค่าธรรมเนียมสับเปลี่ยนหน่วยลงทุน	37,578.11
ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย	846,558.34
ภาษีเงินได้ค้างจ่าย	10,350.63
หนี้สินอื่น	21,413.47
รวมหนี้สิน	<u>37,426,122.43</u>
สินทรัพย์สุทธิ	<u>1,103,806,426.75</u>
สินทรัพย์สุทธิ:	
หน่วยลงทุนจดทะเบียน 1,000 ล้านหน่วย มูลค่าที่ตราไว้หน่วยละ 10 บาท	
ทุนที่ได้รับจากผู้ถือหน่วยลงทุน	983,606,186.68
กำไรสะสม	335,940,944.64
บัญชีปรับสมดุล	(215,740,704.57)
สินทรัพย์สุทธิ	<u>1,103,806,426.75</u>
ชนิดสะสมมูลค่า	
สินทรัพย์สุทธิ	1,103,504,186.09
หน่วยลงทุนที่ออกจำหน่ายแล้ว ณ วันสิ้นปี (หน่วย)	98,333,392.3738
สินทรัพย์สุทธิต่อหน่วย	11.2220
ชนิดผู้ลงทุนสถาบัน	
สินทรัพย์สุทธิ	302,240.66
หน่วยลงทุนที่ออกจำหน่ายแล้ว ณ วันสิ้นปี (หน่วย)	27,226.2938
สินทรัพย์สุทธิต่อหน่วย	11.1010

กองทุนเปิดกรุงศรี โทเทิลรีเทิร์นบอนด์  
งบกำไรขาดทุนเบ็ดเสร็จ  
สำหรับงวดบัญชีสิ้นสุดวันที่ 31 มีนาคม 2567

	Unaudited (บาท)
รายได้จากการลงทุน	
รายได้ดอกเบี้ย	141,361.34
รายได้จากการรับเงินค่าตอบแทนจากเงินลงทุนในต่างประเทศ	2,589,929.01
รวมรายได้	2,731,290.35
ค่าใช้จ่าย	
ค่าธรรมเนียมการจัดการ	3,662,120.60
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์	164,063.16
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน	878,909.12
ค่าธรรมเนียมวิชาชีพ	40,000.14
รวมค่าใช้จ่าย	4,745,093.02
รายได้จากการลงทุนสุทธิ	(2,013,802.67)
รายการกำไร (ขาดทุน) สุทธิจากเงินลงทุน	
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิที่เกิดขึ้นจากเงินลงทุน	(3,128,255.72)
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิที่ยังไม่เกิดขึ้นจากเงินลงทุน	68,295,042.40
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิที่ยังไม่เกิดขึ้นจากสัญญาอนุพันธ์	14,330,637.25
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิจากอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ	(33,170,091.83)
รวมรายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิจากเงินลงทุนที่เกิดขึ้นและยังไม่ได้เกิดขึ้น	46,327,332.10
หัก ภาษีเงินได้	(21,204.21)
การเพิ่มขึ้นในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงานหลังหักภาษีเงินได้	44,292,325.22
การเพิ่มขึ้นในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงานแยกตามชนิดหน่วยลงทุน มีดังนี้	
ชนิดสะสมมูลค่า	43,630,909.33
ชนิดผู้ลงทุนสถาบัน	661,415.89
รวม	44,292,325.22

กองทุนเปิดกรุงศรีโทเทิลรีเทิร์นบอนด์

งบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน

ณ 31 มีนาคม 2567

การแสดงรายละเอียดเงินลงทุนใช้การจัดกลุ่มตามประเภทของเงินลงทุนและประเภทของอุตสาหกรรม

ประเภทเงินลงทุน/ผู้ออกตราสาร/ผู้ออกหลักทรัพย์	หมายเลขตราสาร	อัตรา ดอกเบี้ย (%)	วันครบอายุ	เงินต้น (บาท) / จำนวนหุ้น	มูลค่ายุติธรรม (บาท)	Unaudited ร้อยละของ มูลค่าเงิน ลงทุน
หลักทรัพย์ในประเทศ						
เงินฝากออมทรัพย์						
						3.13
ธ.ซีทีแบงก์ สาขากรุงเทพฯ		0.180000	เมื่อทวงถาม	1,079,911.84	1,079,911.84	0.09
บมจ.ธ.ทิสโก้		0.600000	เมื่อทวงถาม	743,764.55	743,764.55	0.07
บมจ.ธ.ยูโอบี		1.150000	เมื่อทวงถาม	33,831,801.18	33,831,801.18	2.97
หลักทรัพย์ต่างประเทศ						
หน่วยลงทุน						
PIMCO Total Return Bond Fund	PTRBDFE			1,103,627,117.31	1,101,815,649.71	96.87
จำนวน 1,162,338.916000 หน่วย						
มูลค่าหน่วยละ 26.0800 USD						
รวมเป็นเงิน 30,313,798.93 USD						
					1,137,471,127.28	100.00

# กองทุนเปิดกรุงศรีโทเทิลรีเทิร์นบอนด์

รายละเอียดการลงทุน ณ 31 มีนาคม 2567

	มูลค่าตามราคาตลาด	% NAV
<b>หลักทรัพย์หรือทรัพย์สินในประเทศ</b>	<b>38,385,992.67</b>	<b>3.48</b>
เงินฝากธนาคาร		
TRIS		
Rate A	744,963.09	0.07
S&P		
Rate A-	3,742,601.09	0.34
FITCH_TH-LONG		
Rate AAA	33,898,428.49	3.07
<b>หลักทรัพย์หรือทรัพย์สินต่างประเทศ</b>	<b>1,101,815,649.71</b>	<b>99.82</b>
หน่วยลงทุน		
ไม่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์	1,101,815,649.71	99.82
<b>สัญญาซื้อขายล่วงหน้า</b>	<b>(30,328,931.21)</b>	<b>(2.74)</b>
สัญญาที่อ้างอิงกับอัตราแลกเปลี่ยน-สัญญาแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ		
TRIS		
Rate A+	(18,211,213.11)	(1.65)
FITCH-LONG		
Rate AA	(8,318,446.78)	(0.75)
Rate AA-	(3,799,271.32)	(0.34)
<b>อื่นๆ</b>	<b>(6,066,284.42)</b>	<b>(0.56)</b>
ลูกหนี้	688,035.96	0.06
เจ้าหนี้	(5,907,762.04)	(0.54)
ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย	(846,558.34)	(0.08)
<b>มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ</b>	<b>1,103,806,426.75</b>	<b>100.00</b>



## กองทุนเปิดกรุงศรีโทเทิลรีเทิร์นบอนด์

รายละเอียดการลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ณ 31 มีนาคม 2567

ประเภทสัญญา	คู่สัญญา	วัตถุประสงค์	มูลค่าสัญญา (Notional Amount)	% NAV	วันครบกำหนด	กำไร/ขาดทุน (net gain/loss)
สัญญาที่อ้างอิงกับอัตราแลกเปลี่ยน						
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ธ.กรุงศรีอยุธยา	ป้องกันความเสี่ยง	85,009,896.40	(0.3442)	5 เม.ย. 2567	(3,799,271.32)
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ธ.กสิกรไทย	ป้องกันความเสี่ยง	38,750,003.60	0.0311	26 เม.ย. 2567	342,870.84
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ธ.กสิกรไทย	ป้องกันความเสี่ยง	246,355,460.00	(0.3362)	7 มิ.ย. 2567	(3,711,175.24)
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ธ.กสิกรไทย	ป้องกันความเสี่ยง	255,135,996.50	(0.4485)	28 มิ.ย. 2567	(4,950,142.38)
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ธ.ทหารไทยธนชาติ	ป้องกันความเสี่ยง	248,568,669.20	(1.0005)	26 เม.ย. 2567	(11,043,733.15)
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ธ.ทหารไทยธนชาติ	ป้องกันความเสี่ยง	238,714,818.00	(0.6493)	17 พ.ค. 2567	(7,167,479.96)

คำอธิบายการจัดอันดับตราสารของสถาบันจัดอันดับความน่าเชื่อถือ

• ตราสารหนี้ระยะกลางและระยะยาว

Moody's	S&P	TRIS	Fitch	คำอธิบาย	
Aaa	AAA	AAA	AAA	ความน่าเชื่อถือสูงสุด และมีความเสี่ยงต่ำที่สุด	ระดับการลงทุน (investment grade)
Aa1	AA+	AA+	AA+	ความน่าเชื่อถือสูงมาก และมีความเสี่ยงต่ำมาก	
Aa2	AA	AA	AA		
Aa3	AA-	AA-	AA-		
A1	A+	A+	A+	ความน่าเชื่อถือสูง และมีความเสี่ยงต่ำ	
A2	A	A	A		
A3	A-	A-	A-		
Baa1	BBB+	BBB+	BBB+	ความน่าเชื่อถืออยู่ในเกณฑ์พอใช้	
Baa2	BBB	BBB	BBB		
Baa3	BBB-	BBB-	BBB-		
Ba1	BB+	BB+	BB+	ความน่าเชื่อถือต่ำกว่าระดับปานกลาง	ระดับเก็งกำไร (speculative grade)
Ba2	BB	BB	BB		
Ba3	BB-	BB-	BB-		
B1	B+	B+	B+	ความน่าเชื่อถืออยู่ในเกณฑ์ต่ำมาก	
B2	B	B	B		
B3	B-	B-	B-		
Caa1	CCC+	C+	CCC	มีความเสี่ยงในการผิดนัดชำระหนี้สูงที่สุด	
Caa2	CCC				
Caa3	CCC-				
Ca	CC	C	CC		
	C	C-	C		
C	SD	RD	RD	อยู่ในสภาวะผิดนัดชำระหนี้ โดยผู้ออกตราสารหนี้ไม่สามารถชำระดอกเบี้ยและคืนเงินต้นได้ตามกำหนด	
	D	D	D		

• ตราสารหนี้ระยะสั้น

Moody's	S&P	TRIS	Fitch	คำอธิบาย
P-1	A-1	T1	F1	ผู้ออกตราสารหนี้มีสถานะทั้งทางด้านการตลาดและการเงินที่แข็งแกร่งในระดับดีมาก มีสภาพคล่องที่ดีมาก และนักลงทุนจะได้รับความคุ้มครองจากการผิดนัดชำระหนี้ที่ต่ำกว่าอันดับเครดิตในระดับอื่น
P-2	A-2	T2	F2	ผู้ออกตราสารหนี้มีสถานะทั้งทางด้านการตลาดและการเงินที่แข็งแกร่งในระดับดี และมีความสามารถในการชำระหนี้ระยะสั้นในระดับที่น่าพอใจ
P-3	A-3	T3	F3	ผู้ออกตราสารหนี้มีความสามารถในการชำระหนี้ระยะสั้นในระดับที่ยอมรับได้
	B	T4	B	มีความสามารถในการชำระหนี้ระยะสั้นที่ค่อนข้างอ่อนแอ ผู้ออกแสดงถึงความไม่แน่นอนอย่างสูงของความสามารถในการชำระหนี้ได้ตรงตามกำหนดเวลาที่ระบุไว้
	C		C	
	D	D	D	เป็นระดับที่อยู่ในสภาวะผิดนัดชำระหนี้ โดยผู้ออกตราสารหนี้ไม่สามารถชำระดอกเบี้ยและคืนเงินต้นได้ตามกำหนด

หมายเหตุ

- เครื่องหมายบวก (+) หรือ ลบ (-) หรือเลข 1 ถึง 3 ต่อท้ายนั้น เพื่อจำแนกความแตกต่างของคุณภาพของอันดับเครดิตภายในระดับเดียวกัน
- คำเสริมท้าย (tha) จะระบุไว้ต่อจากอันดับเครดิตเพื่อบอกถึงอันดับเครดิตภายในประเทศสำหรับประเทศไทย

ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (Fund's Direct Expenses)

กองทุนเปิดกรุงศรีโทเทิลรีเทิร์นบอนด์

ตั้งแต่วันที่ 1 ตุลาคม 2566 ถึงวันที่ 31 มีนาคม 2567

ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (Fund's Direct Expenses)	จำนวนเงิน (หน่วย:พันบาท)	ร้อยละของมูลค่า ทรัพย์สิน* (ต่อปี) 1/
ค่าธรรมเนียมการจัดการ (Management Fee) 2/	3,662.12	0.6688
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ (Trustee Fee)	164.06	0.0300
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน (Registrar Fee)	878.91	0.1605
ค่าที่ปรึกษาการลงทุน (Advisory Fee)	-	-
ค่าธรรมเนียมสอบบัญชี (Auditing Fee)	40.00	0.0073
ค่าใช้จ่ายอื่น ๆ (Others)	-	-
<b>รวมค่าใช้จ่ายทั้งหมด 3/</b>	<b>4,745.09</b>	<b>0.8666</b>

หมายเหตุ

1/ ค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวมข้างต้น เป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่มหรือภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว

2/ กองทุน PIMCO Total Return Bond Fund, Class E Acc. (USD) (กองทุนหลัก) จะคืน (rebate) ค่าธรรมเนียมการจัดการให้แก่กองทุนเปิดกรุงศรีโทเทิลรีเทิร์น บอนด์ ในอัตราร้อยละ 50 ซึ่งจะเท่ากับร้อยละ 0.625 ต่อปีของมูลค่าเงินลงทุนในกองทุน PIMCO Total Return Bond Fund, Class E Acc. (USD) โดยเก็บเข้าเป็นทรัพย์สินของกองทุนเปิดกรุงศรีโทเทิลรีเทิร์นบอนด์ ทั้งนี้ การคืนค่าธรรมเนียมดังกล่าวอาจปรับเปลี่ยนได้ตามการเปลี่ยนแปลงอัตราค่าธรรมเนียมการจัดการของกองทุนหลัก (ถ้ามี)

3/ ไม่รวมค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ และค่าธรรมเนียมต่าง ๆ ที่เกิดขึ้นจากการซื้อขายหลักทรัพย์

\* มูลค่าทรัพย์สิน ในที่นี้ หมายถึง มูลค่าทรัพย์สินทั้งหมด หักด้วย มูลค่าหนี้สินทั้งหมด

เว้นแต่ค่าธรรมเนียมการจัดการ ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ ค่าธรรมเนียมนายทะเบียนหน่วยลงทุน และค่าใช้จ่ายที่เกี่ยวข้องกับการปฏิบัติการกองทุน ณ วันที่คำนวณ

ผลการดำเนินงานของกองทุนเปิดกรุงศรีโทเทิลรีเทิร์นบอนด์-สะสมมูลค่า

ผลการดำเนินงาน สิ้นสุด ณ วันที่ 29 มีนาคม 2567	% ตามช่วงเวลา			% ต่อปี				นับจากวันเริ่ม โครงการ (14 ตุลาคม 2553)
	Year to Date	ย้อนหลัง 3 เดือน	ย้อนหลัง 6 เดือน	ย้อนหลัง 1 ปี	ย้อนหลัง 3 ปี	ย้อนหลัง 5 ปี	ย้อนหลัง 10 ปี	
KFTRB-A	-0.80%	-0.80%	+4.25%	-1.04%	-5.45%	-1.85%	-0.05%	+0.86%
ดัชนีชี้วัด (Benchmark)*	-0.38%	-0.38%	+6.36%	+2.40%	-3.62%	-0.37%	+0.71%	+0.93%
ความผันผวนของผลการดำเนินงาน	+5.40%	+5.40%	+7.09%	+6.64%	+6.26%	+5.69%	+4.52%	+4.24%
ความผันผวนของดัชนีชี้วัด	+5.47%	+5.47%	+7.19%	+6.95%	+6.37%	+5.78%	+4.59%	+4.31%

หมายเหตุ : \* ดัชนีชี้วัด (Benchmark) คือ

ผลการดำเนินงานของกองทุนหลัก สัดส่วน 100.00% ปรับด้วยต้นทุนการป้องกันความเสี่ยงด้านอัตราแลกเปลี่ยน เพื่อเทียบกับค่าสกุลเงินบาท ณ วันที่คำนวณผลตอบแทน

\*\* ผลตอบแทนที่มีอายุเกินหนึ่งปีจะแสดงผลตอบแทนต่อปี

เอกสารการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวมฉบับนี้ ได้จัดทำตามมาตรฐานการวัดผลดำเนินงานของ  
กองทุนรวมของสมาคมบริษัทจัดการลงทุน

ผลการดำเนินงานของกองทุนเปิดกรุงศรีโทเทิลรีเทิร์นบอนด์-ผู้ลงทุนสถาบัน

ผลการดำเนินงาน สิ้นสุด ณ วันที่ 29 มีนาคม 2567	% ตามช่วงเวลา			% ต่อปี				นับจากวันเริ่ม โครงการ (24 พฤศจิกายน 2565)
	Year to Date	ย้อนหลัง 3 เดือน	ย้อนหลัง 6 เดือน	ย้อนหลัง 1 ปี	ย้อนหลัง 3 ปี	ย้อนหลัง 5 ปี	ย้อนหลัง 10 ปี	
KFTRB-I	-2.63%	-2.63%	+3.07%	-2.14%	N/A	N/A	N/A	-0.85%
ดัชนีชี้วัด (Benchmark)*	-0.38%	-0.38%	+6.36%	+2.40%	N/A	N/A	N/A	+4.09%
ความผันผวนของผลการดำเนินงาน	+7.55%	+6.92%	+8.52%	+7.46%	N/A	N/A	N/A	+7.36%
ความผันผวนของดัชนีชี้วัด	+5.47%	+5.47%	+7.19%	+6.95%	N/A	N/A	N/A	+6.95%

หมายเหตุ : \* ดัชนีชี้วัด (Benchmark) คือ

ผลการดำเนินงานของกองทุนหลัก สัดส่วน 100.00% ปรับด้วยต้นทุนการป้องกันความเสี่ยงด้านอัตราแลกเปลี่ยน เพื่อเทียบกับค่าสกุลเงินบาท ณ วันที่คำนวณผลตอบแทน

\*\* ผลตอบแทนที่มีอายุเกินหนึ่งปีจะแสดงเป็นผลตอบแทนต่อปี

เอกสารการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวมฉบับนี้ ได้จัดทำตามมาตรฐานการวัดผลดำเนินงานของ  
กองทุนรวมของสมาคมบริษัทจัดการลงทุน

## ข้อมูลอื่นๆ ที่ผู้ถือหน่วยลงทุนควรทราบ

### (1) รายงานบุคคลที่เกี่ยวข้องที่มีการทำธุรกรรมในรอบเวลาที่ผ่านมา (วันที่ 1 ตุลาคม 2566 ถึงวันที่ 31 มีนาคม 2567)

ชื่อกองทุน	รายชื่อบุคคลที่เกี่ยวข้อง
กองทุนเปิดกรุงศรีโทเทิลรีเทิร์นบอนด์	1. ธนาคารกรุงศรีอยุธยา จำกัด (มหาชน) 2. บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด

หมายเหตุ: ผู้ลงทุนสามารถตรวจสอบการทำธุรกรรมกับบุคคลที่เกี่ยวข้องกับกองทุนรวมได้ที่บริษัทจัดการโดยตรง หรือที่ web site ของบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด (<http://www.krungsriasset.com>) และสำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ต. (<http://www.sec.or.th>)

### (2) รายชื่อผู้จัดการกองทุน ณ วันที่ 31 มีนาคม 2567

- นางสาวพรทิพา หนึ่งน้ำใจ
- นายธีรภาพ จิรศักยกุล
- นางสาวรัมภารัตน์ ยูชานหัส
- นายเอกพจน์ ภูวิบูลย์พาณิชย์
- นางสาวณัฐยา เตรียมวิทยา
- นายจตุรันต์ สอนไว
- นายชูศักดิ์ อวยพรชัยสกุล
- นายพงศ์สัมพันธ์ อนุรัตน์
- นางสาววรรดา ต้นดีสุนทร
- นายวัชรินทร์ ค้างสังข์

### (3) การเปิดเผยข้อมูลการถือหน่วยลงทุนเกิน 1 ใน 3 ณ วันที่ 31 มีนาคม 2567

ไม่มีการถือหน่วยลงทุนเกิน 1 ใน 3 ของบุคคลใดบุคคลหนึ่ง

ผู้ถือหน่วยลงทุนสามารถตรวจสอบข้อมูลสัดส่วนการถือหน่วยลงทุนโดยตรงได้ที่ [www.krungsriasset.com](http://www.krungsriasset.com)

### (4) อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุนของกองทุน (portfolio turnover ratio) ในรอบระยะเวลาที่ผ่านมา

- KFTRB-A (portfolio turnover ratio) เท่ากับ 10.29%
- KFTRB-I (portfolio turnover ratio) เท่ากับ 10.29%

(5) ผลการดำเนินงานของกองทุนหลัก และ ข้อมูลการลงทุน (ข้อมูล ณ วันที่ 31/03/2024)

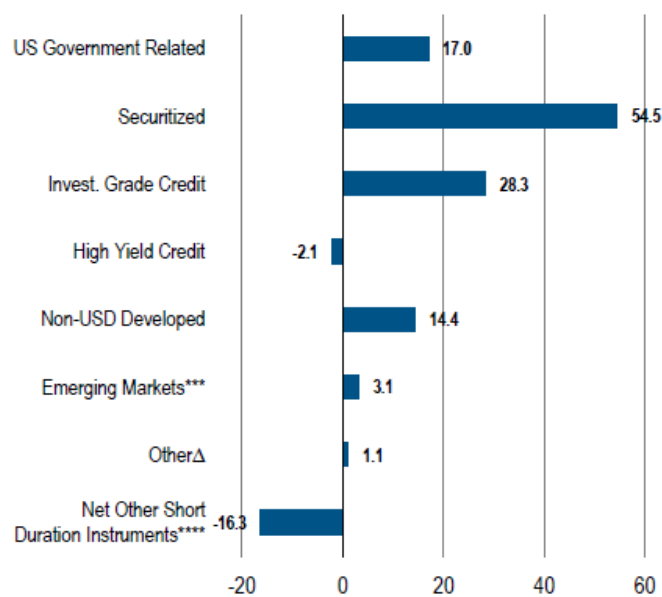
Performance (Net of Fees)	1 Mo.	3 Mos.	6 Mos.	1 Yr.	3 Yrs.	5 Yrs.	10 Yrs.	SI
E, Acc (%) <sup>1</sup>	1.01	-0.31	6.36	2.39	-3.62	-0.37	0.71	2.68
Net of 5% Preliminary Charge <sup>2</sup>	-4.05	-5.30	1.05	-2.72	-5.25	-1.39	0.19	2.39
E, Inc (%) <sup>1</sup>	1.01	-0.31	6.29	2.38	-3.63	-0.37	0.70	2.59
Net of 5% Preliminary Charge <sup>2</sup>	-4.06	-5.25	0.98	-2.73	-5.28	-1.38	0.19	2.31
Benchmark (%)	0.92	-0.78	5.99	1.70	-2.46	0.36	1.54	—

Past Performance is not a guarantee or reliable indicator of future results and no guarantee is being made that similar returns will be achieved in the future.

Calendar Year (Net of Fees)	2014	2015	2016	2017	2018	2019	2020	2021	2022	2023	YTD
E, Acc (%) <sup>1</sup>	3.24	-0.20	2.22	3.98	-1.93	8.00	8.16	-2.12	-16.03	5.36	-0.31
Net of 5% Preliminary Charge <sup>2</sup>	-1.93	-5.2	-2.91	-1.2	-6.84	2.61	2.76	-7.01	-20.24	0.08	-5.3
E, Inc (%) <sup>1</sup>	3.28	-0.22	2.18	3.98	-1.94	8.02	8.20	-2.10	-16.07	5.35	-0.31
Net of 5% Preliminary Charge <sup>2</sup>	-1.9	-5.19	-2.91	-1.24	-6.82	2.61	2.76	-6.97	-20.26	0.07	-5.25
Benchmark (%)	5.97	0.55	2.65	3.54	0.01	8.72	7.51	-1.54	-13.01	5.53	-0.78

Past performance is not necessarily indicative of future performance. The benchmark is the Bloomberg U.S. Aggregate Index All periods longer than one year are annualised. SI is the performance since inception. <sup>1</sup> Performance shown is on a NAV-to-NAV basis in the denominated currency, excluding the preliminary charge and on the assumption that distributions are reinvested, as applicable. <sup>2</sup> Performance shown is on a NAV-to-NAV basis in the denominated currency, taking into account the preliminary charge and on the assumption that distributions are reinvested, as applicable. A preliminary charge of up to 5% may or may not be deducted from the subscription amount depending on the distributor from whom you had purchased shares, as such this may not represent actual performance returns. Investment returns denominated in non-local currency may be exposed to exchange rate fluctuations.

Sector Allocation (% Market Value)



Market Value % may not equal 100 due to rounding.

Top 10 Holdings (% Market Value)\*

FNMA TBA 3.5% FEB 30YR	7.6
FNMA TBA 4.0% FEB 30YR	5.2
FNMA TBA 3.0% FEB 30YR	4.9
FNMA TBA 5.0% JAN 30YR	4.7
FNMA TBA 4.5% FEB 30YR	4.2
FNMA TBA 5.0% FEB 30YR	3.3
FNMA TBA 5.5% FEB 30YR	3.1
FNMA TBA 3.0% MAR 30YR	2.7
U S TREASURY BOND	2.6
U S TREASURY BOND	2.5

\*Top 10 holdings as of 12/31/2023, excluding derivatives.