

## กองทุนเปิดกรุงศรีเอเชียนไฮยิลด์บอนด์-สะสมมูลค่า

หน่วยลงทุนชนิดสะสมมูลค่า  
KFAHYBON-A

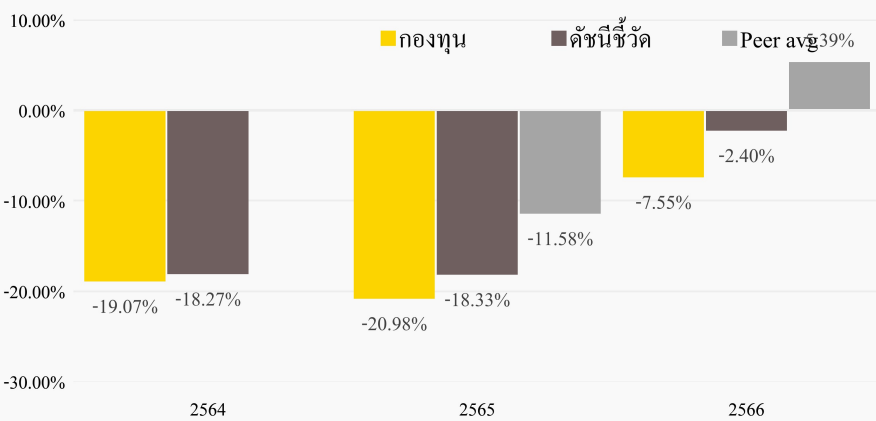
### ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมตราสารหนี้/ กองทุนรวมหน่วยลงทุนประเภท Feeder Fund
- กองทุนรวมที่เน้นลงทุนแบบมีความเสี่ยงต่างประเทศ
- กลุ่มกองทุนรวม : High yield bond

### นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- ลงทุนในกองทุนรวมต่างประเทศชื่อ BGF Asian High Yield Bond Fund, Class D2 USD (กองทุนหลัก) โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของ NAV
- กองทุนหลักลงทุนในตราสารหนี้ที่มีอันดับความน่าเชื่อถือต่ำกว่าที่สามารถลงทุนได้ (Non-Investment Grade) หรือตราสารหนี้ที่ไม่ได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือ (Unrated) ไม่ต่ำกว่าร้อยละ 70 ของทรัพย์สินของกองทุน
- บริษัทที่บริหารจัดการกองทุนหลัก คือ BlackRock (Luxembourg) S.A.
- กองทุนอาจลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเพื่อเพื่อเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน (Efficient Portfolio Management) โดยขึ้นอยู่กับดุลยพินิจของผู้จัดการกองทุน
- มุ่งหวังให้ได้รับผลประโยชน์จากการเคลื่อนไหวตามกองทุนหลัก (Passive management/ Index tracking) โดยกองทุนหลักมุ่งหวังให้ได้รับผลประโยชน์จากการเคลื่อนไหวสูงกว่าดัชนีชี้วัด (Active management)
- ป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยนไม่น้อยกว่าร้อยละ 90 ของมูลค่าเงินลงทุนในต่างประเทศ

### ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (% ต่อปี)



\* ในปีที่กองทุนจัดตั้ง ผลการดำเนินงานจะแสดงตั้งแต่วันที่จัดตั้งจนถึงสิ้นปีปฏิทิน

### ระดับความเสี่ยง



ลงทุนในตราสารหนี้เอกชนเป็นหลัก โดยมีตราสาร noninvestment grade/ unrated ไม่น้อยกว่า 60% ของ NAV

### ข้อมูลกองทุนรวม

|                        |                     |
|------------------------|---------------------|
| วันจดทะเบียนกองทุน     | 27 พฤษภาคม 2564     |
| วันเริ่มต้น class      | 27 พฤษภาคม 2564     |
| นโยบายการจ่ายเงินปันผล | ไม่จ่าย             |
| อายุกองทุน             | ไม่กำหนดอายุโครงการ |

### ผู้จัดการกองทุนรวม

นาย จาตุรันต์ สอนไว (27 พฤษภาคม 2564)  
นาย ชุติศักดิ์ อวยพรชัยสกุล (27 พฤษภาคม 2564)

### ดัชนีชี้วัด

ผลการดำเนินงานของกองทุนหลัก สัดส่วน 100.00% ปรับด้วยต้นทุนการป้องกันความเสี่ยงด้านอัตราแลกเปลี่ยน เพื่อเทียบกับค่าสกุลเงินบาท ณ วันที่คำนวณผลตอบแทน

### คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวมมิได้เป็นลัษณ์ยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต: ได้รับการรับรองจาก CAC

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



www.krungsriasset.com

ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือ  
บริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่อง  
ได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด (% ต่อปี)

|                          | YTD    | 3 เดือน | 6 เดือน | 1 ปี *         |
|--------------------------|--------|---------|---------|----------------|
| กองทุน                   | -7.55  | 4.40    | -3.16   | -7.55          |
| ดัชนีชี้วัด              | -2.40  | 6.27    | -0.37   | -2.40          |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน | 5.39   | 3.92    | 3.17    | 5.39           |
| ความผันผวนกองทุน         | 6.72   | 4.29    | 5.67    | 6.72           |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด    | 6.87   | 4.38    | 5.63    | 6.87           |
|                          | 3 ปี * | 5 ปี *  | 10 ปี * | ตั้งแต่จัดตั้ง |
| กองทุน                   | N/A    | N/A     | N/A     | -18.37         |
| ดัชนีชี้วัด              | N/A    | N/A     | N/A     | -15.23         |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน | N/A    | N/A     | N/A     | N/A            |
| ความผันผวนกองทุน         | N/A    | N/A     | N/A     | 10.19          |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด    | N/A    | N/A     | N/A     | 10.27          |

\* ผลตอบแทนที่มีอายุเกินหนึ่งปีจะแสดงเป็นผลตอบแทนต่อปี  
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกันตามกลุ่ม High yield bond

|                                   |                                               |
|-----------------------------------|-----------------------------------------------|
| <b>การซื้อขายหน่วยลงทุน</b>       | <b>การขายคืนหน่วยลงทุน</b>                    |
| วันทำการซื้อ: ตามวันทำการกองทุน   | วันทำการขายคืน: ตามวันทำการกองทุน             |
| เวลาทำการ: 08:30 น. - 15:30 น.    | เวลาทำการ: 08:30 น. - 14:30 น.                |
| การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ: 500 บาท   | การขายคืนขั้นต่ำ: 500 บาท                     |
| การซื้อครั้งถัดไปขั้นต่ำ: 500 บาท | ยอดคงเหลือขั้นต่ำ: 50 หน่วย                   |
|                                   | ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน: ภายใน 5 วันทำการ |
|                                   | นับถัดจากวันคำนวณ NAV โดยทั่วไปจะได้รับเงิน 4 |
|                                   | วันทำการนับถัดจากวันทำการขายคืน (T+4)         |

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปี ของ NAV)

| ค่าธรรมเนียม  | สูงสุดไม่เกิน | เกินจริง |
|---------------|---------------|----------|
| การจัดการ     | 2.1400        | 1.0700   |
| รวมค่าใช้จ่าย | 4.6545        | 1.2734   |

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)

| ค่าธรรมเนียม                | สูงสุดไม่เกิน         | เกินจริง              |
|-----------------------------|-----------------------|-----------------------|
| การขาย                      | ไม่เกิน 2.00          | 1.00                  |
| การรับซื้อคืน               | ไม่เกิน 2.00          | ไม่เรียกเก็บ          |
| การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า | ไม่เกิน 2.00          | 1.00                  |
| การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก  | ไม่เกิน 2.00          | ไม่เรียกเก็บ          |
| การโอนหน่วย                 | 10 บาทต่อ 1,000 หน่วย | 10 บาทต่อ 1,000 หน่วย |

หมายเหตุ

- ค่าธรรมเนียมดังกล่าวเป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว
- บริษัทจัดการขอสงวนสิทธิในการยกเว้นโดยไม่เรียกเก็บค่าธรรมเนียมการสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนระหว่างชนิดหน่วยลงทุนภายใต้กองทุนเดียวกัน ให้แก่ผู้ถือหน่วยลงทุนที่ประสงค์จะสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนระหว่างชนิดหน่วยลงทุนของกองทุนนี้ โดยขึ้นอยู่กับดุลยพินิจของบริษัทจัดการ

ข้อมูลเชิงสถิติ

|                            |                     |
|----------------------------|---------------------|
| Maximum Drawdown           | -48.03 %            |
| Recovering Period          | 0.00                |
| FX Hedging                 | 92.77 %             |
| อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน | 21.88 %             |
| อายุเฉลี่ยของตราสารหนี้    | 2 ปี 9 เดือน 28 วัน |
| Yield to Maturity          | 10.84               |

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน (% NAV)

|                                                     |       |
|-----------------------------------------------------|-------|
| Blackrock Global Funds - Asian High Yield Bond Fund | 93.46 |
| ทรัพย์สินอื่น                                       | 4.28  |
| เงินฝาก หรือตราสารหนี้ที่สถาบันการเงินเป็นผู้ออก    | 2.37  |
| หนี้สินอื่น                                         | -0.11 |

การจัดสรรการลงทุนในต่างประเทศ (% NAV)

|                                      |       |
|--------------------------------------|-------|
| India                                | 20.16 |
| China                                | 19.45 |
| Macau                                | 12.18 |
| Singapore                            | 8.43  |
| Hong Kong                            | 8.38  |
| ข้อมูลกองทุนหลัก ณ 30 พฤศจิกายน 2566 |       |

การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม/ทรัพย์สิน (% NAV)

|                                      |       |
|--------------------------------------|-------|
| Financials                           | 21.11 |
| Consumer Cyclical                    | 18.99 |
| Utilities                            | 12.51 |
| Real Estate                          | 10.24 |
| Basic Industry                       | 5.58  |
| ข้อมูลกองทุนหลัก ณ 30 พฤศจิกายน 2566 |       |

การจัดสรรการลงทุนตามอันดับความน่าเชื่อถือ (%)

| ในประเทศ                             | National | International |
|--------------------------------------|----------|---------------|
| A                                    |          | 1.38          |
| BBB                                  |          | 14.70         |
| ต่ำกว่า BBB                          |          | 67.17         |
| Unrated                              |          | 13.25         |
| ข้อมูลกองทุนหลัก ณ 30 พฤศจิกายน 2566 |          |               |

ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก

| Holding                                                      | % NAV |
|--------------------------------------------------------------|-------|
| iShares USD Asia HY Bond ETF                                 | 4.42  |
| Vedanta Resources Finance II Plc Regs 8.95 03/11/2025        | 1.51  |
| China Cinda (2020) I Management Lt Mtn Regs 5.75 02/07/2027  | 1.15  |
| Pakistan (Islamic Republic Of) Mtn Regs 6 04/08/2026         | 1.07  |
| Bangkok Bank Public Co Ltd (Hong K Mtn Regs 3.733 09/25/2034 | 1.02  |
| ข้อมูลกองทุนหลัก ณ 30 พฤศจิกายน 2566                         |       |

การลงทุนในกองทุนอื่นเกินกว่า 20% (กองในประเทศและกองต่างประเทศ)

|                                           |                          |
|-------------------------------------------|--------------------------|
| ชื่อกอง : BGF Asian High Yield Bond Fund, | ISIN code : LU1564328224 |
| Class D2 USD                              | Bloomberg code : BGAHD2U |

- บริษัทจัดการจะปฏิบัติตามกฎเกณฑ์ของกองทุนหลักโดยรายงานการถือครองหน่วยลงทุนตั้งแต่ร้อยละ 25 ของจำนวนหน่วยลงทุนที่จำหน่ายได้แล้วทั้งหมดของกองทุนให้กับผู้มีอำนาจหน้าที่ของกองทุนหลัก และอาจนำเสนอข้อมูลส่วนตัวของผู้ถือหน่วยลงทุนดังกล่าวเช่น สำเนาบัตรประจำตัวประชาชนและ/หรือสำเนาทะเบียนบ้านเป็นต้น และ/หรือขอข้อมูลหรือเอกสารเพิ่มเติมอื่นใดจากผู้ถือหน่วยลงทุนในภายหลังก็ได้ เพื่อให้เป็นไปตามที่กองทุนหลักร้องขอ หากผู้ถือหน่วยลงทุนรายใดปฏิเสธการให้ข้อมูลหรือเอกสารเพิ่มเติมดังกล่าวหรือมีพฤติกรรมเข้าข่ายและ/หรือมีความผิดตามกฎหมายอันมีผลทำให้บริษัทจัดการไม่สามารถปฏิบัติตามกฎเกณฑ์ของกองทุนหลักได้ บริษัทจัดการขอสงวนสิทธิ์ที่จะระงับหรือหยุดให้บริการและดำเนินการคืนเงินลงทุนตามมูลค่าหน่วยลงทุนให้แก่ผู้ถือหน่วยลงทุน โดยถือว่าได้รับความเห็นชอบจากผู้ถือหน่วยลงทุนแล้ว ทั้งนี้ผู้ถือหน่วยลงทุนจะไม่สามารถนำเรื่องดังกล่าวมาใช้เป็นสิทธิเรียกร้องความเสียหายจากเหตุดังกล่าวจากบริษัทจัดการได้แต่อย่างใด
- ผู้ลงทุนสามารถซื้อกรรมสิทธิ์ประกันชีวิตควบหน่วยลงทุน (Unit-Linked) ของกองทุนนี้ได้โดยติดต่อกับบริษัทประกันชีวิตที่บริษัทจัดการกำหนด ทั้งนี้ การซื้อกรรมสิทธิ์ประกันชีวิตควบหน่วยลงทุนอาจมีข้อกำหนดและวิธีปฏิบัติที่แตกต่างไปจากผู้ถือหน่วยลงทุนปกติที่ซื้อขายหน่วยลงทุนของกองทุนนี้เพียงอย่างเดียว ผู้ลงทุนจึงควรศึกษารายละเอียดในเอกสารประกอบการขายกรรมสิทธิ์ประกันชีวิตควบหน่วยลงทุนให้เข้าใจก่อนการตัดสินใจลงทุน

คำอธิบาย

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

**Recovering Period** ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาดังแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่พ้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลานานเท่าใด

**FX Hedging** เปรอ์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

**อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน** ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตกองทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลานึง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อหลักทรัพย์กับผลรวมของมูลค่าการขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 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 ซึ่งเป็นผลจากประสิทธิภาพของผู้จัดการกองทุน ในการคัดเลือกหรือหาจังหวะเข้าลงทุนในหลักทรัพย์ได้อย่างเหมาะสม

**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 โชนออร์ ชั้น 12 ชั้น 18 โชนบี  
ถนนเพลินจิต แขวงลุมพินี เขตปทุมวัน กรุงเทพฯ 10330  
โทรศัพท์ 0-2657-5757 โทรสาร 0-2657-5777  
เว็บไซต์: www.krungsriasset.com