

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด

ข้อมูล ณ วันที่ 28 ธันวาคม 2566

การลงทุนใน LTF ตั้งแต่ 1 ม.ค. 63 เป็นต้นไป ผู้ลงทุนไม่สามารถนำมาลดหย่อนภาษีได้

## กองทุนเปิดกรุงศรีหุ้นระยะยาวออลสตาร์ปันผล

KFLTFAST-D

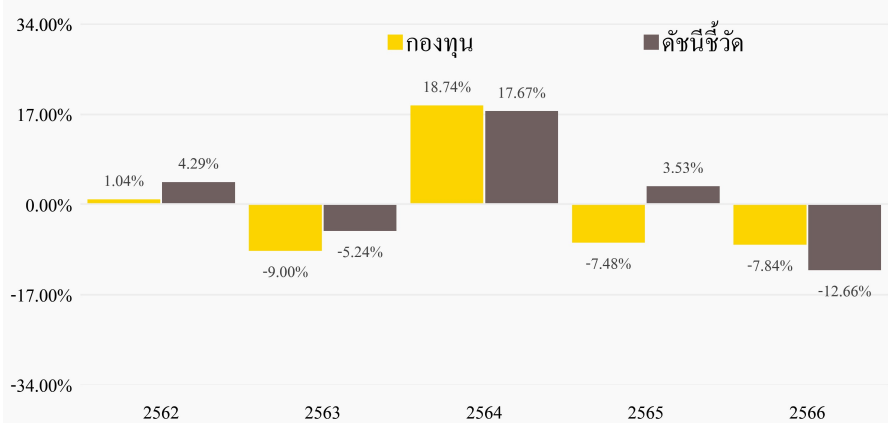
### ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนตราสารทุน/ กองทุนรวมหุ้นระยะยาว
- กองทุนรวมที่ลงทุนแบบมีความเสี่ยงทั้งในและต่างประเทศ
- กลุ่มกองทุนรวม : Miscellaneous

### นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- ลงทุนในหุ้นสามัญจดทะเบียน หรือสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่อ้างอิงกับผลตอบแทนของหุ้นหรือกลุ่มหุ้นของบริษัทจดทะเบียน โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่า 65% ของ NAV
- ลงทุนในกองทุนรวม iShares Core MSCI World UCITS ETF ประมาณ 30% ของ NAV ซึ่งสร้างผลตอบแทนให้ใกล้เคียงกับการลงทุนในหุ้นของบริษัทฯประเทศพัฒนาแล้วทั่วโลก
- กองทุนอาจจะเข้าทำสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) เพื่อเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน (Efficient Portfolio Management) ซึ่งรวมถึงการป้องกันความเสี่ยง (Hedging) จากการลงทุน
- กองทุนมุ่งหวังให้ผลประกอบการสูงกว่าดัชนีชี้วัด (Active management)
- ป้องกันความเสี่ยงอัตราแลกเปลี่ยนตามดุลยพินิจของผู้จัดการกองทุน

### ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (% ต่อปี)



\* ในปีที่กองทุนจัดตั้ง ผลการดำเนินงานจะแสดงตั้งแต่วันที่จัดตั้งจนถึงสิ้นปีปฏิทิน

### ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด (% ต่อปี)

|                          | YTD    | 3 เดือน | 6 เดือน        | 1 ปี * |
|--------------------------|--------|---------|----------------|--------|
| กองทุน                   | -7.84  | -1.29   | -3.93          | -7.84  |
| ดัชนีชี้วัด              | -12.66 | -3.44   | -4.79          | -12.66 |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน | N/A    | N/A     | N/A            | N/A    |
| ความผันผวนกองทุน         | 10.65  | 11.63   | 10.39          | 10.65  |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด    | 11.75  | 13.23   | 11.74          | 11.75  |
| 3 ปี *                   | 5 ปี * | 10 ปี * | ตั้งแต่จัดตั้ง |        |
| กองทุน                   | 0.42   | -1.42   | N/A            | -0.98  |
| ดัชนีชี้วัด              | 2.09   | 1.01    | N/A            | 2.34   |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน | N/A    | N/A     | N/A            | N/A    |
| ความผันผวนกองทุน         | 10.54  | 13.75   | N/A            | 12.53  |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด    | 11.62  | 16.66   | N/A            | 14.90  |

\* ผลตอบแทนที่มีอายุเกินหนึ่งปีจะแสดงผลตอบแทนต่อปี

ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกันตามกลุ่ม Miscellaneous

### ระดับความเสี่ยง



ลงทุนในตราสารทุนเป็นหลักโดยเฉลี่ยในรอบปีไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV

### ข้อมูลกองทุนรวม

|                        |                     |
|------------------------|---------------------|
| วันจดทะเบียนกองทุน     | 23 พฤศจิกายน 2559   |
| นโยบายการจ่ายเงินปันผล | จ่าย                |
| อายุกองทุน             | ไม่จำกัดอายุโครงการ |

### ผู้จัดการกองทุนรวม

นาย กวิพ เจริญเสาวภาคย์ (1 มกราคม 2564)

นาย ชาติ โชคทวีพัฒนา (1 ตุลาคม 2564)

### ดัชนีชี้วัด

ดัชนีผลตอบแทนรวมตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET TRI)

### คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวมมิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต: ได้รับการรับรองจาก CAC

จัดอันดับกองทุน Morningstar ★★ (ข้อมูล ณ 31 ม.ค. 2563)

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือบริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่องได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

www.krungsriasset.com

การซื้อขายหน่วยลงทุน

วันทำการซื้อ: ปิดรับรายการตั้งแต่ 2 ม.ค. 63 เป็นต้นไป

เวลาทำการ: 08:30 น. - 15:30 น.

การซื้อขายครั้งแรกขั้นต่ำ: -

การซื้อขายครั้งถัดไปขั้นต่ำ: -

การขายคืนหน่วยลงทุน

วันทำการขายคืน: ทุกวันทำการของธนาคาร

เวลาทำการ: 08:30 น. - 15:30 น.

การขายคืนขั้นต่ำ: ไม่มี

ยอดคงเหลือขั้นต่ำ: ไม่มี

ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน: ภายใน 5 วันทำการ

นับถัดจากวันทำการขายคืน โดยทั่วไปจะได้

รับเงิน 3 วันทำการนับถัดจากวันทำการขายคืน

(T+3)

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปี ของ NAV)

|               |               |          |
|---------------|---------------|----------|
| ค่าธรรมเนียม  | สูงสุดไม่เกิน | เก็บจริง |
| การจัดการ     | 2.6750        | 1.6585   |
| รวมค่าใช้จ่าย | 5.0825        | 1.8514   |

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)

|                                             |               |                                |
|---------------------------------------------|---------------|--------------------------------|
| ค่าธรรมเนียม                                | สูงสุดไม่เกิน | เก็บจริง                       |
| การขาย                                      | 1.50          | ไม่เรียกเก็บ                   |
| การรับซื้อคืน                               | 1.50          | ไม่เรียกเก็บ                   |
| การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า                 | 1.50          | ไม่เรียกเก็บ                   |
| การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก                  | 1.50          | ไม่เรียกเก็บ                   |
| การโอนหน่วย                                 | ไม่มี         | ไม่มี                          |
| ค่าปรับกรณีขายคืนและสับเปลี่ยนออก           | 0.50          | 0.50                           |
| ก่อนระยะเวลาที่กำหนด                        |               | กรณีถือหน่วยลงทุนน้อยกว่า 3 ปี |
| ค่าใช้จ่ายในการซื้อขายหลักทรัพย์            | 0.50          | 0.15                           |
| เมื่อมีการสั่งซื้อ ขาย สับเปลี่ยนหน่วยลงทุน |               |                                |

หมายเหตุ

- ค่าธรรมเนียมดังกล่าวเป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว

- ไม่เปิดให้สับเปลี่ยนจาก LTF ทุกกองทุน ไปยังกองทุน LTF ที่มีการแบ่งชนิดหน่วยลงทุนเป็น class A, D ในกรณีที่ระยะเวลาถือครองหน่วยลงทุนของกองทุนต้นทางไม่เป็นไปตามเงื่อนไขของสิทธิประโยชน์ทางภาษีที่ทางการประกาศกำหนด เฉพาะช่องทางการทำการขายผ่านระบบอินเทอร์เน็ตเท่านั้น

ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก

|                                             |       |
|---------------------------------------------|-------|
| Holding                                     | % NAV |
| iShares Core MSCI World UCITS ETF USD (Acc) | 23.02 |
| บมจ.ซีพี ออลล์                              | 6.20  |
| บมจ.ท่าอากาศยานไทย                          | 5.35  |
| บมจ.เอสซีบี เอกซ์                           | 4.71  |
| บมจ.เงินดิจิตอล                             | 3.17  |

การลงทุนในกองทุนอื่นเกินกว่า 20% (กองในประเทศและกองต่างประเทศ)

ชื่อกอง : iShares Core MSCI World UCITS ETF

ISIN code : IE00B4L5Y983

Bloomberg code : NDDUWI

ข้อมูลเชิงสถิติ

|                            |                     |
|----------------------------|---------------------|
| Maximum Drawdown           | -37.60 %            |
| Recovering Period          | 1 ปี 7 เดือน 19 วัน |
| FX Hedging                 | 93.64 %             |
| อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน | 90.45 %             |
| Sharpe Ratio               | -0.05               |
| Alpha                      | -1.67 %             |
| Beta                       | 0.77                |
| Tracking Error             | N/A                 |

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน (% NAV)

|                                                  |       |
|--------------------------------------------------|-------|
| ตราสารทุนและหน่วยลงทุน                           | 75.23 |
| หน่วย CIS                                        | 23.02 |
| ทรัพย์สินอื่น                                    | 4.68  |
| เงินฝาก หรือตราสารหนี้ที่สถาบันการเงินเป็นผู้ออก | 0.96  |
| หนี้สินอื่น                                      | -3.90 |

การจัดสรรการลงทุนในต่างประเทศ (% NAV)

|                |       |
|----------------|-------|
| United States  | 25.82 |
| Japan          | 2.26  |
| United Kingdom | 1.45  |
| France         | 1.21  |
| Canada         | 1.17  |

การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม (% NAV)

|                               |      |
|-------------------------------|------|
| หมวดธนาคาร                    | 9.12 |
| หมวดอาหารและเครื่องดื่ม       | 9.11 |
| หมวดขนส่งและโลจิสติกส์        | 9.00 |
| หมวดพาณิชย์                   | 8.81 |
| หมวดการท่องเที่ยวและสันทนาการ | 7.02 |

## คำอธิบาย

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

**Recovering Period** ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาดังแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลานานเท่าใด

**FX Hedging** เปรี่เซ้นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

**อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน** ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตกองทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลาหนึ่ง 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** 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 โซนเอ ชั้น 12 ชั้น 18 โซนบี

ถนนเพลินจิต แขวงลุมพินี เขตปทุมวัน กรุงเทพฯ 10330

โทรศัพท์ 0-2657-5757 โทรสาร 0-2657-5777

เว็บไซต์: www.krungsriasset.com