

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด

ข้อมูล ณ วันที่ 28 ธันวาคม 2566

การลงทุนใน LTF ตั้งแต่ 1 ม.ค. 63 เป็นต้นไป ผู้ลงทุนไม่สามารถนำมาลดหย่อนภาษีได้

กองทุนเปิดกรุงศรีหุ้นระยะยาวปันผล

หน่วยลงทุนชนิดหุ้นระยะยาว
KFLTFDIV

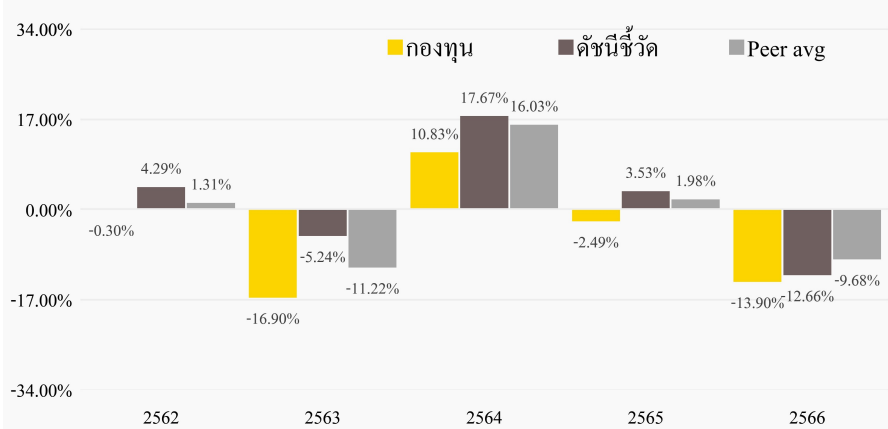
ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนตราสารทุน/ กองทุนรวมหุ้นระยะยาว
- กองทุนรวมที่เน้นลงทุนแบบไม่มีความเสี่ยงในต่างประเทศ
- กลุ่มกองทุนรวม : Equity Large Cap

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- ลงทุนในหุ้นสามัญของบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่า 75% ของ NAV โดยเน้นลงทุนในหุ้นที่มีแนวโน้มจ่ายเงินปันผลดี
- ส่วนที่เหลือจะลงทุนในตราสารหนี้ภาครัฐ สถาบันการเงิน บริษัทเอกชน หรือเงินฝากธนาคาร
- กองทุนมุ่งหวังให้ผลประกอบการสูงกว่าดัชนีชี้วัด (Active management)

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (% ต่อปี)



* ในปีที่กองทุนจัดตั้ง ผลการดำเนินงานจะแสดงตั้งแต่วันที่จัดตั้งจนถึงสิ้นปีปฏิทิน

ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด (% ต่อปี)

	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี *
กองทุน	-13.90	-3.16	-4.44	-13.90
ดัชนีชี้วัด	-12.66	-3.44	-4.79	-12.66
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	-9.68	-2.89	-3.21	-9.68
ความผันผวนกองทุน	12.10	12.95	12.23	12.10
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	11.75	13.23	11.74	11.75
	3 ปี *	5 ปี *	10 ปี *	ตั้งแต่จัดตั้ง
กองทุน	-2.38	-5.07	-0.61	6.61
ดัชนีชี้วัด	2.09	1.01	4.03	8.05
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	2.20	-1.09	2.31	N/A
ความผันผวนกองทุน	11.76	16.51	14.30	15.34
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	11.62	16.66	14.60	18.52

* ผลตอบแทนที่มีอายุเกินหนึ่งปีจะแสดงผลตอบแทนต่อปี
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกันตามกลุ่ม Equity Large Cap

ระดับความเสี่ยง



ลงทุนในตราสารทุนเป็นหลักโดยเฉลี่ยในรอบปี
ไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน	17 พฤศจิกายน 2547
วันเริ่มต้น class	17 พฤศจิกายน 2547
นโยบายการจ่ายเงินปันผล	จ่าย
อายุกองทุน	ไม่จำกัดอายุโครงการ

ผู้จัดการกองทุนรวม

นาย ชลิต โชคทิพย์พัฒนา (1 ตุลาคม 2564)

นาย สาธิต บัวชู (30 ตุลาคม 2563)

ดัชนีชี้วัด

ดัชนีผลตอบแทนรวมตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย
(SET TRI)

คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวมมิได้เป็น
สิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต: ได้รับการรับรองจาก CAC

จัดอันดับกองทุน Morningstar ★ (ข้อมูล ณ 30 พ.ย. 2566)

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือ
บริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่อง
ได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

www.krungsriasset.com

การซื้อขายหน่วยลงทุน วันทำการซื้อ: ปิดรับรายการซื้อ/สับเปลี่ยนเข้าจากกองทุนอื่นที่มีใช้ LTF เวลาทำการ: 08:30 น. - 15:30 น. การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ: 500 บาท การซื้อครั้งถัดไปขั้นต่ำ: 500 บาท	การขายคืนหน่วยลงทุน วันทำการขายคืน: ทุกวันทำการของธนาคาร เวลาทำการ: 08:30 น. - 15:30 น. การขายคืนขั้นต่ำ: ไม่มี ยอดคงเหลือขั้นต่ำ: ไม่กำหนด ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน: ภายใน 4 วันทำการนับถัดจากวันทำการขายคืน โดยทั่วไปจะได้รับเงิน 3 วันทำการนับถัดจากวันทำการขายคืน (T+3)
---	--

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปี ของ NAV)		
ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	2.1400	2.1400
รวมค่าใช้จ่าย	2.3754	2.3323

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)		
ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การขาย	0.25	ไม่เรียกเก็บ
การรับซื้อคืน	0.50	0.50 กรณีถือหน่วยลงทุนน้อยกว่า 3 ปี
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า	0.25	ไม่เรียกเก็บ
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก	0.25	0.25 กรณีถือหน่วยลงทุนน้อยกว่า 3 ปี
การโอนหน่วย	ไม่มี	ไม่มี

หมายเหตุ

- ค่าธรรมเนียมดังกล่าวเป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว
- บริษัทจัดการจะไม่เรียกเก็บค่าธรรมเนียมการสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนระหว่างชนิดหน่วยลงทุนภายใต้กองทุนนี้ ทั้งนี้เงื่อนไขเป็นไปตามที่บริษัทจัดการกำหนด
- ไม่เปิดให้สับเปลี่ยนจาก LTF ทุกกองทุน ไปยังกองทุน LTF ที่มีการแบ่งชนิดหน่วยลงทุนเป็น class A, D ในกรณีที่ระยะเวลาถือครองหน่วยลงทุนของกองทุนต้นทางไม่เป็นไปตามเงื่อนไขของสิทธิประโยชน์ทางภาษีที่ทางการประกาศกำหนด เฉพาะช่องทางการทำการขายผ่านระบบอินเทอร์เน็ตเท่านั้น

ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก	
Holding	% NAV
บมจ.เอสซีบี เอกซ์	6.23
บมจ.แอดวานซ์ อินโฟร์ เซอร์วิส	4.68
บมจ.ซีพี ออลล์	4.54
บมจ.ปตท.	4.37
บมจ.ปตท.สำรวจ และผลิตปิโตรเลียม	3.90

ข้อมูลเชิงสถิติ	
Maximum Drawdown	-40.34 %
Recovering Period	0.00
FX Hedging	ยังไม่มีการลงทุนในต่างประเทศ
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน	47.89 %
Sharpe Ratio	-0.29
Alpha	-4.47 %
Beta	1.01
Tracking Error	N/A

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน (% NAV)	
ตราสารทุนและหน่วยลงทุน	98.70
เงินฝาก หรือตราสารหนี้ที่สถาบันการเงินเป็นผู้ออก	1.41
ทรัพย์สินอื่น	0.25
หนี้สินอื่น	-0.35

การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม (% NAV)	
หมวดพลังงานและสาธารณูปโภค	19.09
หมวดธนาคาร	15.71
หมวดพาณิชย์	12.13
หมวดพัฒนาอสังหาริมทรัพย์	10.26
หมวดเทคโนโลยีสารสนเทศและการสื่อสาร	7.65

คำอธิบาย

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

Recovering Period ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาดังแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลานานเท่าใด

FX Hedging เปรอ์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

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