

กองทุนเปิดกรุงไทยตราสารหนี้ระยะ 1 ถึง 3 ปี

Krung Thai 1Y-3Y Fixed Income Fund

KTFIX-1Y3Y

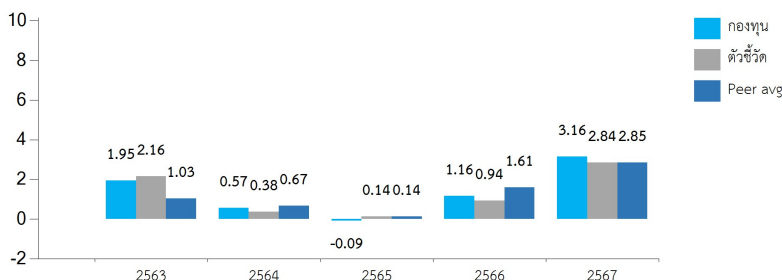
ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมตราสารหนี้
- กลุ่ม Mid Term General Bond

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- กองทุนจะลงทุนในหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินในประเทศที่เกี่ยวข้องกับตราสารหนี้ เงินฝาก และ/หรือตราสารทางการเงิน ที่บริษัทจัดการพิจารณาแล้วเห็นว่าเป็นตราสารหนี้ที่มีคุณภาพ และให้ผลตอบแทนที่เหมาะสมกับความเสี่ยง
- กองทุนมีนโยบายที่จะจัดการลงทุนเพื่อให้อายุเฉลี่ยของพอร์ต (Portfolio Duration) อยู่ระหว่าง 1 ถึง 3 ปีโดยประมาณ
- มุ่งหวังให้ผลประโยชน์สูงกว่าดัชนีชี้วัด (active management)

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (%ต่อปี)



ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด

	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี*	3 ปี*	5 ปี*	10 ปี*	ตั้งแต่จัดตั้ง*
กองทุน	3.51	1.66	2.94	4.79	2.80	1.86	1.90	2.12
ดัชนีชี้วัด	2.79	1.15	2.22	3.81	2.42	1.56	1.88	2.19
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	3.43	1.59	2.80	4.59	2.81	1.94	1.79	
ความผันผวนกองทุน	0.75	0.67	0.78	0.70	0.63	0.65	0.70	0.69
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	0.51	0.43	0.53	0.47	0.50	0.55	0.51	0.51

หมายเหตุ : * % ต่อปี

ระดับความเสี่ยง

ต่ำ 1 2 3 4 5 6 7 8 สูง

เสี่ยงปานกลางค่อนข้างต่ำ

*ความเสี่ยงของกองทุน ระดับ 4 หมายถึง กองทุนรวมตราสารหนี้ ที่มี net exposure ในเงินฝากหรือตราสารเทียบเท่า เงินฝากหรือตราสารหนี้ทั่วไปในขณะใด ๆ ไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน 08/01/57

วันเริ่มต้น class N/A

นโยบายการจ่ายเงินปันผล ไม่มี

อายุกองทุน ไม่กำหนด

ผู้จัดการกองทุนรวม

น.ส. ดวงพร จงศรีสาท ตั้งแต่ 01/09/66

ดัชนีชี้วัด

1. ผลตอบแทนรวมสุทธิของดัชนีพันธบัตรรัฐบาล Mark-to-Market อายุ 1 - 3 ปี ของสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย (70%)
2. ผลตอบแทนรวมสุทธิของดัชนีตราสารหนี้ภาคเอกชน Mark to Market ที่มีอันดับความน่าเชื่อถือของผู้ออกตราสารอยู่ในระดับ A- ขึ้นไป อายุ 1-3 ปี ของสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย:(30%)

คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวม มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต : ได้รับการรับรองจาก CAC

จัดอันดับกองทุน



หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



www.ktam.co.th

ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือบริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่องได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

การซื้อขายหน่วยลงทุน	การขายคืนหน่วยลงทุน
วันทำการซื้อ : ทุกวันทำการ	วันทำการขายคืน : ทุกวันทำการ
เวลาทำการ : 8:30 - 15:30	เวลาทำการ : 8:30 - 15:30
การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ : ไม่กำหนด	การขายคืนขั้นต่ำ : ไม่กำหนด
การซื้อครั้งถัดไปขั้นต่ำ : ไม่กำหนด	ยอดคงเหลือขั้นต่ำ : ไม่กำหนด
ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน : T+1 คือ 1 วันทำการหลังจากวันทำการขายคืน	

หมายเหตุ : ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืนจะไม่เกิน 5 วันทำการนับตั้งแต่วันถัดจากวันรับซื้อคืนหน่วยลงทุน

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)		
ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	0.8025	0.4013
รวมค่าใช้จ่าย	1.6050	0.5758

หมายเหตุ : *เป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะ หรือภาษีอื่นใดในทำนองเดียวกัน (ถ้ามี)
ค่าการจัดการเรียกเก็บจริง คือ 0.40125 *รวมค่าใช้จ่าย (เก็บจริง) เป็นของรอบบัญชีที่ผ่านมา

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)		
ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การขาย	1.000	ยังไม่เรียกเก็บ
การรับซื้อคืน	1.000	ยังไม่เรียกเก็บ
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า	1.000	ยังไม่เรียกเก็บ
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก	1.000	ยังไม่เรียกเก็บ
การโอนหน่วย	ดูหมายเหตุเพิ่มเติม	ดูหมายเหตุเพิ่มเติม

หมายเหตุ : *ค่าธรรมเนียมข้างต้นเป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะ หรือภาษีอื่นใดในทำนองเดียวกัน **ค่าธรรมเนียมการโอนหน่วย ตามที่นายทะเบียนเรียกเก็บ

ข้อมูลเชิงสถิติ	
Maximum Drawdown	-2.27 %
Recovering Period	1 ปี 6 เดือน
FX Hedging	N/A
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน	0.82 เท่า
อายุเฉลี่ยของตราสารหนี้	2 ปี 10 เดือน 11 วัน
Yield to Maturity	1.71

การจัดสรรการลงทุนในผู้ออกตราสาร 5 อันดับแรก	
ผู้ออก	% NAV
กระทรวงการคลัง	51.17
บมจ. ซีพีเอฟ (ประเทศไทย)	4.67
บมจ. เบอร์ลี่ ยุคเกอร์	4.11
บมจ. เงินดีดล้อ	4.03
บมจ. บ้านปู	3.52

หมายเหตุ :

การจัดสรรการลงทุนตามอันดับความน่าเชื่อถือ(%)			
	ในประเทศ	National	International
Gov bond/AAA	51.35		
AA	10.57		
A	28.66		
BBB	9.18		
ต่ำกว่า BBB			
Unrated/non			

หมายเหตุ :

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน		ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก	
ทรัพย์สิน	% NAV	ทรัพย์สิน	% NAV
พันธบัตรรัฐบาล	50.72	พันธบัตรรัฐบาลเพื่อการบริหารหนี้ ในปีงบประมาณ พ.ศ. 2566 17/03/2027	8.47
หุ้นกู้	43.35	พันธบัตรรัฐบาลเพื่อการบริหารหนี้ ในปีงบประมาณ พ.ศ. 2564 17/06/2027	8.24
ตัวแลกเงิน	5.06	พันธบัตรรัฐบาล ในปีงบประมาณ พ.ศ. 2568 17/04/2028	8.13
เงินฝากธนาคาร	0.77	พันธบัตรรัฐบาลเพื่อการบริหารหนี้ให้กู้ต่อในปีงบประมาณ พ.ศ. 2559 17/12/2026	6.33
ตัวเงินค้ำ	0.46	พันธบัตรรัฐบาลเพื่อการบริหารหนี้ ในปีงบประมาณ พ.ศ. 2567 17/11/2027	3.96
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย	0.18		
สินทรัพย์และหนี้สินอื่นๆ	-0.54		

หมายเหตุ :

หมายเหตุ :

คำอธิบาย

Maximum Drawdown เพอร์เซ็นต์ผลขาดทุนสูงสุดของกองทุนรวมในระยะเวลา 5 ปีย้อนหลัง (หรือตั้งแต่จัดตั้งกองทุนกรณีที่ยังไม่ครบ 5 ปี) โดยวัดจากระดับ NAV ต่อหน่วยที่จุดสูงสุด ไปจนถึงจุดต่ำสุดในช่วงที่ NAV ต่อหน่วยปรับตัวลดลงค่า Maximum Drawdownเป็นข้อมูลที่ช่วยให้ทราบถึงความเสี่ยงที่อาจจะขาดทุนจากการลงทุนในกองทุนรวม

Recovering Period ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาดังแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลานานเท่าใด

FX Hedging เพอร์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลาหนึ่ง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์กับ ผลรวมของมูลค่าการขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 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 ซึ่งเป็นผลจากประสิทธิภาพของผู้จัดการกองทุนในการคัดเลือกหรือหาจังหวะเข้าลงทุนในหลักทรัพย์ได้อย่างเหมาะสม

Beta ระดับและทิศทางการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุน โดยเปรียบเทียบกับอัตราการเปลี่ยนแปลงของตลาด Beta น้อยกว่า 1 แสดงว่า หลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนน้อยกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด Beta มากกว่า 1 แสดงว่า หลักทรัพย์ ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนมากกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด

Tracking Error อัตราผลตอบแทนของกองทุนมีประสิทธิภาพในการเลียนแบบดัชนีชี้วัด โดยหาก tracking error ต่ำ หมายถึงกองทุนรวมมีประสิทธิภาพในการสร้างผลตอบแทนให้ใกล้เคียงกับดัชนีชี้วัด กองทุนรวมที่มีค่า tracking error สูง จะมีอัตราผลตอบแทนโดยเฉลี่ยห่างจากดัชนีชี้วัดมากขึ้น

Yield to Maturity อัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในตราสารหนี้โดยถือจนครบกำหนดอายุ ซึ่งคำนวณจากดอกเบี้ยที่จะได้รับในอนาคตตลอดอายุตราสารและเงินต้นที่จะได้รับคืน นำมาคิดลดเป็นมูลค่าปัจจุบัน โดยใช้วัดอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมตราสารหนี้ คำนวณจากค่าเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักของ Yield to Maturity ของตราสารหนี้แต่ละตัวที่กองทุนมีการลงทุน และเนื่องจาก Yield to Maturity มีหน่วยมาตรฐานเป็นเปอร์เซ็นต์ต่อปีจึงสามารถนำไปใช้เปรียบเทียบอัตราผลตอบแทนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีนโยบายถือครอง ตราสารหนี้จนครบกำหนดอายุและมีลักษณะการลงทุนที่ใกล้เคียงกันได้

ข้อมูล Morningstar Rating ณ วันที่ 31/08/2568

© สงวนลิขสิทธิ์ 2568 บริษัท มอร์นิ่งสตาร์ รีเสิร์ช ประเทศไทย ข้อมูลนี้ (1) เป็นกรรมสิทธิ์ของบริษัทมอร์นิ่งสตาร์ และ/หรือ ผู้ให้บริการข้อมูล (2) ของสงวนสิทธิ์ในการลอกเลียน หรือเผยแพร่ (3) ของสงวนสิทธิ์ที่จะไม่รับผิดชอบต่อความถูกต้อง ครบถ้วน และความเสียหายต่างๆ ที่เกิดขึ้นทุกกรณีจากการนำข้อมูลไปใช้อ้างอิง, ผลการดำเนินงานในอดีตมิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต.

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงไทย จำกัด (มหาชน)

โทรศัพท์ 0-2686-6100 แฟกซ์ 0-2670-0430 www.ktam.co.th

เลขที่ 1 อาคารเอ็มไพร์ทาวเวอร์ ชั้น 32 ถนนสาทรใต้ แขวงยานนาวา เขตสาทร กรุงเทพมหานคร 10120