



กองทุนรวมเพื่อความยั่งยืน

กองทุนเปิดกรุงศรีโกลบอลไดนามิคแอกเกรสซีฟอโลเคชั่นเอสอาร์ไอ-สะสมมูลค่า

หน่วยลงทุนชนิดสะสมมูลค่า

KFGDA-A

ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมผสม / กองทุนรวมฟีดเดอร์ (Feeder Fund) / กองทุนรวมเพื่อความยั่งยืน (SRI Fund) / กองทุนรวมที่มีนโยบายเปิดให้มีการลงทุนในกองทุนรวมอื่นภายใต้ บลจ. เดียวกัน (Cross Investing Fund)
- กองทุนรวมที่เน้นลงทุนแบบมีความเสี่ยงต่างประเทศ
- กลุ่ม Foreign Investment Allocation

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- ลงทุนในกองทุนรวมต่างประเทศชื่อ Allianz Dynamic Multi Asset Strategy SRI 75, Class P (EUR) (กองทุนหลัก) โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของ NAV
- กองทุนหลักมีนโยบายลงทุนในทรัพย์สินหลากหลายประเภท โดยมุ่งเน้นการลงทุนในตราสารทุน ตราสารหนี้ และตราสารในตลาดเงินทั่วโลก เพื่อสร้างผลตอบแทนในระยะปานกลางที่ใกล้เคียงกับพอร์ตการลงทุนแบบสมดุล โดยมีค่าความผันผวนอยู่ในช่วง 10% ถึง 16% และสอดคล้องกับกลยุทธ์การลงทุนเพื่อความยั่งยืน (SRI Strategy) โดยเน้นการลงทุนในทรัพย์สินที่ส่งเสริมคุณลักษณะทางด้านสิ่งแวดล้อม และ/หรือ สังคม และธรรมาภิบาลเป็นหลัก
- บริษัทที่บริหารจัดการกองทุนหลัก คือ Allianz Global Investors GmbH
- กองทุนอาจลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมภายใต้การจัดการของบริษัทจัดการในสัดส่วนไม่เกินร้อยละ 20 ของ NAV
- กองทุนอาจลงทุนในตราสารที่มีสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Structured Note) และ/หรือ สัญญาซื้อขายล่วงหน้าเพื่อเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน (Efficient Portfolio Management) โดยขึ้นอยู่กับดุลยพินิจของผู้จัดการกองทุน
- ป้องกันความเสี่ยงอัตราแลกเปลี่ยนตามดุลยพินิจของผู้จัดการกองทุน
- กองทุนไทยมุ่งหวังให้ผลประกอบการเคลื่อนไหวตามกองทุนหลัก โดยกองทุนหลักมีการบริหารจัดการแบบ SRI Strategy ที่มีการบริหารจัดการเชิงรุกโดยไม่มีการอ้างอิงดัชนีชี้วัด (Active management)

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (%) ต่อปี

- ยังไม่มีข้อมูล -

ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปีกมุด (%) ต่อปี

- ยังไม่มีข้อมูล -

ระดับความเสี่ยง

ต่ำ	1	2	3	4	5	6	7	8	สูง
-----	---	---	---	---	---	---	---	---	-----

เสี่ยงสูง

ลงทุนในตราสารทุน ตราสารหนี้ และ/หรือทรัพย์สินทางเลือก โดยมีสัดส่วนการลงทุนในตราสารทุนไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน:	27 กันยายน 2567
วันเริ่มต้น class	27 กันยายน 2567
นโยบายการจ่ายเงินปันผล:	ไม่จ่าย
อายุกองทุน:	ไม่กำหนด

ผู้จัดการกองทุนรวม

นายจาตุรนต์ สอนไว	ตั้งแต่วันที่ 27 กันยายน 2567
นายชูศักดิ์ อวยพรชัยสกุล	ตั้งแต่วันที่ 27 กันยายน 2567

ดัชนีชี้วัด :

กองทุนไม่มีดัชนีชี้วัดด้านความยั่งยืนที่สอดคล้องกับการลงทุน โดยเป็นไปตามกองทุนหลักที่มีการบริหารกองทุนแบบ SRI Strategy ซึ่งไม่มีการอ้างอิงดัชนีชี้วัด

คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวมมิได้เป็นที่ยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต: ได้รับการรับรองจาก CAC

“ผู้ลงทุนสามารถศึกษา
เครื่องมือบริหารความเสี่ยงด้าน
สภาพคล่องได้ในหนังสือชี้ชวน
ฉบับเต็ม”

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



การซื้อขายหน่วยลงทุน	การขายคืนหน่วยลงทุน
วันทำการซื้อ: <ul style="list-style-type: none"> ช่วง IPO: 19 - 25 กันยายน 2567 ภายในเวลา 15.30 น. ของวันสุดท้าย ทั้งนี้ จะรับชำระเป็นเช็คจนถึงวันที่ 25 กันยายน 2567 หลัง IPO: เริ่มตั้งแต่วันที่ 1 ตุลาคม 2567 เป็นต้นไป ทุกวันทำการซื้อขายของกองทุน 	วันทำการขายคืน: เริ่มตั้งแต่วันที่ 1 ตุลาคม 2567 ทุกวันทำการซื้อขายของกองทุน
เวลาทำการ: 8.30 - 15.30 น.	เวลาทำการ: 8.30 - 15.30 น.
การซื้อครั้งแรก ขั้นต่ำ: 500 บาท	การขายคืนขั้นต่ำ: 500 บาท หรือ 50 หน่วย
การซื้อครั้งถัดไป ขั้นต่ำ: 500 บาท	ยอดคงเหลือขั้นต่ำ: 50 หน่วย
	ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน : ภายใน 6 วันทำการนับถัดจากวันทำการซื้อขายคืน โดยทั่วไปจะได้รับเงิน 3 วันทำการนับถัดจากวันทำการขายคืน (T+3)

ข้อมูลเชิงสถิติ

Maximum Drawdown	-
Recovering Period	-
Fx Hedging	-
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน	-
Sharpe Ratio	-
Alpha	-
Beta	-
Tracking Error	-

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	2.1400	1.0165
รวมค่าใช้จ่าย	4.6545	1.2091

หมายเหตุ:

- หากกองทุนลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมภายใต้การจัดการเดียวกัน (กองทุนปลายทาง) บริษัทจัดการจะไม่เรียกเก็บค่าธรรมเนียมการจัดการซ้ำซ้อนกับกองทุนปลายทาง
- กองทุนหลักคืน (rebate) ค่าธรรมเนียมการจัดการ (ตามอัตราที่ตกลงกันระหว่างบริษัทจัดการและกองทุนหลัก) ให้แก่กองทุนไทย โดยเก็บเข้าเป็นทรัพย์สินของกองทุน

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การขาย	2.00	1.50
การรับซื้อคืน	2.00	ยังไม่เรียกเก็บ
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า	2.00	1.50
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก	2.00	ยังไม่เรียกเก็บ
การโอนหน่วย	10 บาทต่อ 1,000 หน่วย	10 บาทต่อ 1,000 หน่วย

หมายเหตุ:

- ค่าธรรมเนียมหรือค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม และ/หรือผู้สั่งซื้อหรือผู้ถือหน่วยลงทุนข้างต้น เป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่มหรือภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว
- หากกองทุนลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมภายใต้การจัดการเดียวกัน บริษัทจัดการจะไม่เรียกเก็บค่าธรรมเนียมการขาย และ/หรือรับซื้อคืนหน่วยลงทุนซ้ำซ้อน
- บริษัทจัดการขอสงวนสิทธิในการยกเว้นโดยไม่เรียกเก็บค่าธรรมเนียมการสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนระหว่างชนิดหน่วยลงทุนภายใต้กองทุนนี้ โดยขึ้นอยู่กับดุลยพินิจของบริษัทจัดการ
- บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ
- บริษัทจัดการอาจยกเว้นไม่เรียกเก็บค่าธรรมเนียมการโอนหน่วยลงทุน โดยขึ้นอยู่กับดุลยพินิจของบริษัทจัดการ

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน*

Breakdown	% NAV
หน่วย CIS	80.00
อื่นๆ	20.00

ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก*

Holding	% NAV
Allianz Dynamic Multi Asset Strategy SRI 75	80.00
อื่นๆ	20.00

หมายเหตุ: * ข้อมูลการลงทุนและสัดส่วนการลงทุนดังกล่าว เป็นเพียงคาดการณ์การลงทุน ซึ่งอาจเปลี่ยนแปลงได้

การจัดสรรการลงทุนในต่างประเทศของกองทุนหลัก

- ไม่มีข้อมูล -

การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรมของกองทุนหลัก

- ไม่มีข้อมูล -

ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรกของกองทุนหลัก

Holding	% NAV
NVIDIA CORP	3.41
ALLIANZ COMMODITIES-I EUR	3.27
MICROSOFT CORP	3.02
S ST SUST CL EM EN EQ F-IUSD	2.37
AMAZON.COM INC	2.33

ข้อมูลกองทุนหลัก ณ วันที่ 30 มิถุนายน 2567

การลงทุนในกองทุนอื่นเกินกว่า 20% (กองในประเทศ และหรือกองต่างประเทศ)

ชื่อกองทุน: Allianz Dynamic Multi Asset Strategy SRI 75, Class P (EUR)

ISIN code: LU1575694655

Bloomberg code: ADMA75P LX

ข้อมูลอื่นๆ

- ผู้ลงทุนสามารถซื้อกรรมสิทธิ์ประกันชีวิตควบหน่วยลงทุน (Unit-Linked) ของกองทุนนี้ได้โดยติดต่อกับบริษัทประกันชีวิตที่บริษัทจัดการกำหนด ทั้งนี้ การซื้อกรรมสิทธิ์ประกันชีวิตควบหน่วยลงทุนอาจมีข้อกำหนดและวิธีปฏิบัติที่แตกต่างไปจากผู้ถือหน่วยลงทุนปกติที่ซื้อขายหน่วยลงทุนของกองทุนนี้ เพียงอย่างเดียว ผู้ลงทุนจึงควรศึกษารายละเอียดในเอกสารประกอบการขายกรรมสิทธิ์ประกันชีวิตควบหน่วยลงทุนให้เข้าใจก่อนการตัดสินใจลงทุน
- บริษัทจัดการจะปฏิบัติตามกฎเกณฑ์ของกองทุนหลักโดยรายงานการถือครองหน่วยลงทุนตั้งแต่ร้อยละ 10 ของจำนวนหน่วยลงทุนที่จำหน่ายได้แล้วทั้งหมดของกองทุนให้กับผู้มีอำนาจหน้าที่ของกองทุนหลัก และอาจนำเสนอข้อมูลส่วนตัวของผู้ถือหน่วยลงทุนดังกล่าวเช่น สำเนาบัตรประจำตัวประชาชนและ/หรือสำเนาหนังสือเดินทาง เป็นต้น และ/หรือขอข้อมูลหรือเอกสารเพิ่มเติมอื่นใดจากผู้ถือหน่วยลงทุนในภายหลังก็ได้ เพื่อให้เป็นไปตามที่กองทุนหลักร้องขอ หากผู้ถือหน่วยลงทุนรายใดปฏิเสธการให้ข้อมูลหรือเอกสารเพิ่มเติมดังกล่าวหรือมีพฤติกรรมเข้าข่ายและ/หรือมีความผิดตามกฎหมายอันมีผลทำให้บริษัทจัดการไม่สามารถปฏิบัติตามกฎเกณฑ์ของกองทุนหลักได้ บริษัทจัดการขอสงวนสิทธิ์ที่จะระงับหรือหยุดให้บริการและดำเนินการคืนเงินลงทุนตามมูลค่าหน่วยลงทุนให้แก่ผู้ถือหน่วยลงทุน โดยถือว่าได้รับความเห็นชอบจากผู้ถือหน่วยลงทุนแล้ว ทั้งนี้ ผู้ถือหน่วยลงทุนจะไม่สามารถนำเรื่องดังกล่าวมาใช้เป็นสิทธิเรียกร้องความเสียหายจากเหตุดังกล่าวจากบริษัทจัดการได้แต่อย่างใด

คำอธิบาย

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

Recovering Period ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาตั้งแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลาเท่าใด

FX Hedging เปรอ์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตกองทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลาหนึ่ง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์กับผลรวมของมูลค่าการขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 1 ปีหารด้วยมูลค่า NAV ของกองทุนรวมเฉลี่ยในรอบระยะเวลาเดียวกัน กองทุนรวมที่มีค่า portfolio turnover สูง บ่งชี้ถึงการซื้อขายหลักทรัพย์บ่อยครั้งของผู้จัดการกองทุนและทำให้มีต้นทุนการซื้อขายหลักทรัพย์ที่สูง จึงต้องพิจารณาเปรียบเทียบกับผลการดำเนินงานของกองทุนรวมเพื่อประเมินความคุ้มค่าของการซื้อขายหลักทรัพย์ดังกล่าว

Sharpe Ratio อัตราส่วนระหว่างผลตอบแทนส่วนเพิ่มของกองทุนรวมเปรียบเทียบกับความเสี่ยงจากการลงทุน โดยคำนวณจากผล

ต่างระหว่างอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมกับอัตราผลตอบแทนที่ปราศจากความเสี่ยง (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 หลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนมากกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด

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 มีหน่วยมาตรฐานเป็นเปอร์เซ็นต์ต่อปี จึงสามารถนำไปใช้เปรียบเทียบอัตราผลตอบแทนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีนโยบายถือครองตราสารหนี้จนครบกำหนดอายุและมีลักษณะการลงทุนที่ใกล้เคียงกันได้

ข้อมูลการลงทุนที่เกี่ยวกับความยั่งยืนของ
กองทุนเปิดกรุงศรีโกลบอลไดนามิกแอกเกรสซีฟโกลบอลเคเอ็นเอสอาร์ไอ-สะสมมูลค่า (KFGDA-A)

วัตถุประสงค์การลงทุนที่เกี่ยวกับความยั่งยืน:

กองทุนมีวัตถุประสงค์การลงทุนในทรัพย์สินที่ส่งเสริมคุณลักษณะทางด้านสิ่งแวดล้อม และ/หรือ สังคม และธรรมาภิบาลเป็นหลัก ตามกลยุทธ์การลงทุนเพื่อความยั่งยืน (SRI Strategy) ผ่านการลงทุนในกองทุนหลัก

เป้าหมายด้านความยั่งยืนที่ต้องการบรรลุ:

กองทุนมีเป้าหมายด้านความยั่งยืน ด้วยวิธีการลงทุนที่คำนึงถึงปัจจัยด้านสิ่งแวดล้อม และ/หรือ สังคม และธรรมาภิบาล ผ่านการลงทุนในกองทุนหลักที่มีเป้าหมายด้านความยั่งยืนที่สอดคล้องกัน

กรอบการลงทุน (Investment Universe):

กองทุนเน้นลงทุนในกองทุนหลักที่มีการผสมผสานการวิเคราะห์ทางการเงินและการนำปัจจัยทางด้านสิ่งแวดล้อม และ/หรือ สังคม และธรรมาภิบาล เข้ามาในกระบวนการลงทุน เพื่อคัดสรรหลักทรัพย์ที่มีความสามารถในการเติบโตอย่างยั่งยืน โดยมีการใช้กรอบอ้างอิงตามหลักสากล อาทิ United Nations Sustainable Development Goals (UN SDGs) และ United Nations Global Impact เป็นต้น และไม่ลงทุนในบริษัทที่มีการละเมิดสิทธิมนุษยชน สิทธิแรงงาน การทุจริต การค้าอาวุธ (Controversial Weapons) และกิจการที่เกี่ยวข้องกับพลังงานนิวเคลียร์ (Nuclear energy)

การอ้างอิงดัชนีชี้วัดที่สอดคล้องกับความยั่งยืน:

กองทุนไม่มีดัชนีชี้วัดด้านความยั่งยืนที่สอดคล้องกับการลงทุน โดยเป็นไปตามกองทุนหลักที่มีการบริหารกองทุนแบบ SRI Strategy ซึ่งไม่มีการอ้างอิงดัชนีชี้วัด เนื่องจากไม่มีดัชนีชี้วัดใดที่เหมาะสม และสอดคล้องกับวัตถุประสงค์การลงทุนที่ส่งเสริมด้านสิ่งแวดล้อม (Environmental) และ/หรือสังคม (Social) ตามนโยบายของกองทุนหลัก

วัตถุประสงค์การลงทุนที่เกี่ยวกับความยั่งยืนของกองทุนหลัก:

กองทุนหลักมีวัตถุประสงค์การลงทุนที่ส่งเสริมคุณลักษณะทางด้านสิ่งแวดล้อม สังคม และ/หรือสิทธิมนุษยชนที่มีความยั่งยืน โดยมีวิธีการลงทุนตามแบบ SRI Best-in-Class (“BIC”) ที่คำนึงถึงปัจจัยทางด้านสิ่งแวดล้อม สังคม สิทธิมนุษยชน ธรรมาภิบาล และพฤติกรรมทางธุรกิจเป็นหลัก โดยกองทุนหลักจะเลือกลงทุนเฉพาะหลักทรัพย์ที่ได้รับการจัดอันดับด้านการลงทุนเพื่อความยั่งยืน (SRI Rating) ซึ่งมีการจัดทำเป็นการภายในเพื่อใช้ในการจัดอันดับและคัดเลือกหรือให้น้ำหนักหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนของกองทุนหลัก

เป้าหมายด้านความยั่งยืนที่ต้องการบรรลุของกองทุนหลัก:

กองทุนหลักมีเป้าหมายการลงทุนเพื่อความยั่งยืน โดยมุ่งเน้นการลงทุนที่คำนึงถึงปัจจัยทางด้านสิ่งแวดล้อม สังคม และธรรมาภิบาล โดยมีการใช้กรอบอ้างอิงตามหลักสากล เช่น United Nations Sustainable Development Goals (UN SDGs) และ United Nations Global Impact เป็นต้น

การลงทุนเพื่อความยั่งยืนมีส่วนช่วยในการบรรลุวัตถุประสงค์ด้านการส่งเสริมสิ่งแวดล้อม และ/หรือ สังคม ซึ่งเป็นหนึ่งในปัจจัยที่ผู้จัดการลงทุนใช้เป็นกรอบในการอ้างอิง (Reference Frameworks) สำหรับเป้าหมายการพัฒนาที่ยั่งยืน (Sustainable Development Goals: SDGs) ขององค์การสหประชาชาติ รวมถึงวัตถุประสงค์ของมาตรฐานการจัดกลุ่มกิจกรรมทางเศรษฐกิจที่คำนึงถึงสิ่งแวดล้อมของสหภาพยุโรป (EU Taxonomy) ได้แก่:

1. การลดปัญหาการเปลี่ยนแปลงสภาพภูมิอากาศ (Climate Change Mitigation)
2. การปรับตัวต่อการเปลี่ยนแปลงสภาพภูมิอากาศ (Climate Change Adaptation)
3. การใช้ประโยชน์อย่างยั่งยืนและการปกป้องทรัพยากรทางน้ำและทางทะเล (Sustainable Use and Protection of Water and Marine Resources)
4. การปรับเปลี่ยนสู่ระบบเศรษฐกิจหมุนเวียน (Transition to a Circular Economy)
5. การป้องกันและควบคุมมลพิษ (Pollution Prevention and Control)
6. การปกป้องและฟื้นฟูความหลากหลายทางชีวภาพและระบบนิเวศ (Protection and Restoration of Biodiversity and Ecosystems)

กรอบการลงทุน (Investment Universe) ของกองทุนหลัก:

กองทุนจะลงทุนอย่างน้อย 70% ของทรัพย์สินของกองทุน (ไม่รวมเงินสด และตราสารอนุพันธ์ที่ไม่ได้รับการจัดอันดับ) เพื่อให้เป็นไปตามวัตถุประสงค์ด้านสิ่งแวดล้อมและสังคมตามที่กำหนดไว้ โดยเงินลงทุนบางส่วนซึ่งเป็นส่วนน้อยของกองทุนอาจมีการลงทุนในทรัพย์สินที่ไม่ได้สนับสนุนความยั่งยืนด้านสิ่งแวดล้อม และสังคม ตัวอย่างของตราสารเหล่านี้ได้แก่ ตราสารอนุพันธ์ เงินสดและเงินฝาก กองทุน Target Funds บางกองทุน และการลงทุนที่ยังมีคุณสมบัติที่แตกต่างหรือไม่มีคุณสมบัติในการส่งเสริมความยั่งยืนด้านสิ่งแวดล้อม สังคม และธรรมาภิบาลเป็นการชั่วคราว นอกจากนี้ อย่างน้อย 20% ของทรัพย์สินของกองทุนจะลงทุนในหลักทรัพย์ที่ส่งเสริมความยั่งยืน โดยสัดส่วนการลงทุนขั้นต่ำที่สอดคล้องกับ EU Taxonomy เท่ากับ 0.01%

กองทุนไม่ลงทุนในกิจการที่เกี่ยวข้องกับก๊าซฟอสซิล (Fossil gas) และ/หรือพลังงานนิวเคลียร์ (Nuclear energy) ซึ่งสอดคล้องกับหลักเกณฑ์ของ EU Taxonomy อย่างไรก็ตาม จากกลยุทธ์การลงทุนดังกล่าว อาจเกิดการลงทุนในบริษัทที่ดำเนินกิจการเหล่านี้ได้ ทั้งนี้ หากมีข้อมูลที่เกี่ยวข้องเพิ่มเติมจะถูกจัดเตรียมไว้เป็นส่วนหนึ่งของการรายงานประจำปีของกองทุน

การอ้างอิงดัชนีชี้วัดที่สอดคล้องกับความยั่งยืนของกองทุนหลัก:

กองทุนไม่มีการอ้างอิงดัชนีชี้วัด (Benchmark) ที่สอดคล้องกับวัตถุประสงค์ในการลงทุนที่ส่งเสริมด้านสิ่งแวดล้อม (Environmental) และ/หรือสังคม (Social) ตามนโยบายกองทุน



กองทุนเปิดกรุงศรีโกลบอลไดนามิกแอกเกรสซีฟโกลเคชั่นเอสอาร์ไอ-ผู้ลงทุนสถาบัน

หน่วยลงทุนชนิดผู้ลงทุนสถาบัน

KFGDA-I

ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมผสม / กองทุนรวมฟีดเดอร์ (Feeder Fund) / กองทุนรวมเพื่อความยั่งยืน (SRI Fund) / กองทุนรวมที่มีนโยบายเปิดให้มีการลงทุนในกองทุนรวมอื่นภายใต้ บลจ. เดียวกัน (Cross Investing Fund)
- กองทุนรวมที่เน้นลงทุนแบบมีความเสี่ยงต่างประเทศ
- กลุ่ม Foreign Investment Allocation

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- ลงทุนในกองทุนรวมต่างประเทศชื่อ Allianz Dynamic Multi Asset Strategy SRI 75, Class P (EUR) (กองทุนหลัก) โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของ NAV
- กองทุนหลักมีนโยบายลงทุนในทรัพย์สินหลากหลายประเภท โดยมุ่งเน้นการลงทุนในตราสารทุน ตราสารหนี้ และตราสารในตลาดเงินทั่วโลก เพื่อสร้างผลตอบแทนในระยะปานกลางที่ใกล้เคียงกับพอร์ตการลงทุนแบบสมดุล โดยมีค่าความผันผวนอยู่ในช่วง 10% ถึง 16% และสอดคล้องกับกลยุทธ์การลงทุนเพื่อความยั่งยืน (SRI Strategy) โดยเน้นการลงทุนในทรัพย์สินที่ส่งเสริมคุณลักษณะทางด้านสิ่งแวดล้อม และ/หรือ สังคม และธรรมาภิบาลเป็นหลัก
- บริษัทที่บริหารจัดการกองทุนหลัก คือ Allianz Global Investors GmbH
- กองทุนอาจลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมภายใต้การจัดการของบริษัทจัดการในสัดส่วนไม่เกินร้อยละ 20 ของ NAV
- กองทุนอาจลงทุนในตราสารที่มีสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Structured Note) และ/หรือ สัญญาซื้อขายล่วงหน้าเพื่อเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน (Efficient Portfolio Management) โดยขึ้นอยู่กับดุลยพินิจของผู้จัดการกองทุน
- ป้องกันความเสี่ยงอัตราแลกเปลี่ยนตามดุลยพินิจของผู้จัดการกองทุน
- กองทุนไทยมุ่งหวังให้ผลประกอบการเคลื่อนไหวตามกองทุนหลัก โดยกองทุนหลักมีการบริหารจัดการแบบ SRI Strategy ที่มีการบริหารจัดการเชิงรุกโดยไม่มีการอ้างอิงดัชนีชี้วัด (Active management)

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (%) ต่อปี

- ยังไม่มีข้อมูล -

ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปิดหมด (%) ต่อปี

- ยังไม่มีข้อมูล -

ระดับความเสี่ยง

ต่ำ	1	2	3	4	5	6	7	8	สูง
-----	---	---	---	---	---	---	---	---	-----

เสี่ยงสูง

ลงทุนในตราสารทุน ตราสารหนี้ และ/หรือทรัพย์สินทางเลือก โดยมีสัดส่วนการลงทุนในตราสารทุนไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน:	27 กันยายน 2567
วันเริ่มต้น class	27 กันยายน 2567
นโยบายการจ่ายเงินปันผล:	ไม่จ่าย
อายุกองทุน:	ไม่กำหนด

ผู้จัดการกองทุนรวม

นายจาตุรนต์ สอนไว	ตั้งแต่วันที่ 27 กันยายน 2567
นายชูศักดิ์ อวยพรชัยสกุล	ตั้งแต่วันที่ 27 กันยายน 2567

ดัชนีชี้วัด :

กองทุนไม่มีดัชนีชี้วัดด้านความยั่งยืนที่สอดคล้องกับการลงทุน โดยเป็นไปตามกองทุนหลักที่มีการบริหารกองทุนแบบ SRI Strategy ซึ่งไม่มีการอ้างอิงดัชนีชี้วัด

คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวมมิได้เป็นสัญญาณถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อด้านทุจริต: ได้รับการรับรองจาก CAC

“ผู้ลงทุนสามารถศึกษา
เครื่องมือบริหารความเสี่ยงด้าน
สภาพคล่องได้ในหนังสือชี้ชวน
ฉบับเต็ม”

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



www.krungsriasset.com

การซื้อขายหน่วยลงทุน	การขายคืนหน่วยลงทุน
วันทำการซื้อ: <ul style="list-style-type: none"> ช่วง IPO: 19 - 25 กันยายน 2567 ภายในเวลา 15.30 น. ของวันสุดท้าย ทั้งนี้ จะรับชำระเป็นเช็คจนถึงวันที่ 25 กันยายน 2567 หลัง IPO: เริ่มตั้งแต่วันที่ 1 ตุลาคม 2567 เป็นต้นไป ทุกวันทำการซื้อขายของกองทุน 	วันทำการขายคืน: เริ่มตั้งแต่วันที่ 1 ตุลาคม 2567 ทุกวันทำการซื้อขายของกองทุน
เวลาทำการ: 8.30 - 15.30 น.	เวลาทำการ: 8.30 - 15.30 น.
การซื้อขายครั้งแรก	การซื้อขายขั้นต่ำ: ไม่กำหนด
ขั้นต่ำ:	การขายคืนขั้นต่ำ: ไม่กำหนด
การซื้อขายครั้งถัดไป	ระยะเวลาการรับ ภายใน 6 วันทำการนับถัดจาก
ขั้นต่ำ:	เงินค่าขายคืน : วันทำการขายคืน โดยทั่วไปจะได้รับเงิน 3 วันทำการนับถัดจากวันทำการขายคืน (T+3)

ข้อมูลเชิงสถิติ

Maximum Drawdown	-
Recovering Period	-
Fx Hedging	-
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน	-
Sharpe Ratio	-
Alpha	-
Beta	-
Tracking Error	-

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	2.1400	1.0165
รวมค่าใช้จ่าย	4.6545	1.2091

หมายเหตุ:

- หากกองทุนลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมภายใต้การจัดการเดียวกัน (กองทุนปลายทาง) บริษัทจัดการจะไม่เรียกเก็บค่าธรรมเนียมการจัดการซ้ำซ้อนกับกองทุนปลายทาง
- กองทุนหลักคืน (rebate) ค่าธรรมเนียมการจัดการ (ตามอัตราที่ตกลงกันระหว่างบริษัทจัดการและกองทุนหลัก) ให้แก่กองทุนไทย โดยเก็บเข้าเป็นทรัพย์สินของกองทุน

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การขาย	2.00	ยังไม่เรียกเก็บ
การรับซื้อคืน	2.00	ยังไม่เรียกเก็บ
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า	2.00	ยังไม่เรียกเก็บ
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก	2.00	ยังไม่เรียกเก็บ
การโอนหน่วย	10 บาทต่อ 1,000 หน่วย	10 บาทต่อ 1,000 หน่วย

หมายเหตุ:

- ค่าธรรมเนียมหรือค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม และ/หรือผู้สั่งซื้อหรือผู้ถือหน่วยลงทุนข้างต้น เป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่มหรือภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว
- หากกองทุนลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมภายใต้การจัดการเดียวกัน บริษัทจัดการจะไม่เรียกเก็บค่าธรรมเนียมการขาย และ/หรือรับซื้อคืนหน่วยลงทุนซ้ำซ้อน
- บริษัทจัดการขอสงวนสิทธิในการยกเว้นโดยไม่เรียกเก็บค่าธรรมเนียมการสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนระหว่างชนิดหน่วยลงทุนภายใต้กองทุนนี้ โดยขึ้นอยู่กับดุลยพินิจของบริษัทจัดการ
- บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ
- บริษัทจัดการอาจยกเว้นไม่เรียกเก็บค่าธรรมเนียมการโอนหน่วยลงทุน โดยขึ้นอยู่กับดุลยพินิจของบริษัทจัดการ

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน*

Breakdown	% NAV
หน่วย CIS	80.00
อื่นๆ	20.00

ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก*

Holding	% NAV
Allianz Dynamic Multi Asset Strategy SRI 75	80.00
อื่นๆ	20.00

หมายเหตุ: * ข้อมูลการลงทุนและสัดส่วนการลงทุนดังกล่าว เป็นเพียงคาดการณ์การลงทุน ซึ่งอาจเปลี่ยนแปลงได้

การจัดสรรการลงทุนในต่างประเทศของกองทุนหลัก

- ไม่มีข้อมูล -

การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรมของกองทุนหลัก

- ไม่มีข้อมูล -

ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรกของกองทุนหลัก

Holding	% NAV
NVIDIA CORP	3.41
ALLIANZ COMMODITIES-I EUR	3.27
MICROSOFT CORP	3.02
S ST SUST CL EM EN EQ F-IUSD	2.37
AMAZON.COM INC	2.33

ข้อมูลกองทุนหลัก ณ วันที่ 30 มิถุนายน 2567

การลงทุนในกองทุนอื่นเกินกว่า 20% (กองในประเทศ และหรือกองต่างประเทศ)

ชื่อกองทุน: Allianz Dynamic Multi Asset Strategy SRI 75, Class P (EUR)

ISIN code: LU1575694655

Bloomberg code: ADMA75P LX

ข้อมูลอื่นๆ

- ผู้ลงทุนสามารถซื้อกรรมสิทธิ์ประกันชีวิตควบหน่วยลงทุน (Unit-Linked) ของกองทุนนี้ได้โดยติดต่อกับบริษัทประกันชีวิตที่บริษัทจัดการกำหนด ทั้งนี้ การซื้อกรรมสิทธิ์ประกันชีวิตควบหน่วยลงทุนอาจมีข้อกำหนดและวิธีปฏิบัติที่แตกต่างไปจากผู้ถือหน่วยลงทุนปกติที่ซื้อขายหน่วยลงทุนของกองทุนนี้ เพียงอย่างเดียว ผู้ลงทุนจึงควรศึกษารายละเอียดในเอกสารประกอบการขายกรรมสิทธิ์ประกันชีวิตควบหน่วยลงทุนให้เข้าใจก่อนการตัดสินใจลงทุน
- บริษัทจัดการจะปฏิบัติตามกฎเกณฑ์ของกองทุนหลักโดยรายงานการถือครองหน่วยลงทุนตั้งแต่ร้อยละ 10 ของจำนวนหน่วยลงทุนที่จำหน่ายได้แล้วทั้งหมดของกองทุนให้กับผู้มีอำนาจหน้าที่ของกองทุนหลัก และอาจนำเสนอข้อมูลส่วนตัวของผู้ถือหน่วยลงทุนดังกล่าวเช่น สำเนาบัตรประจำตัวประชาชนและ/หรือสำเนาหนังสือเดินทาง เป็นต้น และ/หรือขอข้อมูลหรือเอกสารเพิ่มเติมอื่นใดจากผู้ถือหน่วยลงทุนในภายหลังก็ได้ เพื่อให้เป็นไปตามที่กองทุนหลักร้องขอ หากผู้ถือหน่วยลงทุนรายใดปฏิเสธการให้ข้อมูลหรือเอกสารเพิ่มเติมดังกล่าวหรือมีพฤติกรรมเข้าข่ายและ/หรือมีความผิดตามกฎหมายอันมีผลทำให้บริษัทจัดการไม่สามารถปฏิบัติตามกฎเกณฑ์ของกองทุนหลักได้ บริษัทจัดการขอสงวนสิทธิ์ที่จะระงับหรือหยุดให้บริการและดำเนินการคืนเงินลงทุนตามมูลค่าหน่วยลงทุนให้แก่ผู้ถือหน่วยลงทุน โดยถือว่าได้รับความเห็นชอบจากผู้ถือหน่วยลงทุนแล้ว ทั้งนี้ ผู้ถือหน่วยลงทุนจะไม่สามารถนำเรื่องดังกล่าวมาใช้เป็นสิทธิเรียกร้องความเสียหายจากเหตุดังกล่าวจากบริษัทจัดการได้แต่อย่างใด

คำอธิบาย

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

Recovering Period ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาตั้งแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลานานเท่าใด

FX Hedging เปรอ์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตกองทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลาหนึ่ง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์กับผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 1 ปีหารด้วยมูลค่า NAV ของกองทุนรวมเฉลี่ยในรอบระยะเวลาเดียวกัน กองทุนรวมที่มีค่า portfolio turnover สูง บ่งชี้ถึงการซื้อขายหลักทรัพย์บ่อยครั้งของผู้จัดการกองทุนและทำให้มีต้นทุนการซื้อขายหลักทรัพย์ที่สูง จึงต้องพิจารณาเปรียบเทียบกับผลการดำเนินงานของกองทุนรวมเพื่อประเมินความคุ้มค่าของการซื้อขายหลักทรัพย์ดังกล่าว

Sharpe Ratio อัตราส่วนระหว่างผลตอบแทนส่วนเพิ่มของกองทุนรวมเปรียบเทียบกับความเสี่ยงจากการลงทุน โดยคำนวณจากผล

ต่างระหว่างอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมกับอัตราผลตอบแทนที่ปราศจากความเสี่ยง (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 หลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนมากกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด

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 มีหน่วยมาตรฐานเป็นเปอร์เซ็นต์ต่อปี จึงสามารถนำไปใช้เปรียบเทียบอัตราผลตอบแทนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีนโยบายถือครองตราสารหนี้จนครบกำหนดอายุและมีลักษณะการลงทุนที่ใกล้เคียงกันได้

ข้อมูลการลงทุนที่เกี่ยวกับความยั่งยืนของ
กองทุนเปิดกรุงศรีโกลบอลไดนามิกแอกเกรสซีฟโพลีเคชั่นเอสอาร์ไอ-ผู้ลงทุนสถาบัน (KFGDA-I)

วัตถุประสงค์การลงทุนที่เกี่ยวกับความยั่งยืน:

กองทุนมีวัตถุประสงค์การลงทุนในทรัพย์สินที่ส่งเสริมคุณลักษณะทางด้านสิ่งแวดล้อม และ/หรือ สังคม และธรรมาภิบาลเป็นหลัก ตามกลยุทธ์การลงทุนเพื่อความยั่งยืน (SRI Strategy) ผ่านการลงทุนในกองทุนหลัก

เป้าหมายด้านความยั่งยืนที่ต้องการบรรลุ:

กองทุนมีเป้าหมายด้านความยั่งยืน ด้วยวิธีการลงทุนที่คำนึงถึงปัจจัยด้านสิ่งแวดล้อม และ/หรือ สังคม และธรรมาภิบาล ผ่านการลงทุนในกองทุนหลักที่มีเป้าหมายด้านความยั่งยืนที่สอดคล้องกัน

กรอบการลงทุน (Investment Universe):

กองทุนเน้นลงทุนในกองทุนหลักที่มีการผสมผสานการวิเคราะห์ทางการเงินและการนำปัจจัยทางด้านสิ่งแวดล้อม และ/หรือ สังคม และธรรมาภิบาล เข้ามาในกระบวนการลงทุน เพื่อคัดสรรหลักทรัพย์ที่มีความสามารถในการเติบโตอย่างยั่งยืน โดยมีการใช้กรอบอ้างอิงตามหลักสากล อาทิ United Nations Sustainable Development Goals (UN SDGs) และ United Nations Global Impact เป็นต้น และไม่ลงทุนในบริษัทที่มีการละเมิดสิทธิมนุษยชน สิทธิแรงงาน การทุจริต การค้าอาวุธ (Controversial Weapons) และกิจการที่เกี่ยวข้องกับพลังงานนิวเคลียร์ (Nuclear energy)

การอ้างอิงดัชนีชี้วัดที่สอดคล้องกับความยั่งยืน:

กองทุนไม่มีดัชนีชี้วัดด้านความยั่งยืนที่สอดคล้องกับการลงทุน โดยเป็นไปตามกองทุนหลักที่มีการบริหารกองทุนแบบ SRI Strategy ซึ่งไม่มีการอ้างอิงดัชนีชี้วัด เนื่องจากไม่มีดัชนีชี้วัดใดที่เหมาะสม และสอดคล้องกับวัตถุประสงค์การลงทุนที่ส่งเสริมด้านสิ่งแวดล้อม (Environmental) และ/หรือสังคม (Social) ตามนโยบายของกองทุนหลัก

วัตถุประสงค์การลงทุนที่เกี่ยวกับความยั่งยืนของกองทุนหลัก:

กองทุนหลักมีวัตถุประสงค์การลงทุนที่ส่งเสริมคุณลักษณะทางด้านสิ่งแวดล้อม สังคม และ/หรือสิทธิมนุษยชนที่มีความยั่งยืน โดยมีวิธีการลงทุนตามแบบ SRI Best-in-Class (“BIC”) ที่คำนึงถึงปัจจัยทางด้านสิ่งแวดล้อม สังคม สิทธิมนุษยชน ธรรมาภิบาล และพฤติกรรมทางธุรกิจเป็นหลัก โดยกองทุนหลักจะเลือกลงทุนเฉพาะหลักทรัพย์ที่ได้รับการจัดอันดับด้านการลงทุนเพื่อความยั่งยืน (SRI Rating) ซึ่งมีการจัดทำเป็นการภายในเพื่อใช้ในการจัดอันดับและคัดเลือกหรือให้น้ำหนักหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนของกองทุนหลัก

เป้าหมายด้านความยั่งยืนที่ต้องการบรรลุของกองทุนหลัก:

กองทุนหลักมีเป้าหมายการลงทุนเพื่อความยั่งยืน โดยมุ่งเน้นการลงทุนที่คำนึงถึงปัจจัยทางด้านสิ่งแวดล้อม สังคม และธรรมาภิบาล โดยมีการใช้กรอบอ้างอิงตามหลักสากล เช่น United Nations Sustainable Development Goals (UN SDGs) และ United Nations Global Impact เป็นต้น

การลงทุนเพื่อความยั่งยืนมีส่วนช่วยในการบรรลุวัตถุประสงค์ด้านการส่งเสริมสิ่งแวดล้อม และ/หรือ สังคม ซึ่งเป็นหนึ่งในปัจจัยที่ผู้จัดการลงทุนใช้เป็นกรอบในการอ้างอิง (Reference Frameworks) สำหรับเป้าหมายการพัฒนาที่ยั่งยืน (Sustainable Development Goals: SDGs) ขององค์การสหประชาชาติ รวมถึงวัตถุประสงค์ของมาตรฐานการจัดกลุ่มกิจกรรมทางเศรษฐกิจที่คำนึงถึงสิ่งแวดล้อมของสหภาพยุโรป (EU Taxonomy) ได้แก่:

1. การลดปัญหาการเปลี่ยนแปลงสภาพภูมิอากาศ (Climate Change Mitigation)
2. การปรับตัวต่อการเปลี่ยนแปลงสภาพภูมิอากาศ (Climate Change Adaptation)
3. การใช้ประโยชน์อย่างยั่งยืนและการปกป้องทรัพยากรทางน้ำและทางทะเล (Sustainable Use and Protection of Water and Marine Resources)
4. การปรับเปลี่ยนสู่ระบบเศรษฐกิจหมุนเวียน (Transition to a Circular Economy)
5. การป้องกันและควบคุมมลพิษ (Pollution Prevention and Control)
6. การปกป้องและฟื้นฟูความหลากหลายทางชีวภาพและระบบนิเวศ (Protection and Restoration of Biodiversity and Ecosystems)

กรอบการลงทุน (Investment Universe) ของกองทุนหลัก:

กองทุนจะลงทุนอย่างน้อย 70% ของทรัพย์สินของกองทุน (ไม่รวมเงินสด และตราสารอนุพันธ์ที่ไม่ได้รับการจัดอันดับ) เพื่อให้เป็นไปตามวัตถุประสงค์ด้านสิ่งแวดล้อมและสังคมตามที่กำหนดไว้ โดยเงินลงทุนบางส่วนซึ่งเป็นส่วนน้อยของกองทุนอาจมีการลงทุนในทรัพย์สินที่ไม่ได้สนับสนุนความยั่งยืนด้านสิ่งแวดล้อม และสังคม ตัวอย่างของตราสารเหล่านี้ได้แก่ ตราสารอนุพันธ์ เงินสดและเงินฝาก กองทุน Target Funds บางกองทุน และการลงทุนที่ยังมีคุณสมบัติที่แตกต่างหรือไม่มีคุณสมบัติในการส่งเสริมความยั่งยืนด้านสิ่งแวดล้อม สังคม และธรรมาภิบาลเป็นการชั่วคราว นอกจากนี้ อย่างน้อย 20% ของทรัพย์สินของกองทุนจะลงทุนในหลักทรัพย์ที่ส่งเสริมความยั่งยืน โดยสัดส่วนการลงทุนขั้นต่ำที่สอดคล้องกับ EU Taxonomy เท่ากับ 0.01%

กองทุนไม่ลงทุนในกิจการที่เกี่ยวข้องกับก๊าซฟอสซิล (Fossil gas) และ/หรือพลังงานนิวเคลียร์ (Nuclear energy) ซึ่งสอดคล้องกับหลักเกณฑ์ของ EU Taxonomy อย่างไรก็ตาม จากกลยุทธ์การลงทุนดังกล่าว อาจเกิดการลงทุนในบริษัทที่ดำเนินกิจการเหล่านี้ได้ ทั้งนี้ หากมีข้อมูลที่เกี่ยวข้องเพิ่มเติมจะถูกจัดเตรียมไว้เป็นส่วนหนึ่งของการรายงานประจำปีของกองทุน

การอ้างอิงดัชนีชี้วัดที่สอดคล้องกับความยั่งยืนของกองทุนหลัก:

กองทุนไม่มีการอ้างอิงดัชนีชี้วัด (Benchmark) ที่สอดคล้องกับวัตถุประสงค์ในการลงทุนที่ส่งเสริมด้านสิ่งแวดล้อม (Environmental) และ/หรือสังคม (Social) ตามนโยบายกองทุน



กองทุนเปิดกรุงศรีโกลบอลไดนามิกแอกเกรสซีฟโพลเคชั่นเอสอาร์ไอ-ผู้ลงทุนสถาบันแบบเฉพาะ

หน่วยลงทุนชนิดผู้ลงทุนสถาบันแบบเฉพาะ

KFGDA-IX

ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมผสม / กองทุนรวมฟีดเดอร์ (Feeder Fund) / กองทุนรวมเพื่อความยั่งยืน (SRI Fund) / กองทุนรวมที่มีนโยบายเปิดให้มีการลงทุนในกองทุนรวมอื่นภายใต้ บลจ. เดียวกัน (Cross Investing Fund)
- กองทุนรวมที่เน้นลงทุนแบบมีความเสี่ยงต่างประเทศ
- กลุ่ม Foreign Investment Allocation

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- ลงทุนในกองทุนรวมต่างประเทศชื่อ Allianz Dynamic Multi Asset Strategy SRI 75, Class P (EUR) (กองทุนหลัก) โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของ NAV
- กองทุนหลักมีนโยบายลงทุนในทรัพย์สินหลากหลายประเภท โดยมุ่งเน้นการลงทุนในตราสารทุน ตราสารหนี้ และตราสารในตลาดเงินทั่วโลก เพื่อสร้างผลตอบแทนในระยะปานกลางที่ใกล้เคียงกับพอร์ตการลงทุนแบบสมดุล โดยมีค่าความผันผวนอยู่ในช่วง 10% ถึง 16% และสอดคล้องกับกลยุทธ์การลงทุนเพื่อความยั่งยืน (SRI Strategy) โดยเน้นการลงทุนในทรัพย์สินที่ส่งเสริมคุณลักษณะทางด้านสิ่งแวดล้อม และ/หรือ สังคม และธรรมาภิบาลเป็นหลัก
- บริษัทที่บริหารจัดการกองทุนหลัก คือ Allianz Global Investors GmbH
- กองทุนอาจลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมภายใต้การจัดการของบริษัทจัดการในสัดส่วนไม่เกินร้อยละ 20 ของ NAV
- กองทุนอาจลงทุนในตราสารที่มีสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแบ่ง (Structured Note) และ/หรือ สัญญาซื้อขายล่วงหน้าเพื่อเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน (Efficient Portfolio Management) โดยขึ้นอยู่กับดุลยพินิจของผู้จัดการกองทุน
- ป้องกันความเสี่ยงอัตราแลกเปลี่ยนตามดุลยพินิจของผู้จัดการกองทุน
- กองทุนไทยมุ่งหวังให้ผลประกอบการเคลื่อนไหวตามกองทุนหลัก โดยกองทุนหลักมีการบริหารจัดการแบบ SRI Strategy ที่มีการบริหารจัดการเชิงรุกโดยไม่มีการอ้างอิงดัชนีชี้วัด (Active management)

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (%) ต่อปี

- ยังไม่มีข้อมูล -

ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปีกมุด (%) ต่อปี

- ยังไม่มีข้อมูล -

ระดับความเสี่ยง

ต่ำ	1	2	3	4	5	6	7	8	สูง
-----	---	---	---	---	---	---	---	---	-----

เสี่ยงสูง

ลงทุนในตราสารทุน ตราสารหนี้ และ/หรือทรัพย์สินทางเลือก โดยมีสัดส่วนการลงทุนในตราสารทุนไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน:	27 กันยายน 2567
วันเริ่มต้น class	27 กันยายน 2567
นโยบายการจ่ายเงินปันผล:	ไม่จ่าย
อายุกองทุน:	ไม่กำหนด

ผู้จัดการกองทุนรวม

นายจตุรนต์ สอนไว	ตั้งแต่วันที่ 27 กันยายน 2567
นายชูศักดิ์ อวยพรชัยสกุล	ตั้งแต่วันที่ 27 กันยายน 2567

ดัชนีชี้วัด :

กองทุนไม่มีดัชนีชี้วัดด้านความยั่งยืนที่สอดคล้องกับการลงทุน โดยเป็นไปตามกองทุนหลักที่มีการบริหารกองทุนแบบ SRI Strategy ซึ่งไม่มีการอ้างอิงดัชนีชี้วัด

คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวมมิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต: ได้รับการรับรองจาก CAC

“ผู้ลงทุนสามารถศึกษา เครื่องมือบริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่องได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม”

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



การซื้อขายหน่วยลงทุน	การขายคืนหน่วยลงทุน
วันทำการซื้อ: <ul style="list-style-type: none"> ช่วง IPO: 19 - 25 กันยายน 2567 ภายในเวลา 15.30 น. ของวันสุดท้าย ทั้งนี้ จะรับชำระเป็นเช็คจนถึงวันที่ 25 กันยายน 2567 หลัง IPO: เริ่มตั้งแต่วันที่ 1 ตุลาคม 2567 เป็นต้นไป ทุกวันทำการซื้อขายของกองทุน 	วันทำการขายคืน: เริ่มตั้งแต่วันที่ 1 ตุลาคม 2567 ทุกวันทำการซื้อขายของกองทุน
เวลาทำการ: 8.30 - 15.30 น.	เวลาทำการ: 8.30 - 15.30 น.
การซื้อครั้งแรก ขั้นต่ำ: 10,000,000 บาท	การขายคืนขั้นต่ำ: ไม่กำหนด
การซื้อครั้งถัดไป ขั้นต่ำ: 10,000,000 บาท	ยอดคงเหลือขั้นต่ำ: ไม่กำหนด
	ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน : ภายใน 6 วันทำการนับถัดจากวันทำการซื้อขายคืน โดยทั่วไปจะได้รับเงิน 3 วันทำการนับถัดจากวันทำการขายคืน (T+3)

ข้อมูลเชิงสถิติ

Maximum Drawdown	-
Recovering Period	-
Fx Hedging	-
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน	-
Sharpe Ratio	-
Alpha	-
Beta	-
Tracking Error	-

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	2.1400	0.5082
รวมค่าใช้จ่าย	4.6545	0.7008

หมายเหตุ:

- หากกองทุนลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมภายใต้การจัดการเดียวกัน (กองทุนปลายทาง) บริษัทจัดการจะไม่เรียกเก็บค่าธรรมเนียมการจัดการซ้ำซ้อนกับกองทุนปลายทาง
- กองทุนหลักคืน (rebate) ค่าธรรมเนียมการจัดการ (ตามอัตราที่ตกลงกันระหว่างบริษัทจัดการและกองทุนหลัก) ให้แก่กองทุนไทย โดยเก็บเข้าเป็นทรัพย์สินของกองทุน

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การขาย		
o ช่วงเสนอขาย IPO	2.00	ยังไม่เรียกเก็บ
o ภายหลังจากเสนอขายครั้งแรก	2.00	2.00
การรับซื้อคืน	2.00	ยังไม่เรียกเก็บ
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า	2.00	ไม่เปิดให้สับเปลี่ยน
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก	2.00	ไม่เปิดให้สับเปลี่ยน
การโอนหน่วย	10 บาทต่อ 1,000 หน่วย	10 บาทต่อ 1,000 หน่วย

หมายเหตุ:

- ค่าธรรมเนียมหรือค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม และ/หรือผู้สั่งซื้อหรือผู้ถือหน่วยลงทุนข้างต้น เป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่มหรือภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว
- หากกองทุนลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมภายใต้การจัดการเดียวกัน บริษัทจัดการจะไม่เรียกเก็บค่าธรรมเนียมการขาย และ/หรือรับซื้อคืนหน่วยลงทุนซ้ำซ้อน
- บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ
- บริษัทจัดการขอสงวนสิทธิไม่เปิดให้บริการสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนระหว่างชนิดหน่วยลงทุนอื่นภายใต้กองทุนนี้ และ/หรือกองทุนรวมอื่นที่อยู่ภายใต้การบริหารของบริษัทจัดการ
- บริษัทจัดการอาจยกเว้นไม่เรียกเก็บค่าธรรมเนียมการโอนหน่วยลงทุน โดยขึ้นอยู่กับดุลยพินิจของบริษัทจัดการ

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน*

Breakdown	% NAV
หน่วย CIS	80.00
อื่นๆ	20.00

ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก*

Holding	% NAV
Allianz Dynamic Multi Asset Strategy SRI 75	80.00
อื่นๆ	20.00

หมายเหตุ: * ข้อมูลการลงทุนและสัดส่วนการลงทุนดังกล่าว เป็นเพียงคาดการณ์การลงทุน ซึ่งอาจเปลี่ยนแปลงได้

การจัดสรรการลงทุนในต่างประเทศของกองทุนหลัก

- ไม่มีข้อมูล -

การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรมของกองทุนหลัก

- ไม่มีข้อมูล -

ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรกของกองทุนหลัก

Holding	% NAV
NVIDIA CORP	3.41
ALLIANZ COMMODITIES-I EUR	3.27
MICROSOFT CORP	3.02
S ST SUST CL EM EN EQ F-IUSD	2.37
AMAZON.COM INC	2.33

ข้อมูลกองทุนหลัก ณ วันที่ 30 มิถุนายน 2567

การลงทุนในกองทุนอื่นเกินกว่า 20% (กองในประเทศ และหรือกองต่างประเทศ)

ชื่อกองทุน: Allianz Dynamic Multi Asset Strategy SRI 75, Class P (EUR)

ISIN code: LU1575694655

Bloomberg code: ADMA75P LX

ข้อมูลอื่นๆ

- ผู้ลงทุนสามารถซื้อกรรมสิทธิ์ประกันชีวิตควบหน่วยลงทุน (Unit-Linked) ของกองทุนนี้ได้โดยติดต่อกับบริษัทประกันชีวิตที่บริษัทจัดการกำหนด ทั้งนี้ การซื้อกรรมสิทธิ์ประกันชีวิตควบหน่วยลงทุนอาจมีข้อกำหนดและวิธีปฏิบัติที่แตกต่างไปจากผู้ถือหน่วยลงทุนปกติที่ซื้อขายหน่วยลงทุนของกองทุนนี้ เพียงอย่างเดียว ผู้ลงทุนจึงควรศึกษารายละเอียดในเอกสารประกอบการขายกรรมสิทธิ์ประกันชีวิตควบหน่วยลงทุนให้เข้าใจก่อนการตัดสินใจลงทุน
- บริษัทจัดการจะปฏิบัติตามกฎเกณฑ์ของกองทุนหลักโดยรายงานการถือครองหน่วยลงทุนตั้งแต่ร้อยละ 10 ของจำนวนหน่วยลงทุนที่จำหน่ายได้แล้วทั้งหมดของกองทุนให้กับผู้มีอำนาจหน้าที่ของกองทุนหลัก และอาจนำเสนอข้อมูลส่วนตัวของผู้ถือหน่วยลงทุนดังกล่าวเช่น สำเนาบัตรประจำตัวประชาชนและ/หรือสำเนาหนังสือเดินทาง เป็นต้น และ/หรือขอข้อมูลหรือเอกสารเพิ่มเติมอื่นใดจากผู้ถือหน่วยลงทุนในภายหลังก็ได้ เพื่อให้เป็นไปตามที่กองทุนหลักร้องขอ หากผู้ถือหน่วยลงทุนรายใดปฏิเสธการให้ข้อมูลหรือเอกสารเพิ่มเติมดังกล่าวหรือมีพฤติกรรมเข้าข่ายและ/หรือมีความผิดตามกฎหมายอันมีผลทำให้บริษัทจัดการไม่สามารถปฏิบัติตามกฎเกณฑ์ของกองทุนหลักได้ บริษัทจัดการขอสงวนสิทธิ์ที่จะระงับหรือหยุดให้บริการและดำเนินการคืนเงินลงทุนตามมูลค่าหน่วยลงทุนให้แก่ผู้ถือหน่วยลงทุน โดยถือว่าได้รับความเห็นชอบจากผู้ถือหน่วยลงทุนแล้ว ทั้งนี้ ผู้ถือหน่วยลงทุนจะไม่สามารถนำเรื่องดังกล่าวมาใช้เป็นสิทธิเรียกร้องความเสียหายจากเหตุดังกล่าวจากบริษัทจัดการได้แต่อย่างใด

คำอธิบาย

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

Recovering Period ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาตั้งแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลาเท่าใด

FX Hedging เปรอ์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตกองทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลาหนึ่ง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์กับผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 1 ปีหารด้วยมูลค่า NAV ของกองทุนรวมเฉลี่ยในรอบระยะเวลาเดียวกัน กองทุนรวมที่มีค่า portfolio turnover สูง บ่งชี้ถึงการซื้อขายหลักทรัพย์บ่อยครั้งของผู้จัดการกองทุนและทำให้มีต้นทุนการซื้อขายหลักทรัพย์ที่สูง จึงต้องพิจารณาเปรียบเทียบกับผลการดำเนินงานของกองทุนรวมเพื่อประเมินความคุ้มค่าของการซื้อขายหลักทรัพย์ดังกล่าว

Sharpe Ratio อัตราส่วนระหว่างผลตอบแทนส่วนเพิ่มของกองทุนรวมเปรียบเทียบกับความเสี่ยงจากการลงทุน โดยคำนวณจากผล

ต่างระหว่างอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมกับอัตราผลตอบแทนที่ปราศจากความเสี่ยง (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 หลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนมากกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด

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 มีหน่วยมาตรฐานเป็นเปอร์เซ็นต์ต่อปี จึงสามารถนำไปใช้เปรียบเทียบอัตราผลตอบแทนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีนโยบายถือครองตราสารหนี้จนครบกำหนดอายุและมีลักษณะการลงทุนที่ใกล้เคียงกันได้

ข้อมูลการลงทุนที่เกี่ยวข้องกับความยั่งยืนของ
กองทุนเปิดกรุงศรีโกลบอลไดนามิกแอกเกรสซีฟโกลเคชั่นเอสอาร์ไอ-ผู้ลงทุนสถาบันแบบเฉพาะ (KFGDA-IX)

วัตถุประสงค์การลงทุนที่เกี่ยวข้องกับความยั่งยืน:

กองทุนมีวัตถุประสงค์การลงทุนในทรัพย์สินที่ส่งเสริมคุณลักษณะทางด้านสิ่งแวดล้อม และ/หรือ สังคม และธรรมาภิบาลเป็นหลัก ตามกลยุทธ์การลงทุนเพื่อความยั่งยืน (SRI Strategy) ผ่านการลงทุนในกองทุนหลัก

เป้าหมายด้านความยั่งยืนที่ต้องการบรรลุ:

กองทุนมีเป้าหมายด้านความยั่งยืน ด้วยวิธีการลงทุนที่คำนึงถึงปัจจัยด้านสิ่งแวดล้อม และ/หรือ สังคม และธรรมาภิบาล ผ่านการลงทุนในกองทุนหลักที่มีเป้าหมายด้านความยั่งยืนที่สอดคล้องกัน

กรอบการลงทุน (Investment Universe):

กองทุนเน้นลงทุนในกองทุนหลักที่มีการผสมผสานการวิเคราะห์ทางการเงินและการนำปัจจัยทางด้านสิ่งแวดล้อม และ/หรือ สังคม และธรรมาภิบาล เข้ามาในกระบวนการลงทุน เพื่อคัดสรรหลักทรัพย์ที่มีความสามารถในการเติบโตอย่างยั่งยืน โดยมีการใช้กรอบอ้างอิงตามหลักสากล อาทิ United Nations Sustainable Development Goals (UN SDGs) และ United Nations Global Impact เป็นต้น และไม่ลงทุนในบริษัทที่มีการละเมิดสิทธิมนุษยชน สิทธิแรงงาน การทุจริต การค้าอาวุธ (Controversial Weapons) และกิจการที่เกี่ยวข้องกับพลังงานนิวเคลียร์ (Nuclear energy)

การอ้างอิงดัชนีชี้วัดที่สอดคล้องกับความยั่งยืน:

กองทุนไม่มีดัชนีชี้วัดด้านความยั่งยืนที่สอดคล้องกับการลงทุน โดยเป็นไปตามกองทุนหลักที่มีการบริหารกองทุนแบบ SRI Strategy ซึ่งไม่มีการอ้างอิงดัชนีชี้วัด เนื่องจากไม่มีดัชนีชี้วัดใดที่เหมาะสม และสอดคล้องกับวัตถุประสงค์การลงทุนที่ส่งเสริมด้านสิ่งแวดล้อม (Environmental) และ/หรือสังคม (Social) ตามนโยบายของกองทุนหลัก

วัตถุประสงค์การลงทุนที่เกี่ยวข้องกับความยั่งยืนของกองทุนหลัก:

กองทุนหลักมีวัตถุประสงค์การลงทุนที่ส่งเสริมคุณลักษณะทางด้านสิ่งแวดล้อม สังคม และ/หรือสิทธิมนุษยชนที่มีความยั่งยืน โดยมีวิธีการลงทุนตามแบบ SRI Best-in-Class (“BIC”) ที่คำนึงถึงปัจจัยทางด้านสิ่งแวดล้อม สังคม สิทธิมนุษยชน ธรรมาภิบาล และพฤติกรรมทางธุรกิจเป็นหลัก โดยกองทุนหลักจะเลือกลงทุนเฉพาะหลักทรัพย์ที่ได้รับการจัดอันดับด้านการลงทุนเพื่อความยั่งยืน (SRI Rating) ซึ่งมีการจัดทำเป็นการภายในเพื่อใช้ในการจัดอันดับและคัดเลือกหรือให้น้ำหนักหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนของกองทุนหลัก

เป้าหมายด้านความยั่งยืนที่ต้องการบรรลุของกองทุนหลัก:

กองทุนหลักมีเป้าหมายการลงทุนเพื่อความยั่งยืน โดยมุ่งเน้นการลงทุนที่คำนึงถึงปัจจัยทางด้านสิ่งแวดล้อม สังคม และธรรมาภิบาล โดยมีการใช้กรอบอ้างอิงตามหลักสากล เช่น United Nations Sustainable Development Goals (UN SDGs) และ United Nations Global Impact เป็นต้น

การลงทุนเพื่อความยั่งยืนมีส่วนช่วยในการบรรลุวัตถุประสงค์ด้านการส่งเสริมสิ่งแวดล้อม และ/หรือ สังคม ซึ่งเป็นหนึ่งในปัจจัยที่ผู้จัดการลงทุนใช้เป็นกรอบในการอ้างอิง (Reference Frameworks) สำหรับเป้าหมายการพัฒนาที่ยั่งยืน (Sustainable Development Goals: SDGs) ขององค์การสหประชาชาติ รวมถึงวัตถุประสงค์ของมาตรฐานการจัดกลุ่มกิจกรรมทางเศรษฐกิจที่คำนึงถึงสิ่งแวดล้อมของสหภาพยุโรป (EU Taxonomy) ได้แก่:

1. การลดปัญหาการเปลี่ยนแปลงสภาพภูมิอากาศ (Climate Change Mitigation)
2. การปรับตัวต่อการเปลี่ยนแปลงสภาพภูมิอากาศ (Climate Change Adaptation)
3. การใช้ประโยชน์อย่างยั่งยืนและการปกป้องทรัพยากรทางน้ำและทางทะเล (Sustainable Use and Protection of Water and Marine Resources)
4. การปรับเปลี่ยนสู่ระบบเศรษฐกิจหมุนเวียน (Transition to a Circular Economy)
5. การป้องกันและควบคุมมลพิษ (Pollution Prevention and Control)
6. การปกป้องและฟื้นฟูความหลากหลายทางชีวภาพและระบบนิเวศ (Protection and Restoration of Biodiversity and Ecosystems)

กรอบการลงทุน (Investment Universe) ของกองทุนหลัก:

กองทุนจะลงทุนอย่างน้อย 70% ของทรัพย์สินของกองทุน (ไม่รวมเงินสด และตราสารอนุพันธ์ที่ไม่ได้รับการจัดอันดับ) เพื่อให้เป็นไปตามวัตถุประสงค์ด้านสิ่งแวดล้อมและสังคมตามที่กำหนดไว้ โดยเงินลงทุนบางส่วนซึ่งเป็นส่วนน้อยของกองทุนอาจมีการลงทุนในทรัพย์สินที่ไม่ได้สนับสนุนความยั่งยืนด้านสิ่งแวดล้อม และสังคม ตัวอย่างของตราสารเหล่านี้ได้แก่ ตราสารอนุพันธ์ เงินสดและเงินฝาก กองทุน Target Funds บางกองทุน และการลงทุนที่ยังมีคุณสมบัติที่แตกต่างหรือไม่มีคุณสมบัติในการส่งเสริมความยั่งยืนด้านสิ่งแวดล้อม สังคม และธรรมาภิบาลเป็นการชั่วคราว นอกจากนี้ อย่างน้อย 20% ของทรัพย์สินของกองทุนจะลงทุนในหลักทรัพย์ที่ส่งเสริมความยั่งยืน โดยสัดส่วนการลงทุนขั้นต่ำที่สอดคล้องกับ EU Taxonomy เท่ากับ 0.01%

กองทุนไม่ลงทุนในกิจการที่เกี่ยวข้องกับก๊าซฟอสซิล (Fossil gas) และ/หรือพลังงานนิวเคลียร์ (Nuclear energy) ซึ่งสอดคล้องกับหลักเกณฑ์ของ EU Taxonomy อย่างไรก็ตาม จากกลยุทธ์การลงทุนดังกล่าว อาจเกิดการลงทุนในบริษัทที่ดำเนินกิจการเหล่านี้ได้ ทั้งนี้ หากมีข้อมูลที่เกี่ยวข้องเพิ่มเติมจะถูกจัดเตรียมไว้เป็นส่วนหนึ่งของ การรายงานประจำปีของกองทุน

การอ้างอิงดัชนีชี้วัดที่สอดคล้องกับความยั่งยืนของกองทุนหลัก:

กองทุนไม่มีการอ้างอิงดัชนีชี้วัด (Benchmark) ที่สอดคล้องกับวัตถุประสงค์ในการลงทุนที่ส่งเสริมด้านสิ่งแวดล้อม (Environmental) และ/หรือสังคม (Social) ตามนโยบายกองทุน