



krungsri

Asset
Management

Make Life
Simple

A member of MUFG
a global financial group

รายงานประจำปีแรก 2566

รอบระยะเวลาตั้งแต่วันที่ 1 มีนาคม 2566 – 31 สิงหาคม 2566

กองทุนรวม

KFJPINDX

กองทุนเปิดกรุงศรีเจแปนเอควิตี้อินเด็กซ์เฮดจ์เอฟเอ็กซ์

Krungsri Japan Equity Index Hedged FX Fund

กองทุนนี้มีการแบ่งชนิดหน่วยลงทุนเป็น 2 ชนิด ได้แก่

1. หน่วยลงทุนชนิดสะสมมูลค่า :

กองทุนเปิดกรุงศรีเจแปนเอควิตี้อินเด็กซ์เฮดจ์เอฟเอ็กซ์-สะสมมูลค่า (ชื่อย่อ : KFJPINDX-A)

2. หน่วยลงทุนชนิดผู้ลงทุนสถาบัน :

กองทุนเปิดกรุงศรีเจแปนเอควิตี้อินเด็กซ์เฮดจ์เอฟเอ็กซ์-ผู้ลงทุนสถาบัน (ชื่อย่อ : KFJPINDX-I)

Krungsri Asset Management Co., Ltd.

1st-2nd Zone A, 12th, 18th Zone B Floor,
Ploenchit Tower, 898 Ploenchit Road,
Bangkok 10330 Thailand
T +66 (0) 2657 5757 F +66 (0) 2657 5777
www.krungsriasset.com

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด

ชั้น 1-2 โซนเอ ชั้น 12 ชั้น 18 โซนบี
อาคารเพลันจิตทาวเวอร์ 898 ถนนเพลันจิต แขวงลุมพินี
เขตปทุมวัน กรุงเทพฯ 10330
โทรศัพท์ +66 (0) 2657 5757 โทรสาร +66 (0) 2657 5777
www.krungsriasset.com

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด

รายงานประจำปีครั้งแรก 2566

กองทุนเปิดกรุงศรีเจแปนอิควิตี้อินเด็กซ์เฮดจ์เอฟเอ็กซ์

- สารบัญผู้จัดการ 3
- รายงานผู้ดูแลผลประโยชน์ 4
- งบแสดงฐานะการเงิน งบกำไรขาดทุนเบ็ดเสร็จ และงบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน 5
- รายละเอียดเงินลงทุน การกู้ยืมเงิน และการก่อภาระผูกพันของกองทุนรวม 8
- ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม 11
- คำนายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ 12
- ผลการดำเนินงาน 13
- ข้อมูลอื่นๆ ที่ผู้ถือหน่วยลงทุนควรทราบ 14
 - รายงานบุคคลที่เกี่ยวข้องที่มีการทำธุรกรรมในรอบเวลาที่ผ่านมา
 - รายชื่อผู้จัดการกองทุน
 - การเปิดเผยข้อมูลการถือหน่วยลงทุนเกิน 1 ใน 3
 - อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุนของกองทุน
 - ข้อมูลการลงทุน และผลการดำเนินงานของกองทุนหลัก

สารบริษัทจัดการ

เรียน ผู้ถือหน่วยลงทุน

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด (บริษัทฯ) ขอนำเสนอรายงานสำหรับรอบระยะเวลา 6 เดือน ของกองทุนเปิดกรุงศรีเจแปนอิควิตี้ อินเด็กซ์เฮดจ์เอฟเอ็กซ์ (KFJPINDEX) ตั้งแต่วันที่ 1 มีนาคม 2566 ถึงวันที่ 31 สิงหาคม 2566 มายังผู้ถือหน่วยลงทุน โดยมีรายละเอียด ดังนี้

ผลการดำเนินงาน

กองทุนเปิดกรุงศรีเจแปนอิควิตี้ อินเด็กซ์เฮดจ์เอฟเอ็กซ์ มีมูลค่าทรัพย์สินสุทธิ ณ วันที่ 31 สิงหาคม 2566 ซึ่งแบ่งตามชนิดหน่วยลงทุน ดังนี้

- KFJPINDEX-A จำนวน 153.53 ล้านบาท คิดเป็นมูลค่าทรัพย์สินสุทธิต่อหน่วยลงทุน 16.8798 บาท
- KFJPINDEX-I จำนวน 574.07 บาท คิดเป็นมูลค่าทรัพย์สินสุทธิต่อหน่วยลงทุน 16.9004 บาท

และมีผลการดำเนินงานย้อนหลัง 6 เดือน โดยแบ่งตามชนิดหน่วยลงทุน ได้แก่

- KFJPINDEX-A เพิ่มขึ้นร้อยละ 18.43 น้อยกว่าเกณฑ์มาตรฐานการวัดผลการดำเนินงาน ที่เพิ่มขึ้นร้อยละ 20.78
- KFJPINDEX-I เพิ่มขึ้นร้อยละ 18.53 น้อยกว่าเกณฑ์มาตรฐานการวัดผลการดำเนินงาน ที่เพิ่มขึ้นร้อยละ 20.78

ภาวะการลงทุนในช่วงที่ผ่านมา

ในรอบครึ่งปีบัญชีที่ผ่านมา NEXT FUNDS Nikkei 225 Exchange Traded Fund (กองทุนหลัก) ปรับตัวเพิ่มขึ้นประมาณ 17.8% โดยในปี 2566 ตลาดญี่ปุ่นได้รับแรงส่งจากเงินทุนต่างชาติที่ไหลเข้ามาลงทุนในญี่ปุ่น หลังตลาดหลักทรัพย์โตเกียว (Tokyo Stock Exchange) มีการประกาศมาตรการใหม่เกี่ยวกับบรรษัทภิบาล (Corporate Governance) โดยบริษัทจดทะเบียนญี่ปุ่นที่มีมูลค่าต่ำกว่า 1 เท่าของ Price to Book จำเป็นต้องชี้แจงกับนักลงทุนถึงมาตรการที่จะเพิ่มมูลค่าให้กับบริษัท ซึ่งบริษัทส่วนมากจึงหันมาเพิ่มอัตราปันผลคืนให้นักลงทุนและมีการเพิ่มการทำ Shares buyback นอกจากนี้ ตลาดญี่ปุ่นยังได้รับแรงส่งจากภาพเศรษฐกิจที่ยังทยอยฟื้นตัว โดยเฉพาะในภาคการบริโภคและภาคบริการ อีกทั้ง การส่งสัญญาณว่าธนาคารกลางญี่ปุ่น (BOJ) จะยังคงใช้นโยบายการเงินแบบผ่อนคลายต่อไปจนกว่าจะเห็นแนวโน้มเงินเฟ้อเพิ่มขึ้นอย่างชัดเจน อย่างไรก็ตาม ความผันผวนในตลาดญี่ปุ่นมีมากขึ้น หลังจากอัตราเงินเฟ้อปรับเพิ่มขึ้น ทำให้ตลาดคาดว่าทาง BOJ อาจจะมีการปรับมุมมองและรับการดำเนินนโยบายการเงินให้เข้มงวดขึ้นในช่วงครึ่งหลังของปีนี้

ณ สิ้นเดือนกรกฎาคม 2566 กองทุนหลักมีการลงทุนในหมวดเครื่องใช้ไฟฟ้า 24.5% หมวด Retail Trade 12.2% หมวด Information and Communication 10.3% และหมวดเคมีภัณฑ์ 6.7% เป็นต้น

แนวโน้มการลงทุน

การลงทุนในตลาดญี่ปุ่นมีทิศทางดีขึ้น โดยเห็นเม็ดเงินลงทุนจากนักลงทุนต่างชาติเข้ามาในญี่ปุ่นอย่างต่อเนื่องในปี 2566 โดยญี่ปุ่นเริ่มคลายมาตรการล็อกดาวน์และเปิดรับนักท่องเที่ยวต่างชาติมากขึ้น ทำให้เห็นการฟื้นตัวในฝั่งภาคบริการและการบริโภค ด้านรายได้ของบริษัทจดทะเบียนที่ญี่ปุ่นยังคงมีแนวโน้มฟื้นตัว อย่างไรก็ตาม ความผันผวนในตลาดญี่ปุ่นจะยังคงอยู่จากความเสี่ยงเรื่องเศรษฐกิจโลกชะลอตัวและอัตราเงินเฟ้อที่เพิ่มขึ้น ซึ่งอาจส่งผลให้ BOJ มีโอกาสปรับนโยบายการเงินให้เข้มงวดขึ้นได้

บริษัทฯ ใคร่ขอขอบพระคุณท่านผู้ถือหน่วยลงทุนที่ได้มอบความไว้วางใจให้บริษัทฯ เป็นผู้บริหารเงินลงทุนของท่าน ทั้งนี้ บริษัทฯ จะพิจารณาดำเนินนโยบายการลงทุนที่เหมาะสมกับสถานการณ์ด้วยความระมัดระวัง และคำนึงถึงผลประโยชน์สูงสุดของผู้ถือหน่วยลงทุนเป็นสำคัญ

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด



รายงานของผู้ดูแลผลประโยชน์

เรียน ผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุน
กองทุนเปิดกรุงศรีเจแปนอควิตี้อินเด็กซ์เฮดจ์เอฟเอ็กซ์

ตามที่ธนาคารสแตนดาร์ดชาร์เตอร์ด (ไทย) จำกัด (มหาชน) (“ธนาคารฯ”) ในฐานะผู้ดูแลผลประโยชน์ กองทุนเปิดกรุงศรีเจแปนอควิตี้อินเด็กซ์เฮดจ์เอฟเอ็กซ์ (“กองทุน”) ได้ปฏิบัติหน้าที่เป็นผู้ดูแลผลประโยชน์ของกองทุน ซึ่งบริหารและจัดการโดยบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด สำหรับรอบระยะเวลาตั้งแต่วันที่ 1 มีนาคม 2566 ถึง วันที่ 31 สิงหาคม 2566

ธนาคารฯ เห็นว่าสำหรับรอบระยะเวลาดังกล่าว บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด ได้บริหารจัดการกองทุนโดยในสาระสำคัญเป็นไปตามโครงการจัดการกองทุน ซึ่งได้รับอนุมัติจากสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ตลอดจนข้อผูกพันที่ทําไว้กับผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุนภายใต้พระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535

ธนาคารสแตนดาร์ดชาร์เตอร์ด (ไทย) จำกัด (มหาชน)

(นางสาวนุชจรินทร์ เพชรปาณีวงศ์)

ผู้อำนวยการ

ธนาคารสแตนดาร์ดชาร์เตอร์ด (ไทย) จำกัด (มหาชน)

8 กันยายน 2566

โทรศัพท์ 02-106-1160

กรุณาติดต่อ คุณสุทธานิชฐ์ ภาณุภณ *Sutthhanit*

ธนาคารสแตนดาร์ดชาร์เตอร์ด (ไทย) จำกัด (มหาชน)
140 ถนนวิทญู แขวงลุมพินี เขตปทุมวัน กรุงเทพมหานคร 10330
ทะเบียนเลขที่ 0107536000498
sc.com/th

Standard Chartered Bank (Thai) Public Company Limited
140 Wireless Road, Lumpini, Patumwan, Bangkok 10330
Registration No. 0107536000498
sc.com/th

กองทุนเปิดกรุงศรีเจแปนอควิตี้อินเด็กซ์เสดจ์เอฟเอ็กซ์

งบแสดงฐานะการเงิน

ณ 31 สิงหาคม 2566

	Unaudited (บาท)
สินทรัพย์	
เงินลงทุนตามราคายุติธรรม (ราคาทุน 141,475,591.87 บาท)	148,058,131.89
เงินฝากธนาคาร	4,832,294.44
ลูกหนี้จากสัญญาอนุพันธ์	4,830,240.42
ลูกหนี้	
จากดอกเบี้ย	2,044.12
จากการขายหน่วยลงทุน	6,678,580.23
รวมสินทรัพย์	<u>164,401,291.10</u>
หนี้สิน	
เจ้าหนี้จากสัญญาอนุพันธ์	716,799.43
เจ้าหนี้	
จากการรับซื้อคืนหน่วยลงทุน	3,495,128.40
จากการซื้อเงินลงทุน	6,439,730.98
ค่าธรรมเนียมสับเปลี่ยนหน่วยลงทุน	56,650.28
ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย	160,046.35
ภาษีเงินได้ค้างจ่าย	306.61
หนี้สินอื่น	3,701.10
รวมหนี้สิน	<u>10,872,363.15</u>
สินทรัพย์สุทธิ	<u>153,528,927.95</u>
สินทรัพย์สุทธิ:	
หน่วยลงทุนจดทะเบียน 300 ล้านหน่วย มูลค่าที่ตราไว้หน่วยละ 10 บาท	
ทุนที่ได้รับจากผู้ถือหน่วยลงทุน	90,953,740.43
กำไรสะสม	83,833,190.45
บัญชีปรับสมดุล	(21,258,002.93)
สินทรัพย์สุทธิ	<u>153,528,927.95</u>
ชนิดสะสมมูลค่า	
สินทรัพย์สุทธิ	153,528,353.88
หน่วยลงทุนที่ออกจำหน่ายแล้ว ณ วันสิ้นปี (หน่วย)	9,095,340.0748
สินทรัพย์สุทธิต่อหน่วย	16.8798
ชนิดผู้ลงทุนสถาบัน	
สินทรัพย์สุทธิ	574.07
หน่วยลงทุนที่ออกจำหน่ายแล้ว ณ วันสิ้นปี (หน่วย)	33.9678
สินทรัพย์สุทธิต่อหน่วย	16.9004

กองทุนเปิดกรุงศรีเจแปนอภิวิตีอินเค็กซ์เสดจ์เอฟเอ็กซ์
งบกำไรขาดทุนเบ็ดเสร็จ
สำหรับงวดบัญชีสิ้นสุดวันที่ 31 สิงหาคม 2566

	Unaudited (บาท)
รายได้จากการลงทุน	
รายได้ดอกเบี้ย	7,925.11
รายได้เงินปันผล	2,138,803.77
รวมรายได้	2,146,728.88
ค่าใช้จ่าย	
ค่าธรรมเนียมการจัดการ	665,359.20
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์	26,614.23
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน	133,071.72
ค่าธรรมเนียมวิชาชีพ	35,191.54
ค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์	174,074.42
รวมค่าใช้จ่าย	1,034,311.11
รายได้จากการลงทุนสุทธิ	1,112,417.77
รายการกำไร (ขาดทุน) สุทธิจากเงินลงทุน	
รายการกำไร (ขาดทุน) สุทธิที่เกิดขึ้นจากเงินลงทุน	18,252,873.09
รายการกำไร (ขาดทุน) สุทธิที่ยังไม่เกิดขึ้นจากเงินลงทุน	7,980,047.84
รายการกำไร (ขาดทุน) สุทธิที่ยังไม่เกิดขึ้นจากสัญญาอนุพันธ์	6,240,929.60
รายการกำไร (ขาดทุน) สุทธิจากอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ	(4,831,729.82)
รวมรายการกำไร (ขาดทุน) สุทธิจากเงินลงทุนที่เกิดขึ้นและยัง ไม่เกิดขึ้น	27,642,120.71
หัก ภาษีเงินได้	(1,188.75)
การเพิ่มขึ้นในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงานหลังหักภาษีเงินได้	28,753,349.73
การเพิ่มขึ้นในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงานแยกตามชนิดหน่วยลงทุน มีดังนี้	
ชนิดสะสมมูลค่า	28,753,259.98
ชนิดผู้ลงทุนสถาบัน	89.75
รวม	28,753,349.73

กองทุนเปิดกรุงศรีเจแปนอิควิตี้อินเด็คส์เฮดจ์เอฟเอชไอ

งบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน

ณ 31 สิงหาคม 2566

การแสดงรายละเอียดเงินลงทุนใช้การจัดกลุ่มตามประเภทของเงินลงทุนและประเภทของอุตสาหกรรม

ประเภทเงินลงทุน/ผู้ออกตราสาร/ผู้ออกหลักทรัพย์	หมายเลขตราสาร	อัตรา ดอกเบี้ย (%)	วันครบอายุ	เงินต้น (บาท) / จำนวนหุ้น	มูลค่ายุติธรรม (บาท)	Unaudited ร้อยละของ มูลค่าเงิน ลงทุน
หลักทรัพย์ในประเทศ						
เงินฝากออมทรัพย์						0.72
บมจ.ท.ทิสโก้		0.500000	เมื่อทวงถาม	23,709.19	23,709.19	0.02
บมจ.ธ.ยูโอบี		0.800000	เมื่อทวงถาม	1,037,566.86	1,037,566.86	0.70
หลักทรัพย์ต่างประเทศ						
หน่วยลงทุน						99.28
NEXT FUNDS Nikkei 225 Exchange Traded Fund	JP3027650005			140,414,315.82	146,996,855.84	99.28
จำนวน 18,290.000000 หน่วย						
มูลค่าหน่วยละ 33,530.0000 JPY						
รวมเป็นเงิน 613,263,700.00 JPY						
					148,058,131.89	100.00

กองทุนเปิดกรุงศรีเจแปนอควิตี้อินเตอร์เนชั่นแนลเฮดจ์เอฟเอ็กซ์

รายละเอียดการลงทุน ณ 31 สิงหาคม 2566

	มูลค่าตามราคาตลาด	% NAV
หลักทรัพย์หรือทรัพย์สินในประเทศ	5,895,614.61	3.85
เงินฝากธนาคาร		
TRIS		
Rate A	23,867.95	0.02
FITCH-LONG		
Rate A-	4,832,769.92	3.15
FITCH_TH-LONG		
Rate AAA	1,038,976.74	0.68
หลักทรัพย์หรือทรัพย์สินต่างประเทศ	146,996,855.84	95.75
หน่วยลงทุน		
จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์	146,996,855.84	95.75
สัญญาซื้อขายล่วงหน้า	4,113,440.99	2.69
สัญญาที่อ้างอิงกับอัตราแลกเปลี่ยน-สัญญาแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ		
TRIS		
Rate A+	(49,138.33)	(0.03)
FITCH-LONG		
Rate AA	4,168,818.76	2.72
Rate AA-	(6,239.44)	0.00
อื่นๆ	(3,476,983.49)	(2.29)
ลูกหนี้	6,678,580.23	4.35
เจ้าหนี้	(9,995,517.37)	(6.54)
ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย	(160,046.35)	(0.10)
มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ	153,528,927.95	100.00

กองทุนเปิดกรุงศรีเจแปนอภิวิตีอินเด็กซ์เฮดจ์เอฟเอ็กซ์

รายละเอียดการลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ณ 31 สิงหาคม 2566

ประเภทสัญญา	คู่สัญญา	วัตถุประสงค์	มูลค่าสัญญา (Notional Amount)	% NAV	วันครบกำหนด	กำไร/ขาดทุน (net gain/loss)
สัญญาที่อ้างอิงกับอัตราแลกเปลี่ยน						
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ธ.กรุงศรีอยุธยา	ป้องกันความเสี่ยง	6,423,718.70	0.0104	1 ก.ย. 2566	16,012.28
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ธ.กรุงศรีอยุธยา	ป้องกันความเสี่ยง	7,731,030.56	(0.0145)	9 ม.ค. 2567	(22,251.72)
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ธ.กสิกรไทย	ป้องกันความเสี่ยง	13,165,944.96	0.1986	11 ก.ย. 2566	304,914.19
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ธ.กสิกรไทย	ป้องกันความเสี่ยง	6,511,327.69	(0.0778)	11 ก.ย. 2566	(119,458.50)
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ธ.กสิกรไทย	ป้องกันความเสี่ยง	21,288,070.44	0.6230	11 ก.ย. 2566	956,420.56
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ธ.กสิกรไทย	ป้องกันความเสี่ยง	7,377,014.40	0.0254	10 ต.ค. 2566	39,052.99
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ธ.กสิกรไทย	ป้องกันความเสี่ยง	9,280,577.28	0.1259	10 ต.ค. 2566	193,257.13
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ธ.กสิกรไทย	ป้องกันความเสี่ยง	55,331,682.00	1.1324	6 พ.ย. 2566	1,738,506.00
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ธ.กสิกรไทย	ป้องกันความเสี่ยง	12,109,229.55	(0.0685)	6 พ.ย. 2566	(105,210.93)
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ธ.กสิกรไทย	ป้องกันความเสี่ยง	35,207,005.38	0.4874	20 พ.ย. 2566	748,303.30
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ธ.กสิกรไทย	ป้องกันความเสี่ยง	6,206,220.93	(0.0769)	20 พ.ย. 2566	(118,038.08)
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ธนาคารไทยพาณิชย์	ป้องกันความเสี่ยง	6,566,654.19	(0.0770)	11 ก.ย. 2566	(118,172.24)
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ธนาคารไทยพาณิชย์	ป้องกันความเสี่ยง	21,597,721.86	0.2657	11 ก.ย. 2566	407,934.38
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ธนาคารไทยพาณิชย์	ป้องกันความเสี่ยง	6,234,302.69	(0.0718)	11 ก.ย. 2566	(110,234.96)
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ธนาคารไทยพาณิชย์	ป้องกันความเสี่ยง	9,461,186.00	0.0919	10 ต.ค. 2566	141,115.60
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ธนาคารไทยพาณิชย์	ป้องกันความเสี่ยง	7,352,587.20	(0.0118)	10 ต.ค. 2566	(18,076.13)
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ธนาคารไทยพาณิชย์	ป้องกันความเสี่ยง	7,654,648.98	(0.0366)	20 พ.ย. 2566	(56,218.54)
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ธนาคารไทยพาณิชย์	ป้องกันความเสี่ยง	23,166,481.55	0.1855	20 พ.ย. 2566	284,723.99
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ธ.ทหารไทยธนชาติ	ป้องกันความเสี่ยง	4,131,970.70	(0.0320)	10 ต.ค. 2566	(49,138.33)

คำอธิบายการจัดอันดับตราสารของสถาบันจัดอันดับความน่าเชื่อถือ

• ตราสารหนี้ระยะกลางและระยะยาว

Moody's	S&P	TRIS	Fitch	คำอธิบาย	
Aaa	AAA	AAA	AAA	ความน่าเชื่อถือสูงที่สุด และมีความเสี่ยงต่ำที่สุด	ระดับการลงทุน (investment grade)
Aa1	AA+	AA+	AA+	ความน่าเชื่อถือสูงมาก และมีความเสี่ยงต่ำมาก	
Aa2	AA	AA	AA		
Aa3	AA-	AA-	AA-		
A1	A+	A+	A+	ความน่าเชื่อถือสูง และมีความเสี่ยงต่ำ	
A2	A	A	A		
A3	A-	A-	A-		
Baa1	BBB+	BBB+	BBB+	ความน่าเชื่อถืออยู่ในเกณฑ์พอใช้	
Baa2	BBB	BBB	BBB		
Baa3	BBB-	BBB-	BBB-		
Ba1	BB+	BB+	BB+	ความน่าเชื่อถือต่ำกว่าระดับปานกลาง	ระดับเก็งกำไร (speculative grade)
Ba2	BB	BB	BB		
Ba3	BB-	BB-	BB-		
B1	B+	B+	B+	ความน่าเชื่อถืออยู่ในเกณฑ์ต่ำมาก	
B2	B	B	B		
B3	B-	B-	B-		
Caa1	CCC+	C+	CCC	มีความเสี่ยงในการผิดนัดชำระหนี้สูงที่สุด	
Caa2	CCC				
Caa3	CCC-				
Ca	CC	C	CC		
	C	C-	C		
C	SD	RD	RD	อยู่ในสภาวะผิดนัดชำระหนี้ โดยผู้ออกตราสารหนี้ไม่สามารถชำระดอกเบี้ยและคืนเงินต้นได้ตามกำหนด	
	D	D	D		

• ตราสารหนี้ระยะสั้น

Moody's	S&P	TRIS	Fitch	คำอธิบาย
P-1	A-1	T1	F1	ผู้ออกตราสารหนี้มีสถานะทั้งทางด้านการตลาดและการเงินที่แข็งแกร่งในระดับดีมาก มีสภาพคล่องที่ดีมาก และนักลงทุนจะได้รับความคุ้มครองจากการผิดนัดชำระหนี้ที่ต่ำกว่าอันดับเครดิตในระดับอื่น
P-2	A-2	T2	F2	ผู้ออกตราสารหนี้มีสถานะทั้งทางด้านการตลาดและการเงินที่แข็งแกร่งในระดับดี และมีความสามารถในการชำระหนี้ระยะสั้นในระดับที่น่าพอใจ
P-3	A-3	T3	F3	ผู้ออกตราสารหนี้มีความสามารถในการชำระหนี้ระยะสั้นในระดับที่ยอมรับได้
	B	T4	B	มีความสามารถในการชำระหนี้ระยะสั้นที่ค่อนข้างอ่อนแอ ผู้ออกแสดงถึงความไม่แน่นอนอย่างสูงของความสามารถในการชำระหนี้ได้ตรงตามกำหนดเวลาที่ระบุไว้
	C		C	
	D	D	D	เป็นระดับที่อยู่ในสภาวะผิดนัดชำระหนี้ โดยผู้ออกตราสารหนี้ไม่สามารถชำระดอกเบี้ยและคืนเงินต้นได้ตามกำหนด

หมายเหตุ

- เครื่องหมายบวก (+) หรือ ลบ (-) หรือเลข 1 ถึง 3 ต่อท้ายนั้น เพื่อจำแนกความแตกต่างของคุณภาพของอันดับเครดิตภายในระดับเดียวกัน
- คำเสริมท้าย (tha) จะระบุไว้ต่อจากอันดับเครดิตเพื่อบอกถึงอันดับเครดิตภายในประเทศสำหรับประเทศไทย

ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (Fund's Direct Expenses)

กองทุนเปิดกรุงศรีเจแปนอควิตี้อินเด็กซ์เสดจ์เอฟเอ็กซ์

ตั้งแต่วันที่ 1 มีนาคม 2566 ถึงวันที่ 31 สิงหาคม 2566

ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (Fund's Direct Expenses)	จำนวนเงิน (หน่วย: พันบาท)	ร้อยละของมูลค่า ทรัพย์สิน* (ต่อปี) 1/
ค่าธรรมเนียมการจัดการ (Management Fee)	665.36	0.8025
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ (Trustee Fee)	26.61	0.0321
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน (Registrar Fee)	133.07	0.1605
ค่าที่ปรึกษาการลงทุน (Advisory Fee)	-	-
ค่าธรรมเนียมสอบบัญชี (Auditing Fee)	35.19	0.0425
ค่าใช้จ่ายอื่น ๆ (Others)	-	-
รวมค่าใช้จ่ายทั้งหมด 2/	860.23	1.0376

หมายเหตุ

1/ ค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวมข้างต้น เป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่มหรือภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว

2/ ไม่รวมค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ และค่าธรรมเนียมต่าง ๆ ที่เกิดขึ้นจากการซื้อขายหลักทรัพย์

* มูลค่าทรัพย์สิน ในที่นี้ หมายถึง มูลค่าทรัพย์สินทั้งหมด หักด้วย มูลค่าหนี้สินทั้งหมด

เว้นแต่ค่าธรรมเนียมการจัดการ ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ ค่าธรรมเนียมนายทะเบียนหน่วยลงทุน

และค่าใช้จ่ายที่เกี่ยวข้องกับการปฏิบัติการกองทุน ณ วันที่คำนวณ

ค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์

กองทุนเปิดกรุงศรีเจแปนอควิตี้อินเด็กซ์เฮดจ์เอฟเอ็กซ์ / Krungsri Japan Equity Index Hedged FX Fund

ตั้งแต่วันที่ 1 มีนาคม 2566 ถึงวันที่ 31 สิงหาคม 2566

บริษัท	จำนวนเงิน	อัตราส่วน
	(เยน)	(%)
Maybank Securities Pte. Ltd	1,523,571.00	100.00
รวม / Total	1,523,571.00	100.00

ผลการดำเนินงานของกองทุนเปิดกรุงศรีเจแปนอิควิตีอินเด็กซ์เฮดจ์เอฟเอ็กซ์

ผลการดำเนินงาน สิ้นสุด ณ วันที่ 31 สิงหาคม 2566	% ตามช่วงเวลา			% ต่อปี				นับจากวันเริ่ม โครงการ (31 มีนาคม 2560)
	Year to Date	ย้อนหลัง 3 เดือน	ย้อนหลัง 6 เดือน	ย้อนหลัง 1 ปี	ย้อนหลัง 3 ปี	ย้อนหลัง 5 ปี	ย้อนหลัง 10 ปี	
KFJPINDX-A	24.20%	5.21%	18.43%	16.25%	11.93%	7.09%	N/A	8.49%
ดัชนีชี้วัด (Benchmark)*	27.26%	6.61%	20.78%	18.38%	13.74%	9.01%	N/A	10.32%
ความผันผวนของผลการดำเนินงาน	14.21%	15.87%	14.79%	15.41%	16.89%	18.53%	N/A	17.47%
ความผันผวนของดัชนีชี้วัด	15.97%	18.49%	15.25%	16.22%	15.97%	19.51%	N/A	18.50%

ผลการดำเนินงาน สิ้นสุด ณ วันที่ 31 สิงหาคม 2566	% ตามช่วงเวลา			% ต่อปี				นับจากวันเริ่ม โครงการ (2 ธันวาคม 2564)
	Year to Date	ย้อนหลัง 3 เดือน	ย้อนหลัง 6 เดือน	ย้อนหลัง 1 ปี	ย้อนหลัง 3 ปี	ย้อนหลัง 5 ปี	ย้อนหลัง 10 ปี	
KFJPINDX-I	24.34%	5.26%	18.53%	N/A	N/A	N/A	N/A	14.81%
ดัชนีชี้วัด (Benchmark)*	27.26%	6.61%	20.78%	N/A	N/A	N/A	N/A	16.46%
ความผันผวนของผลการดำเนินงาน	14.21%	15.78%	14.79%	N/A	N/A	N/A	N/A	14.29%
ความผันผวนของดัชนีชี้วัด	15.97%	18.49%	15.25%	N/A	N/A	N/A	N/A	16.38%

หมายเหตุ : * ดัชนีชี้วัด (Benchmark) คือ ดัชนี Nikkei 225 ในสกุลเงินเยน ปรับด้วยต้นทุนการป้องกันความเสี่ยงด้านอัตราแลกเปลี่ยนเพื่อ
เทียบเท่าค่าสกุลเงินบาท ณ วันที่คำนวณผลตอบแทน

** ผลตอบแทนที่มีอายุเกินหนึ่งปีจะแสดงเป็นผลตอบแทนต่อปี

เอกสารการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวมฉบับนี้ ได้จัดทำตามมาตรฐานการวัดผลการดำเนินงานของ
กองทุนรวมของสมาคมบริษัทจัดการลงทุน

ข้อมูลอื่นๆ ที่ผู้ถือหน่วยลงทุนควรทราบ

(1) รายงานบุคคลที่เกี่ยวข้องที่มีการทำธุรกรรมในรอบเวลาที่ผ่านมา (วันที่ 1 มีนาคม 2566 ถึงวันที่ 31 สิงหาคม 2566)

ชื่อกองทุน	รายชื่อบุคคลที่เกี่ยวข้อง
กองทุนเปิดกรุงศรีเจแปนอควิตี้อินเต็กซ์เสดจ์เอฟเอ็กซ์	1. ธนาคารกรุงศรีอยุธยา จำกัด (มหาชน) 2. บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด

หมายเหตุ: ผู้ลงทุนสามารถตรวจสอบการทำธุรกรรมกับบุคคลที่เกี่ยวข้องกับกองทุนรวมได้ที่บริษัทจัดการ โดยตรง หรือที่ web site ของ บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด (<http://www.krungsriasset.com>) และสำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ต. (<http://www.sec.or.th>)

(2) รายชื่อผู้จัดการกองทุน ณ วันที่ 31 สิงหาคม 2566

- นายทลิต โสคติพย์พัฒนา
- นายสาธิต บัวชู
- นางสาวสาวิณี สุขศรีวงศ์
- นายปิติ ประดิพัทธ์พงษ์
- นายกวิพ เจริญเสาวภาคย์
- นายจาตุรันต์ สอนไว
- นายชูศักดิ์ อวยพรชัยสกุล
- นายพงศ์สันต์ อนุรัตน์
- นางสาววรรดา ตันติสุนทร
- นายวัชรินทร์ ค้วงสังข์

(3) การเปิดเผยข้อมูลการถือหน่วยลงทุนเกิน 1 ใน 3 ณ วันที่ 31 สิงหาคม 2566

ไม่มีการถือหน่วยลงทุนเกิน 1 ใน 3 ของบุคคลใดบุคคลหนึ่ง

ผู้ถือหน่วยลงทุนสามารถตรวจสอบข้อมูลสัดส่วนการถือหน่วยลงทุนโดยตรงได้ที่ www.krungsriasset.com

(4) อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุนของกองทุน (portfolio turnover ratio) ในรอบระยะเวลาที่ผ่านมา

- KFJPINDEX-A (portfolio turnover ratio) เท่ากับ 152.53%
- KFJPINDEX-I (portfolio turnover ratio) เท่ากับ 152.53%

(5) ผลการดำเนินงานและข้อมูลการลงทุนของกองทุนหลัก (ข้อมูล ณ วันที่ 31/08/2023)

Return	1 month	3 months	6 months	1 year	3 years	Since Incep.
NAV (dividend re-invested)	-1.6%	5.8%	20.1%	18.6%	48.5%	264.3%

(Since Inception 7/9/2001)

- NAV in the above chart refers to NAV Per Unit for the purpose of comparison with the benchmark index.
- Benchmark Index return is calculated without dividends.
- The price movement and return rate of the NAV (dividend re-invested) is calculated based on the Fund value after deduction of the management fee, and based on the assumption that the dividends before taxes are re-invested. Therefore, the actual performance of the Fund will vary depending upon the tax status of the investor. Also, expenses and taxes when liquidating the Fund are not considered.
- For each calculation period of the return rate, last business day of the month is used.

Top 10 Holdings		Sector	(% of NAV)
9983	FAST RETAILING CO.,LTD.	RETAIL TRADE	10.3%
8035	TOKYO ELECTRON LIMITED	ELECTRIC APPLIANCES	6.6%
9984	SOFTBANK GROUP CORP.	INFORMATION & COMMUNICATION	4.0%
6857	ADVANTEST CORPORATION	ELECTRIC APPLIANCES	3.7%
9433	KDDI CORPORATION	INFORMATION & COMMUNICATION	2.7%
6367	DAIKIN INDUSTRIES,LTD.	MACHINERY	2.6%
4063	SHIN-ETSU CHEMICAL CO.,LTD.	CHEMICALS	2.4%
6954	FANUC CORPORATION	ELECTRIC APPLIANCES	2.1%
4543	TERUMO CORPORATION	PRECISION INSTRUMENTS	1.8%
6762	TDK CORPORATION	ELECTRIC APPLIANCES	1.6%
Total			37.8%

Number of Holdings :
225

•Sector references are based on the TSE 33 Sector Classification.

Fund Composition

Sector Allocation	(% of NAV)
ELECTRIC APPLIANCES	24.2%
RETAIL TRADE	11.8%
INFORMATION & COMMUNICATION	10.2%
CHEMICALS	6.8%
PHARMACEUTICAL	6.8%
Others	38.6%
Total	98.3%

Asset Allocation	
Stocks	98.3%
Call Loan, Others	1.7%
(Index Futures	1.7%)

Portfolio Characteristics	
Dvidend Yield (annual)	1.8%

•The Fund's dividend yield is calculated based on the weighted average of individual dividend yields of the constituent stocks (before taxation, actual dividend basis).