



krungsri

Asset
Management

Make Life
Simple

A member of  MUFG
a global financial group

รายงานประจำปีแรก 2563

รอบระยะเวลาตั้งแต่วันที่ 1 พฤศจิกายน 2562 – 30 เมษายน 2563

กองทุนรวม

KFPREFER

กองทุนเปิดกรุงศรีพรีเมียร์มิกซ์เฮดจ์เอฟเอ็กซ์

Krungsri Preferred Mix Hedged FX Fund

กองทุนนี้มีการแบ่งชนิดหน่วยลงทุนเป็น 2 ชนิด ได้แก่

1. หน่วยลงทุนชนิดสะสมมูลค่า :

กองทุนเปิดกรุงศรีพรีเมียร์มิกซ์เฮดจ์เอฟเอ็กซ์-สะสมมูลค่า (KFPREFER-A)

บริษัทจัดการเปิดขายหน่วยลงทุนชนิดนี้ตั้งแต่ช่วงการเสนอขายหน่วยลงทุนครั้งแรก และภายหลังการเสนอขายหน่วยลงทุนครั้งแรก จนถึงปัจจุบัน

2. หน่วยลงทุนชนิดจ่ายเงินปันผล :

กองทุนเปิดกรุงศรีพรีเมียร์มิกซ์เฮดจ์เอฟเอ็กซ์-ปันผล (KFPREFER-D)

บริษัทจัดการยังไม่เปิดขายหน่วยลงทุนชนิดนี้

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

อาคารเพลินจิตทาวเวอร์ 898 ถนนเพลินจิต แขวงลุมพินี

เขตปทุมวัน กรุงเทพฯ 10330

โทรศัพท์ +66 (0) 2657 5757 โทรสาร +66 (0) 2657 5777

www.krungsriasset.com

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด

รายงานประจำปีครั้งที่ 2563

กองทุนเปิดกรุงศรีฟิฟธ์มิคส์เฮดจ์เอฟเอ็กซ์

• สารบัญจัดการ	3
• รายงานผู้ดูแลผลประโยชน์	4
• งบดุล งบกำไรขาดทุน และงบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน	5
• รายละเอียดเงินลงทุน การกู้ยืมเงิน และการก่อภาระผูกพันของกองทุนรวม	8
• ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม	11
• ผลการดำเนินงาน	12
• ข้อมูลอื่นๆ ที่ผู้ถือหน่วยลงทุนควรทราบ	13
- รายงานบุคคลที่เกี่ยวข้องที่มีการทำธุรกรรมในรอบเวลาที่ผ่านมา	
- รายชื่อผู้จัดการกองทุน	
- การเปิดเผยข้อมูลการถือหน่วยลงทุนเกิน 1 ใน 3	
- อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุนของกองทุน	
- ข้อมูลการลงทุน และผลการดำเนินงานของกองทุนหลัก	

สารบัญชจัดการ

เรียน ผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุน

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด (บริษัทฯ) ขอส่งรายงานสำหรับรอบระยะเวลา 6 เดือน ของกองทุนเปิดกรุงศรีพรีเมียร์มิกซ์เฮดจ์เอฟเอ็กซ์ (KFPREFER) ตั้งแต่วันที่ 1 พฤศจิกายน 2562 ถึงวันที่ 30 เมษายน 2563 มายังผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุน โดยมีรายละเอียดดังนี้

ผลการดำเนินงาน

กองทุนเปิดกรุงศรีพรีเมียร์มิกซ์เฮดจ์เอฟเอ็กซ์ มีมูลค่าทรัพย์สินสุทธิ ณ วันที่ 30 เมษายน 2563 เท่ากับ 2,612.27 ล้านบาท คิดเป็นมูลค่าทรัพย์สินสุทธิต่อหน่วยลงทุนเท่ากับ 8.9552 บาท โดยมีผลการดำเนินงานตั้งแต่จัดตั้งกองทุน ลดลงร้อยละ 10.45

ภาวะการลงทุนในช่วงที่ผ่านมา

ในรอบ 6 เดือนที่ผ่านมา กองทุนหลัก Manulife Global Fund – Preferred Securities Income Fund ปรับตัวลดลง 9.0% เนื่องจากความกังวลที่เพิ่มขึ้นเกี่ยวกับผลกระทบจากการแพร่ระบาดของ COVID-19 ส่งผลให้เกิดแรงเทขายในตลาดการเงินทั่วโลก ในช่วงสัปดาห์สุดท้ายของเดือนกุมภาพันธ์ 2563 ซึ่งสภาพคล่องในตลาดปรับตัวลดลงอย่างมาก โดย Preferred Market เผชิญแรงขายของกลุ่มนักลงทุนรายย่อยในกองทุน ETF ขนาดใหญ่ ส่งผลให้ตลาดสำหรับนักลงทุนรายย่อยที่มีราคาพาร์ 25 ดอลลาร์ปรับตัวลงมากกว่าตลาดโดยรวม ขณะที่ตลาดของนักลงทุนสถาบันที่มีราคาพาร์ 1,000 ดอลลาร์ปรับตัวลดลงน้อยกว่า ซึ่งแรงเทขายดังกล่าวส่งผลต่อการลงทุนของกองทุนหลักในกลุ่มผู้ผลิตไฟฟ้า พลังงาน และประกัน อย่างไรก็ตาม อย่างไรก็ดี ตลาดหุ้นโลกและตลาดตราสารหนี้ภาคเอกชนฟื้นตัวขึ้นหลังจากธนาคารกลางสหรัฐฯ (Fed) ดำเนินมาตรการกระตุ้นครั้งใหม่ในการสนับสนุนเศรษฐกิจด้วยการปรับเพิ่มจำนวนเงินในการเข้าซื้อและปรับเงื่อนไขให้สามารถซื้อตราสารหนี้ภาคเอกชน ส่งผลให้ Sentiment และสภาพคล่องในตลาดปรับตัวดีขึ้น และ Preferred Market เริ่มฟื้นตัวนำโดยกลุ่มพลังงานและผู้ผลิตไฟฟ้า โดยกองทุนหลักมีมุมมองเชิงบวกต่อการลงทุนในบริษัทผู้ผลิตไฟฟ้าเนื่องจากได้รับผลกระทบน้อยจากการแพร่ระบาดของไวรัส COVID-19 โดยความต้องการใช้ไฟฟ้าภาคอุตสาหกรรมมีแนวโน้มปรับตัวลดลง ทว่าในขณะเดียวกันความต้องการของกลุ่มที่อยู่อาศัยปรับตัวสูงขึ้นจากการที่แรงงานจำนวนมากทำงานจากบ้าน และกำไรขั้นต้นของลูกค้ากลุ่มที่อยู่อาศัยสูงกว่าภาคอุตสาหกรรม 2-3 เท่า นอกจากนี้ กองทุนหลักอาศัยประโยชน์จากความผิดปกติของตลาดในการเพิ่มสัดส่วนการลงทุนในหมวดสื่อสาร ซึ่งไม่ได้รับผลกระทบจากราคาน้ำมัน แต่ได้รับประโยชน์จากการปิดเมืองทั่วโลก

ณ สิ้นเดือน มีนาคม 2563 กองทุนหลักมีสัดส่วนการลงทุนในสหรัฐฯ 72.9% แคนาดา 9.1% และสหราชอาณาจักร 3.6% โดยมีการลงทุนในอุตสาหกรรมผู้ผลิตไฟฟ้า 29.3% ประกัน 14.8% และพลังงาน 9.5% เป็นต้น

แนวโน้มการลงทุน

บริษัทฯ มีมุมมองการลงทุนเชิงบวกต่อการลงทุนใน Preferred Market ซึ่งมีแนวโน้มฟื้นตัวในช่วง 6-12 เดือนข้างหน้า เนื่องจากทิศทางดอกเบี้ยจะอยู่ในระดับต่ำเป็นเวลานานจากผลกระทบของการแพร่ระบาดไวรัส COVID-19 ซึ่งส่งผลบวกต่อกองทุน และเมื่อพิจารณาจากส่วนต่างอัตราดอกเบี้ยของ Preferred Market กับพันธบัตรรัฐบาลสหรัฐฯ อายุ 10 ปี อยู่ในระดับน่าดึงดูด นอกจากนี้คุณภาพสินเชื่อของหลักทรัพย์ที่กองทุนหลักลงทุนยังคงมีความแข็งแกร่ง การปรับตัวลดลงที่เกิดขึ้นนี้จะไม่กินเวลายาวนานและรุนแรงเท่ากับที่เกิดขึ้นในวิกฤตการเงินช่วงปี 2551 – 2552 ส่วนหนึ่งมาจากการดำเนินนโยบายสนับสนุนของรัฐบาลสหรัฐฯ และความเข้มแข็งของระบบธนาคารสหรัฐฯ โดยในระหว่างวิกฤตการเงินปี 2551 – 2552 ภาคธนาคารถูกมองว่าเป็นปัญหาพื้นฐานของระบบเศรษฐกิจ ปัจจุบันธนาคารของสหรัฐฯ มีปัจจัยพื้นฐานเข้มแข็ง มีฐานเงินทุนและสภาพคล่องอย่างแข็งแกร่ง และมีแนวโน้มจะเป็นศูนย์กลางในการสนับสนุนเศรษฐกิจในช่วงเวลาที่ยากลำบากนี้

บริษัทฯ ขอขอบพระคุณท่านผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุนที่ได้มอบความไว้วางใจให้บริษัทฯ เป็นผู้บริหารเงินลงทุนของท่าน ทั้งนี้ บริษัทฯ จะพิจารณาดำเนินนโยบายการลงทุนที่เหมาะสมกับสถานการณ์ด้วยความระมัดระวัง และคำนึงถึงผลประโยชน์สูงสุดของผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุนเป็นสำคัญ

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด



รายงานความเห็นของผู้ดูแลผลประโยชน์

เสนอ ผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุนกองทุนเปิดกรุงศรีพรีเมียมส์เฮดจ์เอฟเอ็กซ์

ตามที่ธนาคารไทยพาณิชย์ จำกัด (มหาชน) ในฐานะผู้ดูแลผลประโยชน์กองทุนเปิดกรุงศรีพรีเมียมส์เฮดจ์เอฟเอ็กซ์ ซึ่งมีบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด เป็นผู้จัดการกองทุน ได้ปฏิบัติหน้าที่ดูแลผลประโยชน์ของกองทุนดังกล่าว สำหรับระยะเวลาตั้งแต่วันที่ 1 พฤศจิกายน 2562 ถึงวันที่ 30 เมษายน 2563 แล้วนั้น

ธนาคารฯ เห็นว่าบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด ได้ปฏิบัติหน้าที่ในการจัดการกองทุนเปิดกรุงศรีพรีเมียมส์เฮดจ์เอฟเอ็กซ์ โดยถูกต้องตามที่ควรตามวัตถุประสงค์ที่ได้กำหนดไว้ในโครงการจัดการที่ได้รับอนุมัติจากสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ และภายใต้พระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535

ขอแสดงความนับถือ

ธนาคารไทยพาณิชย์ จำกัด (มหาชน)

(นางสาวเชาวนี แสงพงษ์นภา)

ผู้จัดการบริการผู้ดูแลผลประโยชน์

กองทุนเปิดกรุงศรีฟรียูเออร์มิกซ์เฮดจ์เอฟเอ็กซ์

งบดุล

ณ 30 เมษายน 2563

Unaudited

(บาท)

สินทรัพย์	
เงินลงทุนตามราคายุติธรรม (ราคาทุน 2,941,809,828.35 บาท)	2,656,739,172.99
เงินฝากธนาคาร	3,540,089.29
ลูกหนี้	
จากดอกเบี้ย	253,158.75
จากการขายหน่วยลงทุน	1,980.21
จากการรับเงินค่าตอบแทนจากเงินลงทุนในต่างประเทศ	1,192,717.00
รวมสินทรัพย์	2,661,727,118.24
หนี้สิน	
เจ้าหนี้สัญญาแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ	46,849,244.09
เจ้าหนี้	
จากการรับซื้อคืนหน่วยลงทุน	608,650.95
ค่าธรรมเนียมสับเปลี่ยนหน่วยลงทุน	180,634.81
ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย	1,753,920.78
ภาษีเงินได้ค้างจ่าย	37,973.81
หนี้สินอื่น	27,762.58
หนี้สินรวม	49,458,187.02
สินทรัพย์สุทธิ	2,612,268,931.22
สินทรัพย์สุทธิ:	
หน่วยลงทุนจดทะเบียน 10,000 ล้านหน่วย มูลค่าที่ตราไว้หน่วยละ 10 บาท	
ทุนที่ได้รับจากผู้ถือหน่วยลงทุน	2,917,021,878.06
กำไรสะสม	(426,439,680.25)
บัญชีปรับสมดุล	121,686,733.41
สินทรัพย์สุทธิ	2,612,268,931.22
สินทรัพย์สุทธิต่อหน่วย	8.9552
จำนวนหน่วยลงทุนที่จำหน่ายได้ทั้งหมด ณ วันสิ้นงวด (หน่วย)	291,702,187.8064
ชนิดสะสมมูลค่า	
สินทรัพย์สุทธิ	2,612,268,931.22
หน่วยลงทุนที่ออกจำหน่ายแล้ว ณ วันสิ้นปี (หน่วย)	291,702,187.8064
สินทรัพย์สุทธิต่อหน่วย	8.9552

กองทุนเปิดกรุงศรีฟรียูเอเอ็มจีแอสเอพีเอ็มจี
งบกำไรขาดทุน
สำหรับงวดบัญชีสิ้นสุดวันที่ 30 เมษายน 2563

	Unaudited (บาท)
รายได้จากการลงทุน	
รายได้ดอกเบี้ย	529,007.91
รายได้จากการรับเงินค่าตอบแทนจากเงินลงทุนในต่างประเทศ	6,217,377.49
รายได้ทั้งสิ้น	<u>6,746,385.40</u>
ค่าใช้จ่าย	
ค่าธรรมเนียมการจัดการ	7,057,944.31
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์	382,305.33
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน	1,764,486.08
ค่าธรรมเนียมสอบบัญชี	34,809.03
ภาษีเงินได้	<u>56,051.68</u>
ค่าใช้จ่ายทั้งสิ้น	<u>9,295,596.43</u>
รายได้จากการลงทุนสุทธิ	<u>(2,549,211.03)</u>
รายการกำไร (ขาดทุน) สุทธิจากเงินลงทุน	
รายการกำไร (ขาดทุน) สุทธิที่เกิดขึ้นทั้งสิ้น	(91,970,569.77)
รายการกำไร (ขาดทุน) สุทธิที่ยังไม่เกิดขึ้นทั้งสิ้น	(331,919,899.45)
รวมรายการกำไร (ขาดทุน) ที่เกิดขึ้นและยังไม่ได้เกิดขึ้น	<u>(423,890,469.22)</u>
การเพิ่มขึ้นในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงาน	<u><u>(426,439,680.25)</u></u>

กองทุนเปิดกรุงศรีพรีเมียม็กซ์เฮดจ์เอฟเอ็กซ์

งบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน

ณ 30 เมษายน 2563

การแสดงรายละเอียดเงินลงทุนใช้การจัดกลุ่มตามประเภทของเงินลงทุนและประเภทของอุตสาหกรรม

						Unaudited
ประเภทเงินลงทุน/ผู้ออกตราสาร/ผู้ออกหลักทรัพย์	หมายเลขตราสาร	อัตราดอกเบี้ย (%)	วันครบอายุ	เงินต้น (บาท) / จำนวนหุ้น	มูลค่ายุติธรรม (บาท)	ร้อยละของมูลค่าเงินลงทุน
หลักทรัพย์ในประเทศ						
เงินฝากออมทรัพย์						3.95
บมจ.บ.ทีสโก้		0.300000	เมื่อทวงถาม	63,000,000.00	63,000,000.00	2.37
บมจ.บ.ยูโอบี		0.300000	เมื่อทวงถาม	42,008,296.23	42,008,296.23	1.58
หลักทรัพย์ต่างประเทศ						
หน่วยลงทุน						96.05
Manulife Global Fund - Preferred Securities						
Income Fund (Class AA (USD))	MLPIAAULX			2,836,801,532.12	2,551,730,876.76	96.05
จำนวน 80,080,053.251000 หน่วย						
มูลค่าหน่วยละ 0.9850 USD						
รวมเป็นเงิน 78,878,852.45 USD						
					2,656,739,172.99	100.00

กองทุนเปิดกรุงศรีพรีเมียร์มิคซ์เฮดจ์เอฟเอ็กซ์

รายละเอียดการลงทุน ณ 30 เมษายน 2563

	มูลค่าตามราคาตลาด	% NAV
หลักทรัพย์หรือทรัพย์สินในประเทศ	108,801,544.27	4.17
เงินฝากธนาคาร		
TRIS		
Rate A	63,028,563.01	2.41
FITCH_TH-LONG		
Rate AAA	42,212,330.21	1.62
Rate BBB	3,560,651.05	0.14
หลักทรัพย์หรือทรัพย์สินต่างประเทศ	2,551,730,876.76	97.68
หน่วยลงทุน		
ไม่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์	2,551,730,876.76	97.68
สัญญาซื้อขายล่วงหน้า	(46,849,244.09)	(1.80)
สัญญาที่อ้างอิงกับอัตราแลกเปลี่ยน-สัญญาแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ		
TRIS		
Rate A+	(5,009,819.29)	(0.19)
Rate A	631,276.00	0.02
FITCH-LONG		
Rate AA	(26,785,362.62)	(1.03)
Rate AA-	(15,685,338.18)	(0.60)
อื่นๆ	(1,414,245.72)	(0.05)
ลูกหนี้	1,194,697.21	0.05
เจ้าหนี้	(855,022.15)	(0.03)
ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย	(1,753,920.78)	(0.07)
มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ	2,612,268,931.22	100.00

กองทุนเปิดกรุงศรีฟรียูเอมิกซ์เฮดจ์เอฟเอ็กซ์

รายละเอียดการลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ณ 30 เมษายน 2563

ประเภทสัญญา	คู่สัญญา	วัตถุประสงค์	มูลค่าสัญญา (Notional Amount)	% NAV	วันครบกำหนด	กำไร/ขาดทุน (net gain/loss)
สัญญาที่อ้างอิงกับอัตราแลกเปลี่ยน						
สัญญาฟอว์เวิร์ด	บมจ.ธ.กรุงศรีอยุธยา	ป้องกันความเสี่ยง	163,273,543.80	(0.2524)	22 พ.ค. 2563	(6,593,134.60)
สัญญาฟอว์เวิร์ด	บมจ.ธ.กรุงศรีอยุธยา	ป้องกันความเสี่ยง	191,595,403.80	(0.2927)	29 พ.ค. 2563	(7,645,074.32)
สัญญาฟอว์เวิร์ด	บมจ.ธ.กรุงศรีอยุธยา	ป้องกันความเสี่ยง	90,827,827.20	(0.1094)	5 มิ.ย. 2563	(2,856,669.42)
สัญญาฟอว์เวิร์ด	บมจ.ธ.กรุงศรีอยุธยา	ป้องกันความเสี่ยง	116,316,633.60	0.0540	12 มิ.ย. 2563	1,409,540.16
สัญญาฟอว์เวิร์ด	บมจ.ธ.กสิกรไทย	ป้องกันความเสี่ยง	87,636,294.00	(0.1373)	22 พ.ค. 2563	(3,587,697.06)
สัญญาฟอว์เวิร์ด	บมจ.ธ.กสิกรไทย	ป้องกันความเสี่ยง	83,322,803.20	(0.0697)	29 พ.ค. 2563	(1,819,546.34)
สัญญาฟอว์เวิร์ด	บมจ.ธ.กสิกรไทย	ป้องกันความเสี่ยง	115,511,415.00	(0.1229)	5 มิ.ย. 2563	(3,209,315.91)
สัญญาฟอว์เวิร์ด	บมจ.ธ.กสิกรไทย	ป้องกันความเสี่ยง	200,252,768.80	(0.1345)	5 มิ.ย. 2563	(3,514,237.30)
สัญญาฟอว์เวิร์ด	บมจ.ธ.เกียรตินาคิน	ป้องกันความเสี่ยง	126,136,860.00	0.0242	28 ส.ค. 2563	631,276.00
สัญญาฟอว์เวิร์ด	บมจ.ธ.ไทยพาณิชย์	ป้องกันความเสี่ยง	67,792,863.60	(0.1020)	8 พ.ค. 2563	(2,665,116.23)
สัญญาฟอว์เวิร์ด	บมจ.ธ.ไทยพาณิชย์	ป้องกันความเสี่ยง	290,151,770.00	(0.4590)	15 พ.ค. 2563	(11,989,449.78)
สัญญาฟอว์เวิร์ด	บมจ.ธ.ทหารไทย	ป้องกันความเสี่ยง	131,272,331.00	(0.0743)	22 พ.ค. 2563	(1,941,688.67)
สัญญาฟอว์เวิร์ด	บมจ.ธ.ทหารไทย	ป้องกันความเสี่ยง	124,200,668.60	(0.1964)	22 พ.ค. 2563	(5,129,973.73)
สัญญาฟอว์เวิร์ด	บมจ.ธ.ทหารไทย	ป้องกันความเสี่ยง	114,632,037.50	(0.1503)	29 พ.ค. 2563	(3,926,889.91)
สัญญาฟอว์เวิร์ด	บมจ.ธ.ทหารไทย	ป้องกันความเสี่ยง	73,145,435.00	0.0075	12 มิ.ย. 2563	196,773.56
สัญญาฟอว์เวิร์ด	บมจ.ธ.ทหารไทย	ป้องกันความเสี่ยง	120,422,723.00	0.0022	10 ก.ค. 2563	56,272.68
สัญญาฟอว์เวิร์ด	บมจ.ธ.ทหารไทย	ป้องกันความเสี่ยง	143,820,652.00	0.0496	10 ก.ค. 2563	1,295,905.94
สัญญาฟอว์เวิร์ด	บมจ.ธ.ทหารไทย	ป้องกันความเสี่ยง	235,857,904.00	0.1331	31 ก.ค. 2563	3,476,445.36
สัญญาฟอว์เวิร์ด	บมจ.ธ.ทหารไทย	ป้องกันความเสี่ยง	108,481,692.00	0.0244	31 ก.ค. 2563	636,510.61
สัญญาฟอว์เวิร์ด	บมจ.ธ.ทหารไทย	ป้องกันความเสี่ยง	84,524,616.00	0.0125	28 ส.ค. 2563	326,824.87

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)

กองทุนเปิดกรุงศรีฟรียูเออร์มิกซ์เฮดจ์เอฟเอ็กซ์

ตั้งแต่วันที่ 1 พฤศจิกายน 2562 ถึงวันที่ 30 เมษายน 2563

ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (Fund's Direct Expenses)	จำนวนเงิน หน่วย: พันบาท	ร้อยละของมูลค่า ทรัพย์สิน* (ต่อปี) 1/
ค่าธรรมเนียมการจัดการ (Management Fee)	7,057.94	0.6420
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ (Trustee Fee)	382.31	0.0348
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน (Registrar Fee)	1,764.49	0.1605
ค่าที่ปรึกษาการลงทุน (Advisory Fee)	-	-
ค่าธรรมเนียมสอบบัญชี (Auditing Fee)	34.81	0.0032
ค่าใช้จ่ายอื่น ๆ (Others)	-	-
รวมค่าใช้จ่ายทั้งหมด 2/	9,239.55	0.8405

หมายเหตุ

1/ ค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวมข้างต้น เป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่มหรือภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว

2/ ไม่รวมค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ และค่าธรรมเนียมต่าง ๆ ที่เกิดขึ้นจากการซื้อขายหลักทรัพย์

* มูลค่าทรัพย์สิน ในที่นี้ หมายถึง มูลค่าทรัพย์สินทั้งหมด หักด้วย มูลค่าหนี้สินทั้งหมด

เว้นแต่ค่าธรรมเนียมการจัดการ ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ ค่าธรรมเนียมนายทะเบียนหน่วยลงทุน

และค่าใช้จ่ายที่เกี่ยวข้องกับการปฏิบัติการกองทุน ณ วันที่คำนวณ

ผลการดำเนินงานของกองทุนเปิดกรุงศรีพรีเมียมมิกซ์เฮดจ์เอฟแอล

ผลการดำเนินงาน สิ้นสุด ณ วันที่ 30 เมษายน 2563	% ตามช่วงเวลา			% ต่อปี				
	Year to Date	ย้อนหลัง 3 เดือน	ย้อนหลัง 6 เดือน	ย้อนหลัง 1 ปี	ย้อนหลัง 3 ปี	ย้อนหลัง 5 ปี	ย้อนหลัง 10 ปี	นับจากวันเริ่ม โครงการ (1 พฤศจิกายน 2562)
KFPREFER-A	-11.48%	-12.85%	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	-10.45%
ดัชนีชี้วัด (Benchmark)*	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
ความผันผวนของผลการดำเนินงาน	34.53%	40.21%	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	28.42%
ความผันผวนของตัวชี้วัด	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A

หมายเหตุ : * ดัชนีชี้วัด (Benchmark) คือ ไม่มี ซึ่งสอดคล้องกับกองทุนหลักที่ไม่มีตัวชี้วัดเช่นเดียวกัน

** ผลตอบแทนที่มีอายุเกินหนึ่งปีจะแสดงเป็นผลตอบแทนต่อปี

เอกสารการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวมฉบับนี้ ได้จัดทำตามมาตรฐานการวัดผลการดำเนินงานของ
กองทุนรวมของสมาคมบริษัทจัดการลงทุน

ข้อมูลอื่นๆ ที่ผู้ถือหุ้นควรทราบ

(1) รายงานบุคคลที่เกี่ยวข้องที่มีการทำธุรกรรมในรอบเวลาที่ผ่านมา (วันที่ 1 พฤศจิกายน 2562 ถึงวันที่ 30 เมษายน 2563)

ชื่อกองทุน	รายชื่อบุคคลที่เกี่ยวข้อง
กองทุนเปิดกรุงศรีฟิเธอร์มิกซ์เสดจ์เอฟเอ็กซ์	ธนาคารกรุงศรีอยุธยา จำกัด (มหาชน)

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

(2) รายชื่อผู้จัดการกองทุน ณ วันที่ 30 เมษายน 2563

- | | |
|-----------------|-----------------|
| 1. นายวิพุธ | เอื้ออนันท์ |
| 2. นายชลิต | โชคพิพัทธ์พัฒนา |
| 3. นายสาธิต | บัวชู |
| 4. นางสาวสาวินี | สุขศรีวงศ์ |
| 5. นายปิติ | ประติพัทธ์พงษ์ |
| 6. นายจาตุรันต์ | สอนไว |
| 7. นายชูศักดิ์ | อวยพรชัยสกุล |
| 8. นายพลสิทธิ์ | อาหุณย์ |
| 9. นายพงศ์ทัศน์ | อนุรัตน์ |
| 10. นางสาววรรดา | ตันติสุนทร |

(3) การเปิดเผยข้อมูลการถือหน่วยลงทุนเกิน 1 ใน 3 ณ วันที่ 30 เมษายน 2563

ไม่มีการถือหน่วยลงทุนเกิน 1 ใน 3 ของกลุ่มบุคคลใดบุคคลหนึ่ง

ผู้ถือหุ้นสามารถตรวจสอบข้อมูลสัดส่วนการถือหน่วยลงทุนของบุคคลหรือกลุ่มบุคคลโดยตรงได้ที่ www.krungsriasset.com

(4) อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุนของกองทุน (portfolio turnover ratio) ในรอบระยะเวลาที่ผ่านมา เท่ากับ 11.21%

(5) ผลการดำเนินงานและข้อมูลการลงทุนของกองทุนหลัก (ข้อมูล ณ วันที่ 30/04/2020)

Calendar Year Performance+ 年度表現+						
	2019	2018	2017	2016	2015	
Class AA (USD)	21.07%	-6.57%	N/A	N/A	N/A	
AA(美元)類別						
Cumulative Performance 累積表現						
	YTD 年初至今	3 months 三個月	1 yr. 一年	3 yrs. 三年	5 yrs. 五年	Since Launch 成立至今
Class AA (USD)	-10.32%	-11.56%	-2.59%	N/A	N/A	1.45%
AA(美元)類別						
Top Holdings 主要持有證券						
DTE ENERGY CO 6.25% 11/01/2022						3.56%
SOUTH JERSEY INDUSTRIES 7.25% 04/15/2021						3.55%
NEXTERA ENERGY INC 5.279% 03/01/2023						3.32%
SOUTHERN CAL EDISON 6.25% Perpetual						3.01%
CENTERPOINT ENERGY INC 7% 09/01/2021						2.84%
SEMPRA ENERGY 5.75% 07/01/2079						2.61%
TRINITY CAPITAL INC/MD 7% 01/16/2025						2.56%
BROOKFIELD RENEWABLE PAR 5.25% Perpetual						2.48%
SOFTBANK GROUP CORP 6.875% Perpetual						2.43%
ALGONQUIN PWR & UTILITY 6.875% 10/17/2078						2.35%
Geographical Breakdown~ 地區分佈~			Sector Breakdown~ 類別分佈~			
United States 美國	75.90%		Electric 電力	29.56%		
Canada 加拿大	9.29%		Insurance 保險	14.74%		
United Kingdom 英國	3.52%		Energy 能源	10.88%		
Netherlands 荷蘭	3.16%		Natural Gas 天然氣	9.72%		
Japan 日本	2.74%		Banking 銀行業	9.00%		
Mexico 墨西哥	1.32%		Communications 電訊	7.46%		
France 法國	1.28%		Consumer Cyclical 周期性消費	5.29%		
Switzerland 瑞士	0.92%		Brokerage, Asset Managers and Exchanges 經紀・資產管理和交易所	3.13%		
Cash & Cash Equivalents 現金及現金等值資產	1.87%		Others 其他	8.35%		
			Cash & Cash Equivalents 現金及現金等值資產	1.87%		
Rating Breakdown~ 信貸評級分佈~						
A/A						0.31%
Baa/BBB						44.35%
Ba/BB						34.47%
B/B						7.07%
Not Rated						11.93%
Cash & Others 現金及其他						1.87%