



krungsri

Asset
Management

Make Life
Simple

A member of  MUGF
a global financial group

รายงานประจำครึ่งปีแรก 2566

รอบระยะเวลาตั้งแต่วันที่ 1 มิถุนายน 2566 – 30 พฤศจิกายน 2566

กองทุนรวม

KF-GLS

กองทุนเปิดกรุงศรีโกลบอลอีควิตี้ลองชอร์ต

Krungsri Global Equity Long Short Fund

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

รายงานประจำปีครั้งแรก 2566

กองทุนเปิดกรุงศรีโกลบอลอภिवิถีล่องชอร์ต

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

สารบริษัทจัดการ

เรียน ผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุน

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด (บริษัทฯ) ขอนำเสนอรายงานสำหรับรอบระยะเวลา 6 เดือน ของกองทุนเปิดกรุงศรีโกลบอลอควิตีตี้ ลองชอร์ต (KF-GLS) ตั้งแต่วันที่ 1 มิถุนายน 2566 ถึงวันที่ 30 พฤศจิกายน 2566 มายังผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุน โดยมีรายละเอียดดังนี้

ผลการดำเนินงาน

กองทุนเปิดกรุงศรีโกลบอลอควิตีตี้ ลองชอร์ต มีมูลค่าทรัพย์สินสุทธิ ณ วันที่ 30 พฤศจิกายน 2566 เท่ากับ 61.76 ล้านบาท คิดเป็นมูลค่าทรัพย์สินสุทธิต่อหน่วยลงทุนเท่ากับ 9.0611 บาท โดยมีผลการดำเนินงานย้อนหลัง 6 เดือน ลดลงร้อยละ 4.42 ลดลงมากกว่าเกณฑ์มาตรฐานการวัดผลการดำเนินงาน ที่เพิ่มขึ้นร้อยละ 6.16

ภาวะการลงทุนในช่วงที่ผ่านมา

ในรอบครึ่งปีบัญชีที่ผ่านมา UBS Equity Opportunity Long Short Fund (กองทุนหลัก) ปรับตัวลดลงประมาณ 3.3% จากปัจจัยเสี่ยงหลัก อาทิ การเดินหน้านโยบายดอกเบี้ยนโยบายอย่างต่อเนื่องของธนาคารกลางสหรัฐฯ และยุโรป เพื่อลดความร้อนแรงของอัตราเงินเฟ้อที่ยืนอยู่ในระดับสูง นอกจากนี้ กองทุนหลักยังได้รับแรงกดดันเพิ่มเติมจากเศรษฐกิจยุโรปที่ยังคงอ่อนแอจากการชะลอตัวของภาคการบริโภคและการส่งออก เนื่องจากเศรษฐกิจของคู่ค้าหลักอย่างประเทศจีนเผชิญภาวะเศรษฐกิจชะลอตัวและปัญหาสภาพคล่องในภาคอสังหาริมทรัพย์ กองทุนหลักเผชิญความผันผวนสูงขึ้นจากความเสี่ยงที่เศรษฐกิจขนาดใหญ่ เช่น สหรัฐฯ และยุโรป อาจเข้าสู่ภาวะถดถอยในปี 2566 ประกอบกับความเสี่ยงที่ธนาคารกลางจะคงอัตราดอกเบี้ยในระดับสูงยาวนานกว่าที่คาด อย่างไรก็ตาม กองทุนหลักผสมผสานการลงทุนแบบ Long/short ซึ่งเป็นกลยุทธ์การลงทุนที่มีสถานะ Long และ Short ในพอร์ตการลงทุนพร้อมๆ กัน โดยมีวัตถุประสงค์เพื่อสร้างส่วนผสมของผลตอบแทนจากการเคลื่อนไหวของตลาดและการคัดเลือกหลักทรัพย์ลงทุน โดยกองทุนหลักมีการลงทุน Net Long มากที่สุดในกลุ่มสินค้าจำเป็น และ Net short มากที่สุดในกลุ่มสินค้าฟุ่มเฟือย

ณ สิ้นเดือนตุลาคม 2566 กองทุนหลักมีสัดส่วนการลงทุนสุทธิ (Net exposure) ในหมวดสินค้าจำเป็น 8.9% หมวดการแพทย์ 8.6% และหมวดพลังงาน 4.1% ขณะที่สัดส่วนขายชอร์ตมากสุดในหมวดสินค้าฟุ่มเฟือย 7.5%

แนวโน้มการลงทุน

กองทุนหลักเน้นสร้างผลตอบแทนจากการลงทุนในหลักทรัพย์ที่สร้างมูลค่าเพิ่มให้นักลงทุน ในขณะที่เดียวกันก็สามารถขายชอร์ตในหลักทรัพย์ที่มีทิศทางที่แย่งจากปัจจัยพื้นฐานที่เปลี่ยนไปหรือมีความผันผวนค่อนข้างมาก ทั้งนี้ สำหรับการลงทุนในปัจจุบัน กองทุนหลักได้มีสัดส่วนการลงทุนสุทธิมากสุดในกลุ่มสินค้าจำเป็นและกลุ่มการแพทย์ ซึ่งมีรายได้และกำไรเติบโตอย่างสม่ำเสมอเหมาะสมกับสภาพตลาดที่มีความผันผวนสูงและเศรษฐกิจมีการเติบโตชะลอตัวลง นอกจากนี้ กองทุนมีแนวโน้มได้รับอานิสงค์จาก Bond yield และอัตราเงินเฟ้อที่ปรับตัวลดลงอย่างต่อเนื่อง

บริษัทฯ ใคร่ขอขอบพระคุณท่านผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุนที่ได้มอบความไว้วางใจให้บริษัทฯ เป็นผู้บริหารเงินลงทุนของท่าน ทั้งนี้ บริษัทฯ จะพิจารณาดำเนินนโยบายการลงทุนที่เหมาะสมกับสถานการณ์ด้วยความระมัดระวัง และคำนึงถึงผลประโยชน์สูงสุดของผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุนเป็นสำคัญ

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด



รายงานของผู้ดูแลผลประโยชน์

เรียน ผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุน
กองทุนเปิดกรุงศรีโกลบอลอควิตีตี้ลونغชอร์ต

ตามที่ธนาคารสแตนดาร์ดชาร์เตอร์ด (ไทย) จำกัด (มหาชน) (“ธนาคาร”) ในฐานะผู้ดูแลผลประโยชน์ กองทุนเปิดกรุงศรีโกลบอลอควิตีตี้ลونغชอร์ต (“กองทุน”) ได้ปฏิบัติหน้าที่เป็นผู้ดูแลผลประโยชน์ของกองทุน ซึ่งบริหารและจัดการโดยบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด สำหรับรอบระยะเวลาตั้งแต่วันที่ 1 มิถุนายน 2566 ถึง วันที่ 30 พฤศจิกายน 2566

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

ธนาคารสแตนดาร์ดชาร์เตอร์ด (ไทย) จำกัด (มหาชน)

Bitcha C.

(นางสาวพิตชา ชีวะไพบูลย์)
ผู้ช่วยผู้อำนวยการ

ธนาคารสแตนดาร์ดชาร์เตอร์ด (ไทย) จำกัด (มหาชน)
8 ธันวาคม 2566

โทรศัพท์ 02-106-1471
กรุณาติดต่อ คุณสุทธานิชฐ์ ภาณุภณ *Suttthanit*

ธนาคารสแตนดาร์ดชาร์เตอร์ด (ไทย) จำกัด (มหาชน)
140 ถนนวิทญ์ 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

กองทุนเปิดกรุงศรี โกลบอลอควิตี้ลونغชอร์ต

งบแสดงฐานะการเงิน

ณ 30 พฤศจิกายน 2566

	Unaudited (บาท)
สินทรัพย์	
เงินลงทุนตามราคายุติธรรม (ราคาทุน 59,060,527.08 บาท)	60,832,040.05
เงินฝากธนาคาร	1,310,333.94
ลูกหนี้จากสัญญาอนุพันธ์	84,351.04
ลูกหนี้	
จากดอกเบี้ย	454.79
รวมสินทรัพย์	<u>62,227,179.82</u>
หนี้สิน	
เจ้าหนี้จากสัญญาอนุพันธ์	342,231.67
เจ้าหนี้	
จากการรับซื้อคืนหน่วยลงทุน	29,286.23
ค่าธรรมเนียมสับเปลี่ยนหน่วยลงทุน	1,093.67
ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย	92,089.47
ภาษีเงินได้ค้างจ่าย	68.22
หนี้สินอื่น	1,876.81
รวมหนี้สิน	<u>466,646.07</u>
สินทรัพย์สุทธิ	<u>61,760,533.75</u>
สินทรัพย์สุทธิ:	
หน่วยลงทุนจดทะเบียน 300 ล้านหน่วย มูลค่าที่ตราไว้หน่วยละ 10 บาท	
ทุนที่ได้รับจากผู้ถือหน่วยลงทุน	68,159,696.93
กำไรสะสม(ขาดทุนสะสม)	(94,935,471.41)
บัญชีปรับสมดุล	88,536,308.23
สินทรัพย์สุทธิ	<u>61,760,533.75</u>
สินทรัพย์สุทธิต่อหน่วย	9.0611
จำนวนหน่วยลงทุนที่จำหน่ายได้แล้วทั้งหมด ณ วันสิ้นงวด (หน่วย)	6,815,969.6925

กองทุนเปิดกรุงศรี โกลบอลอควิตีดีล่องชอร์ต
งบกำไรขาดทุนเบ็ดเสร็จ
สำหรับงวดบัญชีสิ้นสุดวันที่ 30 พฤศจิกายน 2566

	Unaudited (บาท)
รายได้จากการลงทุน	
รายได้ดอกเบี้ย	563.13
รวมรายได้	563.13
ค่าใช้จ่าย	
ค่าธรรมเนียมการจัดการ	353,967.11
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์	12,492.98
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน	62,464.83
ค่าธรรมเนียมวิชาชีพ	35,000.31
รวมค่าใช้จ่าย	463,925.23
รายได้จากการลงทุนสุทธิ	(463,362.10)
รายการกำไร (ขาดทุน) สุทธิจากเงินลงทุน	
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิที่เกิดขึ้นจากเงินลงทุน	801,789.39
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิที่ยังไม่เกิดขึ้นจากเงินลงทุน	(3,362,005.21)
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิที่ยังไม่เกิดขึ้นจากสัญญาอนุพันธ์	(538,755.73)
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิจากอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ	5,367.32
รวมรายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิจากเงินลงทุนที่เกิดขึ้นและยังไม่เกิดขึ้น	(3,093,604.23)
การเพิ่มขึ้นในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงานก่อนหักภาษีเงินได้	(3,556,966.33)
หัก ภาษีเงินได้	(84.47)
การเพิ่มขึ้นในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงานหลังหักภาษีเงินได้	(3,557,050.80)

กองทุนเปิดกรุงศรี โกลบอลอควิตี้ลونغชอร์ต

งบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน

ณ 30 พฤศจิกายน 2566

การแสดงรายละเอียดเงินลงทุนใช้การจัดกลุ่มตามประเภทของเงินลงทุนและประเภทของอุตสาหกรรม

ประเภทเงินลงทุน/ผู้ออกตราสาร/ผู้ออกหลักทรัพย์	หมายเลขตราสาร	อัตรา ดอกเบี้ย (%)	วันครบอายุ	เงินต้น (บาท) / จำนวนหุ้น	มูลค่ายุติธรรม (บาท)	Unaudited
						ร้อยละของ มูลค่าเงิน ลงทุน
หลักทรัพย์ต่างประเทศ						
หน่วยลงทุน						100.00
UBS (Irl) Investor Selection - Equity Opportunity Long Short Fund	UEOLA1P			59,060,527.08	60,832,040.05	100.00
จำนวน 16,135.360000 หน่วย						
มูลค่าหน่วยละ 97.9900 EUR						
รวมเป็นเงิน 1,581,104.32 EUR						
					60,832,040.05	100.00

กองทุนเปิดกรุงศรีโกลบอลอควิตีต้องชอร์ต

รายละเอียดการลงทุน ณ 30 พฤศจิกายน 2566

	มูลค่าตามราคาตลาด	% NAV
หลักทรัพย์หรือทรัพย์สินในประเทศ	1,310,788.73	2.12
เงินฝากธนาคาร		
FITCH-LONG		
Rate A-	1,310,788.73	2.12
หลักทรัพย์หรือทรัพย์สินต่างประเทศ	60,832,040.05	98.50
หน่วยลงทุน		
ไม่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์	60,832,040.05	98.50
สัญญาซื้อขายล่วงหน้า	(257,880.63)	(0.41)
สัญญาที่อ้างอิงกับอัตราแลกเปลี่ยน-สัญญาแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ		
TRIS		
Rate A+	(149,842.48)	(0.24)
FITCH-LONG		
Rate AA	(87,767.10)	(0.14)
Rate AA-	(20,271.05)	(0.03)
อื่นๆ	(124,414.40)	(0.21)
เจ้าหนี้	(32,324.93)	(0.06)
ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย	(92,089.47)	(0.15)
มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ	61,760,533.75	100.00

กองทุนเปิดกรุงศรีโกลบอลอภिवิถีดองชอร์ต

รายละเอียดการลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ณ 30 พฤศจิกายน 2566

ประเภทสัญญา	คู่สัญญา	วัตถุประสงค์	มูลค่าสัญญา (Notional Amount)	% NAV	วันครบกำหนด	กำไร/ขาดทุน (net gain/loss)
สัญญาที่อ้างอิงกับอัตราแลกเปลี่ยน						
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ท.กรุงศรีอยุธยา	ป้องกันความเสี่ยง	12,980,310.00	0.1012	4 ธ.ค. 2566	62,511.60
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ท.กรุงศรีอยุธยา	ป้องกันความเสี่ยง	11,224,537.00	(0.0317)	29 ม.ค. 2567	(19,585.59)
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ท.กรุงศรีอยุธยา	ป้องกันความเสี่ยง	12,937,257.00	(0.1023)	12 ก.พ. 2567	(63,197.06)
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ธนาคารไทยพาณิชย์	ป้องกันความเสี่ยง	12,955,054.50	(0.1421)	4 ธ.ค. 2566	(87,767.10)
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ท.ทหารไทยธนชาติ	ป้องกันความเสี่ยง	10,791,480.00	0.0354	12 ธ.ค. 2566	21,839.44
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ท.ทหารไทยธนชาติ	ป้องกันความเสี่ยง	15,653,984.20	(0.1190)	18 ธ.ค. 2566	(73,498.94)
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ท.ทหารไทยธนชาติ	ป้องกันความเสี่ยง	6,814,026.00	(0.1590)	16 ม.ค. 2567	(98,182.98)

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

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

ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (Fund's Direct Expenses)

กองทุนเปิดกรุงศรีโกลบอลอควิตีตี้ลونغชอร์ต

ตั้งแต่วันที่ 1 มิถุนายน 2566 ถึงวันที่ 30 พฤศจิกายน 2566

ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (Fund's Direct Expenses)	จำนวนเงิน (หน่วย: พันบาท)	ร้อยละของมูลค่า ทรัพย์สิน* (ต่อปี) 1/
ค่าธรรมเนียมการจัดการ (Management Fee)	353.97	0.9095
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ (Trustee Fee)	12.49	0.0321
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน (Registrar Fee)	62.46	0.1605
ค่าที่ปรึกษาการลงทุน (Advisory Fee)	-	-
ค่าธรรมเนียมสอบบัญชี (Auditing Fee)	35.00	0.0900
ค่าใช้จ่ายอื่น ๆ (Others)	-	-
รวมค่าใช้จ่ายทั้งหมด 2/	463.92	1.1921

หมายเหตุ

1/ ค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวมข้างต้น เป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่มหรือภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว

2/ ไม่รวมค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ และค่าธรรมเนียมต่าง ๆ ที่เกิดขึ้นจากการซื้อขายหลักทรัพย์

* มูลค่าทรัพย์สิน ในที่นี้ หมายถึง มูลค่าทรัพย์สินทั้งหมด หักด้วย มูลค่าหนี้สินทั้งหมด

เว้นแต่ค่าธรรมเนียมการจัดการ ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ ค่าธรรมเนียมนายทะเบียนหน่วยลงทุน

และค่าใช้จ่ายที่เกี่ยวข้องกับการปฏิบัติการกองทุน ณ วันที่คำนวณ

ผลการดำเนินงานของกองทุนเปิดกรุงศรีโกลบอลอควิตีลีแองจอร์ต

ผลการดำเนินงาน สิ้นสุด ณ วันที่ 30 พฤศจิกายน 2566	% ตามช่วงเวลา			% ต่อปี				นับจากวันเริ่ม โครงการ (17 มิถุนายน 2559)
	Year to Date	ย้อนหลัง 3 เดือน	ย้อนหลัง 6 เดือน	ย้อนหลัง 1 ปี	ย้อนหลัง 3 ปี	ย้อนหลัง 5 ปี	ย้อนหลัง 10 ปี	
KF-GLS	-8.31%	+0.85%	-4.42%	-6.61%	-1.87%	+1.37%	N/A	-1.31%
ดัชนีชี้วัด (Benchmark)*	+7.13%	+2.56%	+6.16%	+9.23%	+2.93%	+0.96%	N/A	-0.28%
ความผันผวนของผลการดำเนินงาน	+10.00%	+9.79%	+10.41%	+9.70%	+10.70%	+11.05%	N/A	+10.56%
ความผันผวนของดัชนีชี้วัด	+7.71%	+6.66%	+7.29%	+7.83%	+7.65%	+7.25%	N/A	+7.07%

หมายเหตุ : * ดัชนีชี้วัด (Benchmark) คือ

ดัชนี ESTR Volume Weighted Trimmed Mean Rate Index + 0.085% p.a. ในสกุลเงินยูโร ปรับด้วยอัตราแลกเปลี่ยนเพื่อเทียบเท่ากับค่าสกุลเงินบาท ณ วันที่คำนวณผลตอบแทน

** ผลตอบแทนที่มีอายุเกินหนึ่งปีจะแสดงผลตอบแทนต่อปี

เอกสารการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวมฉบับนี้ ได้จัดทำตามมาตรฐานการวัดผลดำเนินงานของ
กองทุนรวมของสมาคมบริษัทจัดการลงทุน

ข้อมูลอื่นๆ ที่ผู้ถือหน่วยลงทุนควรทราบ

(1) รายงานบุคคลที่เกี่ยวข้องที่มีการทำธุรกรรมในรอบเวลาที่ผ่านมา (วันที่ 1 มิถุนายน 2566 ถึงวันที่ 30 พฤศจิกายน 2566)

ชื่อกองทุน	รายชื่อบุคคลที่เกี่ยวข้อง
กองทุนเปิดกรุงศรี โกลบอลอภिवิถีทองชอร์ต	ธนาคารกรุงศรีอยุธยา จำกัด (มหาชน)

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

(2) รายชื่อผู้จัดการกองทุน ณ วันที่ 30 พฤศจิกายน 2566

1. นายชวลิต โชคติพิพัฒนา
2. นายสาธิต บัวชู
3. นางสาวสาวิณี สุขศรีวงศ์
4. นายปีติ ประดิพัทธ์พงษ์
5. นายกวิฬ เจริญเสาวภาคย์
6. นายเอกชัย บุญยะพงศ์ไชย
7. นายจาตุรนต์ สอนไว
8. นายชูศักดิ์ อวยพรชัยสกุล
9. นายพงศ์สัมพันธ์ อนุรัตน์
10. นางสาววรรดา ดันดิสุนทร
11. นายวัชรินทร์ คิ้วงสังข์

(3) การเปิดเผยข้อมูลการถือหน่วยลงทุนเกิน 1 ใน 3 ณ วันที่ 30 พฤศจิกายน 2566

ไม่มีการถือหน่วยลงทุนเกิน 1 ใน 3 ของบุคคลใดบุคคลหนึ่ง

ผู้ถือหน่วยลงทุนสามารถตรวจสอบข้อมูลสัดส่วนการถือหน่วยลงทุนโดยตรงได้ที่ www.krungsriasset.com

(4) อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุนของกองทุน (portfolio turnover ratio) ในรอบระยะเวลาที่ผ่านมา เท่ากับ 44.44%

(5) ผลการดำเนินงานและข้อมูลการลงทุนของกองทุนหลัก (ข้อมูล ณ วันที่ 30/11/2023)

in %	2020	2021	2022	2023 YTD ²	Nov. 2023	LTD ³	Ø p.a. 3 years	Ø p.a. 5 years
Fund (EUR)	12.83	3.76	-1.86	-6.61	-1.59	-1.93	-0.89	2.79
Benchmark ⁴	-0.47	-0.49	0.08	3.05	0.34	0.65	0.85	0.34

The performance shown does not take account of any commissions, entry or exit charges.

1 These figures refer to the past. **If the currency of a financial product, financial service or its costs is different from your reference currency, the return and/or costs can increase or decrease as a result of currency fluctuations.** Source for all data and chart (if not indicated otherwise): UBS Asset Management.

2 YTD: year-to-date (since beginning of the year)

3 LTD: launch-to-date

4 Reference Index in currency of share class (without costs)

in %	06.2023	07.2023	08.2023	09.2023	10.2023	11.2023
Fund (EUR)	-3.74	-4.47	3.61	0.71	2.36	-1.59
Benchmark	0.28	0.29	0.33	0.31	0.34	0.34

Sector weights (%)

	Long	Short
Cash	140.92	-53.57
Consumer Staples	16.15	-2.62
Health care	14.24	-5.03
Consumer Discretionary	13.56	-20.44
Financials	13.08	-5.32
Industrials	9.93	-20.01
Information Technology	7.44	-11.15
Communication Services	3.63	-2.68
Utilities	3.21	-0.54
Energy	2.93	-0.43
Materials	2.18	-6.01
Real estate	0.31	-2.43
Total	227.58	-130.23

Market weights (%)

	Long	Short
United States	33.74	-40.05
Others	12.47	-13.00
United Kingdom	8.41	-2.21
Germany	7.26	-3.76
Switzerland	4.96	-6.32
Netherlands	4.51	-0.88
Denmark	4.31	-1.36
Japan	3.90	-7.05
France	3.60	-0.73
Canada	3.48	-1.28
Total	86.64	-76.64