



krungsri

Asset
Management

Make Life
Simple

A member of  MUFG
a global financial group

รายงานประจำปีแรก 2564

รอบระยะเวลาตั้งแต่วันที่ 1 มีนาคม 2564 – 31 สิงหาคม 2564

กองทุนรวม

KF-HJPINDEX

กองทุนเปิดกรุงศรีเจแปนเอควิตี้อินเด็กซ์เฮดจ์เอฟเอ็กซ์

Krungsri Japan Equity Index Hedged FX 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

รายงานประจำปีแรก 2564

กองทุนเปิดกรุงศรีใจแป้นอควิตี้อินเด็กส์เฮดจ์เอฟแอล็กซ์

● สารบัญจัดการ	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	

เรียน ผู้ถือหน่วยลงทุน

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด (บริษัทฯ) ขอส่งรายงานสำหรับรอบระยะเวลา 6 เดือน ของกองทุนเปิดกรุงศรีเจแปนอควิตี้ อินดิคส์เฮดจ์เอฟเอ็กซ์ (KF-HJPINDX) ตั้งแต่วันที่ 1 มีนาคม 2564 ถึงวันที่ 31 สิงหาคม 2564 มายังผู้ถือหน่วยลงทุน โดยมีรายละเอียด ดังนี้

ผลการดำเนินงาน

กองทุนเปิดกรุงศรีเจแปนอควิตี้อินดิคส์เฮดจ์เอฟเอ็กซ์ มีมูลค่าทรัพย์สินสุทธิ ณ วันที่ 31 สิงหาคม 2564 เท่ากับ 125.39 ล้านบาท คิดเป็น มูลค่าทรัพย์สินสุทธิต่อหน่วยลงทุนเท่ากับ 14.4318 บาท โดยมีผลการดำเนินงานย้อนหลัง 6 เดือน ลดลงร้อยละ 7.25 ลดลงมากกว่า เกณฑ์มาตรฐานการวัดผลการดำเนินงาน ที่ลดลงร้อยละ 6.13

ภาวะการลงทุนในช่วงที่ผ่านมา

ในรอบครึ่งปีที่ผ่านมา กองทุนหลัก NEXT FUNDS Nikkei 225 Exchange Traded Fund ปรับตัวลดลง 5.9% โดยในปี 2564 ตลาด ญี่ปุ่นยังคงฟื้นตัวได้ช้ากว่าตลาดพัฒนาแล้วอื่นๆ อย่าง สหรัฐฯ และยุโรป โดยตลาดญี่ปุ่นได้รับแรงกดดันจากการระบาดของ Covid-19 ระลอกใหม่ โดยเฉพาะจากสายพันธุ์เดลต้า ทำให้รัฐบาลต้องประกาศภาวะฉุกเฉินต่อเนื่องเพื่อควบคุมการแพร่ระบาด ประกอบกับการ ฉีดวัคซีนที่ญี่ปุ่นทำได้ค่อนข้างช้า ส่งผลกดดันต่อ sentiment ในตลาดและการฟื้นตัวของเศรษฐกิจ อย่างไรก็ตาม ในช่วงปลายไตรมาส 2 ตลาดญี่ปุ่นทยอยฟื้นตัว โดยมีอัตราการฉีดวัคซีนที่เร่งตัวขึ้นและสามารถชะลอการติดเชื้อรายใหม่ อย่างไรก็ตาม ตลาดญี่ปุ่นยังคงได้รับแรงส่ง จากการประกาศผลประกอบการของบริษัทจดทะเบียนญี่ปุ่นที่ส่งสัญญาณว่ารายได้ของบริษัททยอยฟื้นตัวต่อเนื่อง โดยตลาดทยอย ปรับการคาดการณ์ผลประกอบการของตลาดญี่ปุ่นขึ้น นอกจากนี้ ญี่ปุ่นยังคงเป็นตลาดที่ laggards เมื่อเทียบกับตลาดพัฒนาอื่นๆ ทำให้นักลงทุนเริ่มหันมาสนใจอีกครั้ง อย่างไรก็ตาม ความผันผวนในตลาดญี่ปุ่นอาจเพิ่มขึ้น โดยต้องจับตามองการลาออกของ นายกรัฐมนตรีและการเลือกตั้งที่จะมีขึ้นในช่วงเดือนตุลาคม 2564

ณ สิ้นเดือนกรกฎาคม 2564 กองทุนหลักมีการลงทุนในหมวด เครื่องใช้ไฟฟ้า 22.8% สื่อสารและสารสนเทศ 11.6% ค่าปลีก 11.1% เคมีภัณฑ์ 7.8% และเกษตรกรรม 7.2% เป็นต้น

แนวโน้มการลงทุน

การลงทุนในตลาดหุ้นญี่ปุ่นมีแนวโน้มฟื้นตัวต่อเนื่อง สนับสนุนด้วยการฉีดวัคซีนที่เร่งตัวขึ้นและจำนวนผู้ติดเชื้อที่มีทิศทางชะลอลง นอกจากนี้ ผลประกอบการของตลาดญี่ปุ่นยังออกมาดีต่อเนื่อง ทำให้ตลาดทยอยปรับการคาดการณ์ผลประกอบการของตลาดญี่ปุ่นขึ้น นอกจากนี้ ญี่ปุ่นยังคงเป็นตลาด laggards เมื่อเทียบกับตลาดพัฒนาอื่นๆ ทำให้นักลงทุนเริ่มหันมาสนใจอีกครั้ง ด้านเศรษฐกิจทยอยฟื้นตัว โดยธนาคารกลางญี่ปุ่นยังคงใช้นโยบายการเงินที่ผ่อนคลาย อย่างไรก็ตาม ความผันผวนในตลาดหุ้นอาจมีมากขึ้น จากการประกาศการ หยุด QE (QE Tapering) ของเฟด และการเลือกตั้งทั่วไปของญี่ปุ่นไปในเดือนตุลาคม 2564

บริษัทฯ ใคร่ขอขอบพระคุณท่านผู้ถือหน่วยลงทุนที่ได้มอบความไว้วางใจให้บริษัทฯ เป็นผู้บริหารเงินลงทุนของท่าน ทั้งนี้ บริษัทฯ จะ พิจารณาดำเนินนโยบายการลงทุนที่เหมาะสมกับสถานการณ์ด้วยความระมัดระวัง และคำนึงถึงผลประโยชน์สูงสุดของผู้ถือหน่วยลงทุน เป็นสำคัญ

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด



รายงานของผู้ดูแลผลประโยชน์

เรียน ผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุน
กองทุนเปิดกรุงศรีเจแปนอควิตีอินเด็กซ์เฮดจ์เอฟแอล

ตามที่ธนาคารสแตนดาร์ดชาร์เตอร์ด (ไทย) จำกัด (มหาชน) (“ธนาคารฯ”) ในฐานะผู้ดูแลผลประโยชน์ กองทุนเปิดกรุงศรีเจแปนอควิตีอินเด็กซ์เฮดจ์เอฟแอล (“กองทุน”) ได้ปฏิบัติหน้าที่เป็นผู้ดูแลผลประโยชน์ของกองทุน ซึ่งบริหารและจัดการโดยบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด สำหรับรอบระยะเวลาตั้งแต่ วันที่ 1 มีนาคม 2564 ถึง วันที่ 31 สิงหาคม 2564

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

ธนาคารสแตนดาร์ดชาร์เตอร์ด (ไทย) จำกัด (มหาชน)

(นางสาวนุชจรินทร์ เพชรปานีวงศ์)
ผู้อำนวยการ

ธนาคารสแตนดาร์ดชาร์เตอร์ด (ไทย) จำกัด (มหาชน)
9 กันยายน 2564

โทรศัพท์ 02-724-5421
กรุณาติดต่อ คุณจิระประภา ธงไชย [N.](#)

กองทุนเปิดกรุงศรีเจแปนอควิตี้อินเค็กซ์เสดจ์เอฟแอลอี็กซ์

งบแสดงฐานะการเงิน

ณ 31 สิงหาคม 2564

	Unaudited (บาท)
สินทรัพย์	
เงินลงทุนตามราคายุติธรรม (ราคาทุน 116,339,200.45 บาท)	120,223,475.88
เงินฝากธนาคาร	3,477,124.55
ลูกหนี้จากสัญญาอนุพันธ์	1,766,150.53
ลูกหนี้	
จากดอกเบี้ย	426.71
จากการขายหน่วยลงทุน	8,813,136.29
รวมสินทรัพย์	134,280,313.96
หนี้สิน	
เจ้าหนี้จากสัญญาอนุพันธ์	216,771.86
เจ้าหนี้	
จากการรับซื้อคืนหน่วยลงทุน	126,945.84
จากการซื้อเงินลงทุน	8,384,558.12
ค่าธรรมเนียมสับเปลี่ยนหน่วยลงทุน	20,862.90
ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย	138,104.86
ภาษีเงินได้ค้างจ่าย	64.01
หนี้สินอื่น	2,212.71
รวมหนี้สิน	8,889,520.30
สินทรัพย์สุทธิ	125,390,793.66
สินทรัพย์สุทธิ:	
หน่วยลงทุนจดทะเบียน 300 ล้านหน่วย มูลค่าที่ตราไว้หน่วยละ 10 บาท	
ทุนที่ได้รับจากผู้ถือหน่วยลงทุน	86,885,011.78
กำไรสะสม(ขาดทุนสะสม)	59,763,513.35
บัญชีปรับสมดุล	(21,257,731.47)
สินทรัพย์สุทธิ	125,390,793.66
สินทรัพย์สุทธิต่อหน่วย	14.4318
จำนวนหน่วยลงทุนที่จำหน่ายได้แล้วทั้งหมด ณ วันสิ้นงวด (หน่วย)	8,688,501.1782

กองทุนเปิดกรุงศรีเจแปนอควิตี้อินเตอร์เนชั่นแนลเอฟเอ็มเค
งบกำไรขาดทุนเบ็ดเสร็จ
สำหรับงวดบัญชีสิ้นสุดวันที่ 31 สิงหาคม 2564

	Unaudited (บาท)
รายได้จากการลงทุน	
รายได้ดอกเบี้ย	1,458.27
รายได้เงินปันผล	886,620.73
รวมรายได้	<u>888,079.00</u>
ค่าใช้จ่าย	
ค่าธรรมเนียมการจัดการ	362,802.24
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์	14,512.07
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน	72,560.44
ค่าธรรมเนียมวิชาชีพ	35,287.52
ค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์	66,450.44
รวมค่าใช้จ่าย	<u>551,612.71</u>
รายได้จากการลงทุนสุทธิ	<u>336,466.29</u>
รายการกำไร (ขาดทุน) สุทธิจากเงินลงทุน	
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิที่เกิดขึ้นจากเงินลงทุน	2,902,585.83
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิที่ยังไม่เกิดขึ้นจากเงินลงทุน	(7,290,227.72)
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิที่ยังไม่เกิดขึ้นจากสัญญาอนุพันธ์	489,861.03
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิจากอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ	(772,107.49)
รวมรายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิจากเงินลงทุนที่เกิดขึ้นและยัง ไม่เกิดขึ้น	(4,669,888.35)
การเพิ่มขึ้นในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงานก่อนภาษีเงินได้	(4,333,422.06)
หัก ภาษีเงินได้	(218.73)
การเพิ่มขึ้นในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงานหลังหักภาษีเงินได้	<u>(4,333,640.79)</u>

กองทุนเปิดกรุงศรีเจแปนอภิวิตินเคียส์แอสเสทแอนด์อิมเพอเรียล

งบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน

ณ 31 สิงหาคม 2564

การแสดงรายละเอียดเงินลงทุนใช้การจัดกลุ่มตามประเภทของเงินลงทุนและประเภทของอุตสาหกรรม

						Unaudited
ประเภทเงินลงทุน/ผู้ออกตราสาร/ผู้ออกหลักทรัพย์	หมายเลขตราสาร	อัตรา	เงินต้น (บาท) /		มูลค่ายุติธรรม	ร้อยละของ
		ดอกเบี้ย	วันครบอายุ	จำนวนหุ้น	(บาท)	มูลค่า
		(%)				เงินลงทุน
หลักทรัพย์ในประเทศ						
เงินฝากออมทรัพย์						0.04
บมจ.ธ.ทิสโก้		0.100000	เมื่อทวงถาม	22,893.96	22,893.96	0.02
บมจ.ธ.ยูโอบี		0.250000	เมื่อทวงถาม	25,078.90	25,078.90	0.02
หลักทรัพย์ต่างประเทศ						
หน่วยลงทุน						99.96
NEXT FUNDS Nikkei 225 Exchange Traded Fund	JP3027650005			116,291,227.59	120,175,503.02	99.96
จำนวน 14,220.000000 หน่วย						
มูลค่าหน่วยละ 28,790.0000 JPY						
รวมเป็นเงิน 409,393,800.00 JPY						
					120,223,475.88	100.00

กองทุนเปิดกรุงศรีเจแปนอิควิตี้อินเต็กซ์เฮดจ์เอฟเอ็กซ์

รายละเอียดการลงทุน ณ 31 สิงหาคม 2564

	มูลค่าตามราคาตลาด	% NAV
หลักทรัพย์หรือทรัพย์สินในประเทศ	3,525,524.12	2.81
เงินฝากธนาคาร		
TRIS		
Rate A	22,899.87	0.02
FITCH-LONG		
Rate A-	3,477,534.81	2.77
FITCH_TH-LONG		
Rate AAA	25,089.44	0.02
หลักทรัพย์หรือทรัพย์สินต่างประเทศ	120,175,503.02	95.84
หน่วยลงทุน		
จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์	120,175,503.02	95.84
สัญญาซื้อขายล่วงหน้า	1,549,378.67	1.23
สัญญาที่อ้างอิงกับอัตราแลกเปลี่ยน-สัญญาแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ		
TRIS		
Rate A+	568,723.98	0.45
FITCH-LONG		
Rate AA	750,679.79	0.60
Rate AA-	229,974.90	0.18
อื่นๆ	140,387.85	0.12
ลูกหนี้	8,813,136.29	7.03
เจ้าหนี้	(8,534,643.58)	(6.80)
ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย	(138,104.86)	(0.11)
มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ	125,390,793.66	100.00

กองทุนเปิดกรุงศรีเจแปนอิลวิตีอินเด็กซ์เสดจ์เอฟเอ็กซ์

รายละเอียดการลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ณ 31 สิงหาคม 2564

ประเภทสัญญา	คู่สัญญา	วัตถุประสงค์	มูลค่าสัญญา (Notional Amount)	% NAV	วันครบกำหนด	กำไร/ขาดทุน (net gain/loss)
สัญญาที่อ้างอิงกับอัตราแลกเปลี่ยน						
สัญญาฟอว์เวิร์ด	บมจ.ธ.กรุงศรีอยุธยา	ป้องกันความเสี่ยง	8,852,888.92	0.1834	26 ต.ค. 2564	229,974.90
สัญญาฟอว์เวิร์ด	บมจ.ธ.กสิกรไทย	ป้องกันความเสี่ยง	9,406,241.73	0.0318	21 ก.ย. 2564	39,840.60
สัญญาฟอว์เวิร์ด	บมจ.ธ.กสิกรไทย	ป้องกันความเสี่ยง	12,396,544.16	0.0763	27 ก.ย. 2564	95,672.19
สัญญาฟอว์เวิร์ด	บมจ.ธ.กสิกรไทย	ป้องกันความเสี่ยง	5,887,774.14	0.0606	8 พ.ย. 2564	75,974.98
สัญญาฟอว์เวิร์ด	บมจ.ธ.ไทยพาณิชย์	ป้องกันความเสี่ยง	8,397,554.34	(0.0104)	2 ก.ย. 2564	(12,996.22)
สัญญาฟอว์เวิร์ด	บมจ.ธ.ไทยพาณิชย์	ป้องกันความเสี่ยง	18,650,206.11	0.2711	4 ต.ค. 2564	339,954.01
สัญญาฟอว์เวิร์ด	บมจ.ธ.ไทยพาณิชย์	ป้องกันความเสี่ยง	6,445,511.51	0.1596	26 ต.ค. 2564	200,181.73
สัญญาฟอว์เวิร์ด	บมจ.ธ.ไทยพาณิชย์	ป้องกันความเสี่ยง	8,304,371.46	0.0096	8 พ.ย. 2564	12,052.50
สัญญาฟอว์เวิร์ด	บมจ.ธ.ทหารไทยธนชาติ	ป้องกันความเสี่ยง	9,717,594.09	(0.1309)	7 ก.ย. 2564	(164,164.70)
สัญญาฟอว์เวิร์ด	บมจ.ธ.ทหารไทยธนชาติ	ป้องกันความเสี่ยง	6,809,209.92	(0.0316)	13 ก.ย. 2564	(39,610.94)
สัญญาฟอว์เวิร์ด	บมจ.ธ.ทหารไทยธนชาติ	ป้องกันความเสี่ยง	5,337,830.24	0.0711	12 ต.ค. 2564	89,181.28
สัญญาฟอว์เวิร์ด	บมจ.ธ.ทหารไทยธนชาติ	ป้องกันความเสี่ยง	14,152,908.69	0.2302	18 ต.ค. 2564	288,658.58
สัญญาฟอว์เวิร์ด	บมจ.ธ.ทหารไทยธนชาติ	ป้องกันความเสี่ยง	11,403,572.04	0.3147	1 พ.ย. 2564	394,659.76

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)

กองทุนเปิดกรุงศรีเจแปนอควิตีอินเด็กซ์เสดจ์เอฟเอ็กซ์

ตั้งแต่วันที่ 1 มีนาคม 2564 ถึงวันที่ 31 สิงหาคม 2564

ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (Fund's Direct Expenses)	จำนวนเงิน (หน่วย: พันบาท)	ร้อยละของมูลค่า ทรัพย์สิน* (ต่อปี) 1/
ค่าธรรมเนียมการจัดการ (Management Fee)	362.80	0.8025
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ (Trustee Fee)	14.51	0.0321
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน (Registrar Fee)	72.56	0.1605
ค่าที่ปรึกษาการลงทุน (Advisory Fee)	-	-
ค่าธรรมเนียมสอบบัญชี (Auditing Fee)	35.29	0.0781
ค่าใช้จ่ายอื่น ๆ (Others)	-	-
รวมค่าใช้จ่ายทั้งหมด 2/	485.16	1.0732

หมายเหตุ

1/ ค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวมข้างต้น เป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่มหรือภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว

2/ ไม่รวมค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ และค่าธรรมเนียมต่าง ๆ ที่เกิดขึ้นจากการซื้อขายหลักทรัพย์

* มูลค่าทรัพย์สิน ในที่นี้ หมายถึง มูลค่าทรัพย์สินทั้งหมด หักด้วย มูลค่าหนี้สินทั้งหมด

เว้นแต่ค่าธรรมเนียมการจัดการ ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ ค่าธรรมเนียมนายทะเบียนหน่วยลงทุน

และค่าใช้จ่ายที่เกี่ยวข้องกับการปฏิบัติการกองทุน ณ วันที่คำนวณ

ค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์
กองทุนเปิดกรุงศรีเจแปนอิควิตี้อินเด็กซ์เฮดจ์เอฟเอ็กซ์ / Krungsri Japan Equity Index Hedged FX Fund
ตั้งแต่วันที่ 1 มีนาคม 2564 ถึงวันที่ 31 สิงหาคม 2564

บริษัท	จำนวนเงิน (เยน)	อัตราส่วน (%)
Maybank Kim Eng Securities Pte LTtd.	318,309.00	100.00
รวม / Total	318,309.00	100.00

ผลการดำเนินงานของกองทุนเปิดกรุงศรีเจแปนอควิตี้อินเด็กซ์เฮดจ์เอฟเอ็กซ์

ผลการดำเนินงาน สิ้นสุด ณ วันที่ 31 ส.ค. 2564	% 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 (31 มีนาคม 2560)
KF-HJPINDEX	1.21%	-3.28%	-7.25%	19.89%	6.39%	N/A	N/A	8.65%
ดัชนีชี้วัด (Benchmark)*	3.19%	-2.43%	-6.13%	22.81%	8.72%	N/A	N/A	10.71%
ความผันผวนของผลการดำเนินงาน	16.64%	14.79%	16.83%	15.71%	19.23%	N/A	N/A	17.48%
ความผันผวนของตัวชี้วัด	12.32%	9.16%	9.37%	13.88%	21.13%	N/A	N/A	19.22%

หมายเหตุ : * ดัชนีชี้วัด (Benchmark) คือ ดัชนี Nikkei 225 ในสกุลเงินเยน ปรับด้วยต้นทุนการป้องกันความเสี่ยงด้านอัตราแลกเปลี่ยน
เพื่อเทียบเท่ากับค่าสกุลเงินบาท ณ วันที่คำนวณผลตอบแทน

** ผลตอบแทนที่มีอายุเกินหนึ่งปีจะแสดงเป็นผลตอบแทนต่อปี

เอกสารการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวมฉบับนี้ ได้จัดทำตามมาตรฐานการวัดผลดำเนินงาน
ของกองทุนรวมของสมาคมบริษัทจัดการลงทุน

ข้อมูลอื่นๆ ที่ผู้ถือหน่วยลงทุนควรทราบ

(1) รายงานบุคคลที่เกี่ยวข้องที่มีการทำธุรกรรมในรอบเวลาที่ผ่านมา (วันที่ 1 มีนาคม 2564 ถึงวันที่ 31 สิงหาคม 2564)

ชื่อกองทุน	รายชื่อบุคคลที่เกี่ยวข้อง
กองทุนเปิดกรุงศรีเจแปนอควิตี้อินเด็กซ์เซคจ์เอฟเอ็กซ์	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 31 สิงหาคม 2564

- | | |
|---------------------|-----------------|
| 1. นายวิพุธ | เอื้ออนันท์ |
| 2. นายชาติ | โชคทิพย์พัฒนา |
| 3. นายสาริต | บัวชู |
| 4. นางสาวสาวณี | สุขศรีวงศ์ |
| 5. นายปิติ | ประคิพัทธ์พงษ์ |
| 6. นายกวิพ | เหรียญเสาวภาคย์ |
| 7. นายจตุรันต์ | สอนไว |
| 8. นายชูศักดิ์ | อวยพรชัยสกุล |
| 9. นายพลสิทธิ์ | อาหุณย์ |
| 10. นายพงศ์สัมพันธ์ | อนรัตน์ |
| 11. นางสาววรรดา | ตันติสุนทร |

(3) การเปิดเผยข้อมูลการถือหน่วยลงทุนเกิน 1 ใน 3 ณ วันที่ 31 สิงหาคม 2564

ไม่มีการถือหน่วยลงทุนเกิน 1 ใน 3 ของบุคคลใดบุคคลหนึ่ง

ผู้ถือหน่วยลงทุนสามารถตรวจสอบข้อมูลสัดส่วนการถือหน่วยลงทุนโดยตรงได้ที่ www.krungsriasset.com

(4) อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุนของกองทุน (portfolio turnover ratio) ในรอบระยะเวลาที่ผ่านมา เท่ากับ 43.92%

(5) ผลการดำเนินงานและข้อมูลการลงทุนของกองทุนหลัก (ข้อมูล ณ วันที่ 31/08/2021)

Return	1 month	3 months	6 months	1 year	3 years	Since Incep.
NAV (dividend re-invested)	3.0%	-2.6%	-2.4%	23.1%	29.4%	202.0%

(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	9.1%
8035	TOKYO ELECTRON LIMITED	ELECTRIC APPLIANCES	6.0%
9984	SOFTBANK GROUP CORP.	INFORMATION & COMMUNICATION	4.7%
6367	DAIKIN INDUSTRIES,LTD.	MACHINERY	3.5%
6954	FANUC CORPORATION	ELECTRIC APPLIANCES	3.0%
9433	KDDI CORPORATION	INFORMATION & COMMUNICATION	2.5%
6098	RECRUIT HOLDINGS CO.,LTD.	SERVICES	2.5%
6857	ADVANTEST CORPORATION	ELECTRIC APPLIANCES	2.4%
4543	TERUMO CORPORATION	PRECISION INSTRUMENTS	2.3%
4063	SHIN-ETSU CHEMICAL CO.,LTD.	CHEMICALS	2.3%
Total			38.3%

Number of Holdings :
225

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

Sector Allocation	(% of NAV)
ELECTRIC APPLIANCES	22.5%
INFORMATION & COMMUNICATION	11.1%
RETAIL TRADE	10.6%
CHEMICALS	7.9%
PHARMACEUTICAL	7.6%
Others	38.7%
Total	98.4%

Asset Allocation	
Stocks	98.4%
Call Loan, Others	1.6%
(Index Futures	1.6%)

Portfolio Characteristics	
Dividend Yield (annual)	1.7%
• 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).	