



krungsri

Asset
Management

Make Life
Simple

A member of  MUFG
a global financial group

รายงานประจำครึ่งปีแรก 2566

รอบระยะเวลาตั้งแต่วันที่ 1 ตุลาคม 2565 - 31 มีนาคม 2566

กองทุนรวม

KF-CSINCOM

กองทุนเปิดกรุงศรีโกลบอลคอลเล็กทีฟสมาร์ตอินคัม

Krungsri Global Collective Smart Income 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

กองทุนเปิดกรุงศรีโกลบอลคอลเล็กทีฟสมาร์ทอินคัม

- สารบัญที่จัดการ 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 ของกองทุนเปิดกรุงศรีโกลบอลคอลลีคทีฟฟิสิกส์อินเวสต์เมนต์ (KF-CSINCOM) ตั้งแต่วันที่ 1 ตุลาคม 2565 ถึงวันที่ 31 มีนาคม 2566 มายังผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุน โดยมีรายละเอียดดังนี้

ผลการดำเนินงาน

กองทุนเปิดกรุงศรีโกลบอลคอลลีคทีฟฟิสิกส์อินเวสต์เมนต์ มีมูลค่าทรัพย์สินสุทธิ ณ วันที่ 31 มีนาคม 2566 เท่ากับ 6,751.20 ล้านบาท คิดเป็นมูลค่าทรัพย์สินสุทธิต่อหน่วยลงทุนเท่ากับ 11.2159 บาท โดยมีผลการดำเนินงานย้อนหลัง 6 เดือน เพิ่มขึ้นร้อยละ 3.83 มากกว่าเกณฑ์มาตรฐานการวัดผลการดำเนินงาน ที่เพิ่มขึ้นร้อยละ 2.34

ภาวะการลงทุนในช่วงที่ผ่านมา

ในรอบครึ่งปีบัญชีที่ผ่านมา ธนาคารกลางสหรัฐฯ (Fed) ปรับเพิ่มอัตราดอกเบี้ยนโยบายขึ้น 4 ครั้ง โดยมีการปรับอัตราดอกเบี้ยนโยบายอย่างรวดเร็วถึง 75 bps (0.75%) จากกรอบอัตราดอกเบี้ยที่ 3.00% - 3.25% สู่กรอบ 3.75% - 4.00% ในเดือนพฤศจิกายน 2565 และชะลอความเร็วในการปรับขึ้นอัตราดอกเบี้ยเป็นเพียง 50 bps (0.50%) สู่กรอบ 4.25% - 4.50% ในเดือนธันวาคม 2565 และชะลอความเร็วในการปรับขึ้นอัตราดอกเบี้ยลงอีกในช่วงต้นปี 2566 โดยขึ้นอัตราดอกเบี้ยนโยบายเพียง 25 bps (0.25%) ทั้ง 2 ครั้งหลังในเดือนกุมภาพันธ์ 2566 และ มีนาคม 2566 สู่กรอบ 4.50% - 4.75% และ 4.75% - 5.00% ตามลำดับ สาเหตุหลักของการขึ้นอัตราดอกเบี้ยไม่มากนักในระยะหลังคือ 1) อัตราเงินเฟ้อที่มีสัญญาณชะลอลงเป็นพักๆ จากความกังวลด้านเศรษฐกิจถดถอย 2) อัตราดอกเบี้ยในปัจจุบันถือเป็นระดับที่ค่อนข้างสูงแล้วเมื่อเทียบกับอดีต และ 3) ข่าวเกี่ยวกับผลกระทบเชิงลบต่อธนาคารบางแห่งในสหรัฐฯ ที่เกิดจากการที่ธนาคารถือครองทรัพย์สินกลุ่มพันธบัตรรัฐบาลระยะยาวที่มีมูลค่าลดลงอย่างมากจากอัตราดอกเบี้ยที่เพิ่มขึ้น เงินเฟ้อที่เพิ่มขึ้นในช่วงที่ผ่านมา มีแรงหนุนมาจากการก่อสร้างต่ออุตสาหกรรมโดยรัสเซีย ที่ทำให้ราคาพลังงานยังอยู่ในระดับที่สูงกว่าปกติ ส่งผลให้ต้นทุนในการดำเนินธุรกิจต่างๆ ทั่วโลกสูงขึ้น ในช่วงที่ผ่านมาตราสารหนี้ในเยอรมันนี อังกฤษ และ ญี่ปุ่น ปรับตัวขึ้น เช่นเดียวกับกับตราสารหนี้สหรัฐฯ แต่กองทุนได้รับประโยชน์จากผลตอบแทนที่เพิ่มขึ้นในประเทศเหล่านี้จากสถานะชอร์ตตราสารหนี้ในเยอรมันนี อังกฤษ และ ญี่ปุ่น

ปัจจุบันกองทุนมีการลงทุนใน Residential MBS 35% ตราสารหนี้ High Yield 12% ตราสารหนี้ระดับลงทุนได้ 11% Commercial MBS 10% และ ตราสารหนี้ภาครัฐบาล 12% นอกจากนี้กองทุนมีสถานะชอร์ตตราสารหนี้ในบางประเทศ

แนวโน้มการลงทุน

กองทุนมีมุมมองเชิงบวกต่อ Non-agency MBS รวมถึง Commercial MBS ที่มีคุณภาพดี สำหรับตราสารหนี้ระดับลงทุนได้ ตราสารหนี้หมวดธนาคารยังคงเป็นส่วนหลัก โดยมีการลงทุนส่วนอื่นๆ ในหมวดโครงสร้างพื้นฐาน หมวดการสื่อสาร และ หมวดสุขภาพ ในส่วนของตราสารหนี้ High Yield กองทุนจะเน้นลงทุนระยะสั้น ประเทศเม็กซิโกและบราซิลเป็นประเทศที่กองทุนมีมุมมองเชิงบวกในระยะยาว ในตลาดเกิดใหม่ โดยจะเน้นลงทุนในตราสารที่เกี่ยวข้องกับภาครัฐ ณ ปัจจุบันกองทุนมีสัดส่วนการลงทุนในตราสารหนี้ระยะสั้นและเงินสดในระดับที่ค่อนข้างสูงเมื่อเทียบกับอดีต

ในระยะถัดไปแม้ Fed มีแนวโน้มขึ้นอัตราดอกเบี้ยอีกเพียงเล็กน้อย หรือ ชะลอการขึ้นอัตราดอกเบี้ย จากข่าวความเสี่ยงเชิงระบบด้านภาคการธนาคารในช่วงที่ผ่านมา ด้วยข้อมูลการจ้างงานที่อยู่ในระดับที่ดี ใกล้เคียงช่วงก่อนเกิด COVID-19 และราคาพลังงานที่มีแนวโน้มเพิ่มขึ้นในระยะสั้นจากการลดกำลังการผลิตของกลุ่ม OPEC ทำให้ตลาดยังคงคาดการณ์ว่า Fed จะยังคงขึ้นอัตราดอกเบี้ยจากแรงกดดันด้านเงินเฟ้อ ถึงแม้ตลาดยังไม่เข้าสู่ช่วงดอกเบี้ยขาลงในระยะเวลาอันใกล้ กองทุนอาจเริ่มทำการเพิ่มอายุเฉลี่ยของกองทุน โดยอาจมีการซื้อตราสารหนี้บางช่วงอายุที่ผลตอบแทนปรับตัวสูงขึ้นมากจากแรงเทขายที่เกินปกติในตลาด หรือ ลดสถานะชอร์ตตราสารหนี้ในกองทุนลง

บริษัทฯ ใคร่ขอขอบพระคุณท่านผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุนที่ได้มอบความไว้วางใจให้บริษัทฯ เป็นผู้บริหารเงินลงทุนของท่าน ทั้งนี้ บริษัทฯ จะพิจารณาดำเนินนโยบายการลงทุนที่เหมาะสมกับสถานการณ์ด้วยความระมัดระวัง และคำนึงถึงผลประโยชน์สูงสุดของผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุนเป็นสำคัญ

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด



รายงานของผู้ดูแลผลประโยชน์

เรียน ผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุน
กองทุนเปิดกรุงศรีโกลบอลคอลเล็กทีฟสมาร์ทอินคัม

ตามที่ธนาคารสแตนดาร์ดชาร์เตอร์ด (ไทย) จำกัด (มหาชน) (“ธนาคารฯ”) ในฐานะผู้ดูแลผลประโยชน์ กองทุนเปิดกรุงศรีโกลบอลคอลเล็กทีฟสมาร์ทอินคัม (“กองทุน”) ได้ปฏิบัติหน้าที่เป็นผู้ดูแลผลประโยชน์ของกองทุน ซึ่งบริหารและจัดการโดยบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด สำหรับรอบระยะเวลาตั้งแต่วันที่ 1 ตุลาคม 2565 ถึง วันที่ 31 มีนาคม 2566

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

ธนาคารสแตนดาร์ดชาร์เตอร์ด (ไทย) จำกัด (มหาชน)

(นางสาวนุชจรินทร์ เพชรปาดินวงศ์)

ผู้อำนวยการ

ธนาคารสแตนดาร์ดชาร์เตอร์ด (ไทย) จำกัด (มหาชน)

10 เมษายน 2566

โทรศัพท์ 062-257-8559

กรุณาติดต่อ คุณสุทธานิชฐ์ ภาณุภณ [Su.Thanich](mailto:Su.Thanich@sc.com.th)

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 โกลบอลคอลลีกที่ฟสมาร์ทอินคัม

งบแสดงฐานะการเงิน

ณ 31 มีนาคม 2566

	Unaudited (บาท)
สินทรัพย์	
เงินลงทุนตามราคายุติธรรม (ราคาทุน 7,054,008,658.83 บาท)	7,644,442,429.90
เงินฝากธนาคาร	6,732,046.58
ลูกหนี้จากสัญญาอนุพันธ์	23,859,254.77
ลูกหนี้	
จากดอกเบี้ย	318,698.28
จากการขายหน่วยลงทุน	2,247,446.17
รวมสินทรัพย์	<u>7,677,599,875.70</u>
หนี้สิน	
เจ้าหนี้จากสัญญาอนุพันธ์	141,019,558.79
เจ้าหนี้	
จากการรับซื้อคืนหน่วยลงทุน	2,139,721.01
ค่าธรรมเนียมสับเปลี่ยนหน่วยลงทุน	215,702.46
ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย	6,706,503.26
ภาษีเงินได้ค้างจ่าย	47,804.75
หนี้สินอื่น	162,625.71
รวมหนี้สิน	<u>150,291,915.98</u>
สินทรัพย์สุทธิ	<u>7,527,307,959.72</u>
สินทรัพย์สุทธิ:	
หน่วยลงทุนจดทะเบียน 10,000 ล้านหน่วย มูลค่าที่ตราไว้หน่วยละ 10 บาท	
ทุนที่ได้รับจากผู้ถือหน่วยลงทุน	7,010,851,541.46
กำไรสะสม(ขาดทุนสะสม)	619,519,894.36
บัญชีปรับสมดุล	(103,063,476.10)
สินทรัพย์สุทธิ	<u>7,527,307,959.72</u>
สินทรัพย์สุทธิต่อหน่วย	10.7366
จำนวนหน่วยลงทุนที่จำหน่ายได้แล้วทั้งหมด ณ วันสิ้นสุด (หน่วย)	701,085,154.0861

กองทุนเปิดกรุงศรี โกลบอลคอลเล็กทีฟสมาร์ทอินคัม
งบกำไรขาดทุนเบ็ดเสร็จ
สำหรับงวดบัญชีสิ้นสุดวันที่ 31 มีนาคม 2566

	Unaudited (บาท)
รายได้จากการลงทุน	
รายได้ดอกเบี้ย	432,969.04
รวมรายได้	432,969.04
ค่าใช้จ่าย	
ค่าธรรมเนียมการจัดการ	27,295,013.06
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์	1,023,563.04
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน	5,117,814.95
ค่าธรรมเนียมวิชาชีพ	39,890.50
รวมค่าใช้จ่าย	33,476,281.55
รายได้จากการลงทุนสุทธิ	(33,043,312.51)
รายการกำไร (ขาดทุน) สุทธิจากเงินลงทุน	
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิที่เกิดขึ้นจากเงินลงทุน	9,353,307.35
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิที่ยังไม่เกิดขึ้นจากเงินลงทุน	309,433,740.92
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิที่ยังไม่เกิดขึ้นจากสัญญาอนุพันธ์	22,036,042.99
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิจากอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ	(103,884,961.10)
รวมรายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิจากเงินลงทุนที่เกิดขึ้นและยังไม่มีเกิดขึ้น	236,938,130.16
การเพิ่มขึ้นในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงานก่อนภาษีเงินได้	203,894,817.65
หัก ภาษีเงินได้	(64,945.34)
การเพิ่มขึ้นในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงานหลังหักภาษีเงินได้	203,829,872.31

กองทุนเปิดกรุงศรี โกลบอลคอลเล็กทีฟสมาร์ทอินคัม

งบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน

ณ 31 มีนาคม 2566

การแสดงรายละเอียดเงินลงทุนใช้การจัดกลุ่มตามประเภทของเงินลงทุนและประเภทของอุตสาหกรรม

ประเภทเงินลงทุน/ผู้ออกตราสาร/ผู้ออกหลักทรัพย์	อัตรา ดอกเบี้ย (%)	อัตรา วันครบอายุ	เงินต้น (บาท) / จำนวนหุ้น	มูลค่ายุติธรรม (บาท)	Unaudited ร้อยละของ มูลค่าเงิน ลงทุน
หลักทรัพย์ในประเทศ					
เงินฝากออมทรัพย์					
บมจ.ธ.ทิสโก้	0.400000	เมื่อทวง	352,357.99	352,357.99	0.00
บมจ.ธ.ยูโอบี	0.650000	เมื่อทวง	121,488,587.34	121,488,587.34	1.59
หลักทรัพย์ต่างประเทศ					
หน่วยลงทุน					
PIMCO GIS Income Fund			6,932,167,713.50	7,522,601,484.57	98.41
จำนวน 13,626,931.060000 หน่วย					
มูลค่าหน่วยละ 16.1500 USD					
รวมเป็นเงิน 220,074,936.65 USD					
				7,644,442,429.90	100.00

กองทุนเปิดกรุงศรีโกลบอลคอลเล็กทีฟสมาร์ตอินคัม

รายละเอียดการลงทุน ณ 31 มีนาคม 2566

	มูลค่าตามราคาตลาด	% NAV
หลักทรัพย์หรือทรัพย์สินในประเทศ	128,891,690.19	1.71
เงินฝากธนาคาร		
TRIS		
Rate A	361,657.83	0.00
FITCH-LONG		
Rate A-	6,734,178.70	0.09
FITCH_TH-LONG		
Rate AAA	121,795,853.66	1.62
หลักทรัพย์หรือทรัพย์สินต่างประเทศ	7,522,601,484.57	99.94
หน่วยลงทุน		
ไม่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์	7,522,601,484.57	99.94
สัญญาซื้อขายล่วงหน้า	(117,160,304.02)	(1.56)
สัญญาที่อ้างอิงกับอัตราแลกเปลี่ยน-สัญญาแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ		
TRIS		
Rate A+	(108,984,150.76)	(1.45)
FITCH-LONG		
Rate AA	(8,176,153.26)	(0.11)
อื่นๆ	(7,024,911.02)	(0.09)
ลูกหนี้	2,247,446.17	0.03
เจ้าหนี้	(2,565,853.93)	(0.03)
ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย	(6,706,503.26)	(0.09)
มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ	7,527,307,959.72	100.00

กองทุนเปิดกรุงศรีโกลบอลคอลเล็กทีฟสมาร์ทอินแคม

รายละเอียดการลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ณ 31 มีนาคม 2566

ประเภทสัญญา	คู่สัญญา	วัตถุประสงค์	มูลค่าสัญญา (Notional Amount)	% NAV	วันครบกำหนด	กำไร/ขาดทุน (net gain/loss)
สัญญาที่อ้างอิงกับอัตราแลกเปลี่ยน						
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ธ.กสิกรไทย	ป้องกันความเสี่ยง	172,456,612.00	(0.0891)	2 มิ.ย. 2566	(6,708,291.55)
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ธ.กสิกรไทย	ป้องกันความเสี่ยง	599,749,899.00	0.0321	14 ก.ค. 2566	2,415,954.16
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ธนาคารไทยพาณิชย์	ป้องกันความเสี่ยง	1,017,838,932.00	0.0750	12 พ.ค. 2566	5,647,827.52
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ธนาคารไทยพาณิชย์	ป้องกันความเสี่ยง	1,346,732,660.00	(0.1266)	23 มิ.ย. 2566	(9,531,643.39)
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ธ.ทหารไทยธนชาติ	ป้องกันความเสี่ยง	196,548,582.00	(0.1319)	21 เม.ย. 2566	(9,927,427.93)
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ธ.ทหารไทยธนชาติ	ป้องกันความเสี่ยง	1,184,768,394.60	0.2098	21 เม.ย. 2566	15,795,473.09
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ธ.ทหารไทยธนชาติ	ป้องกันความเสี่ยง	594,469,854.00	(0.4175)	12 พ.ค. 2566	(31,424,138.96)
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ธ.ทหารไทยธนชาติ	ป้องกันความเสี่ยง	199,097,864.00	(0.0788)	2 มิ.ย. 2566	(5,930,058.32)
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ธ.ทหารไทยธนชาติ	ป้องกันความเสี่ยง	1,621,644,574.00	(1.0296)	2 มิ.ย. 2566	(77,497,998.64)

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)

กองทุนเปิดกรุงศรีโกลบอลคอลเล็คทีฟสมาร์ทอินคัม

ตั้งแต่วันที่ 1 ตุลาคม 2565 ถึงวันที่ 31 มีนาคม 2566

ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (Fund's Direct Expenses)	จำนวนเงิน (หน่วย: พันบาท)	ร้อยละของมูลค่า ทรัพย์สิน* (ต่อปี) 1/
ค่าธรรมเนียมการจัดการ (Management Fee)	27,295.01	0.8560
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ (Trustee Fee)	1,023.56	0.0321
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน (Registrar Fee)	5,117.81	0.1605
ค่าที่ปรึกษาการลงทุน (Advisory Fee)	-	-
ค่าธรรมเนียมสอบบัญชี (Auditing Fee)	39.89	0.0013
ค่าใช้จ่ายอื่น ๆ (Others)	-	-
รวมค่าใช้จ่ายทั้งหมด 2/	33,476.27	1.0499

หมายเหตุ

1/ ค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวมข้างต้น เป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่มหรือภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว

2/ ไม่รวมค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ และค่าธรรมเนียมต่าง ๆ ที่เกิดขึ้นจากการซื้อขายหลักทรัพย์

* มูลค่าทรัพย์สิน ในที่นี้ หมายถึง มูลค่าทรัพย์สินทั้งหมด หักด้วย มูลค่าหนี้สินทั้งหมด

เว้นแต่ค่าธรรมเนียมการจัดการ ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ ค่าธรรมเนียมนายทะเบียนหน่วยลงทุน

และค่าใช้จ่ายที่เกี่ยวข้องกับการปฏิบัติการกองทุน ณ วันที่คำนวณ

ผลการดำเนินงานของกองทุนเปิดกรุงศรีโกลบอลคอลเล็กทีฟสมาร์ทอินแคม

ผลการดำเนินงาน สิ้นสุด ณ วันที่ 31 มีนาคม 2566	% ตามช่วงเวลา			% ต่อปี				นับจากวันเริ่ม โครงการ (30 กันยายน 2559)
	Year to Date	ย้อนหลัง 3 เดือน	ย้อนหลัง 6 เดือน	ย้อนหลัง 1 ปี	ย้อนหลัง 3 ปี	ย้อนหลัง 5 ปี	ย้อนหลัง 10 ปี	
KF-CSINCOM	0.88%	0.88%	3.83%	-4.27%	2.09%	0.35%	N/A	1.10%
ดัชนีชี้วัด (Benchmark)*	2.34%	2.34%	2.34%	-7.62%	-3.26%	0.74%	N/A	0.42%
ความผันผวนของผลการดำเนินงาน	5.98%	5.98%	6.48%	6.53%	4.74%	4.76%	N/A	4.23%
ความผันผวนของดัชนีชี้วัด	8.01%	8.01%	8.11%	8.16%	5.75%	5.34%	N/A	4.89%

หมายเหตุ : * ดัชนีชี้วัด (Benchmark) คือ ดัชนี Bloomberg US Aggregate Total Return Value Unhedged USD ในสกุลเงินเหรียญสหรัฐ ปรับด้วยต้นทุนการป้องกันความเสี่ยงด้านอัตราแลกเปลี่ยน เพื่อเทียบกับค่าสกุลเงินบาท ณ วันที่คำนวณผลตอบแทน ตามสัดส่วนการทำสัญญาป้องกันความเสี่ยงด้านอัตราแลกเปลี่ยนไม่น้อยกว่าร้อยละ 90 ของมูลค่าเงินลงทุนในต่างประเทศ

** ผลตอบแทนที่มีอายุเกินหนึ่งปีจะแสดงเป็นผลตอบแทนต่อปี

เอกสารการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวมฉบับนี้ ได้จัดทำตามมาตรฐานการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวมของสมาคมบริษัทจัดการลงทุน

ข้อมูลอื่นๆ ที่ผู้ถือหุ้นควรทราบ

(1) รายงานบุคคลที่เกี่ยวข้องที่มีการทำธุรกรรมในรอบเวลาที่ผ่านมา (วันที่ 1 ตุลาคม 2565 ถึงวันที่ 31 มีนาคม 2566)

ชื่อกองทุน	รายชื่อบุคคลที่เกี่ยวข้อง
กองทุนเปิดกรุงศรี โกลบอลคอลลีกทีฟสมาร์ทอินคัม	ไม่มี

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

(2) รายชื่อผู้จัดการกองทุน ณ วันที่ 31 มีนาคม 2566

- นางสาวพรทิพา หนึ่งน้ำใจ
- นายธีรภาพ จิรศักยกุล
- นางสาวรัมภารัตน์ ชุชานหัส
- นายเอกพจน์ ภูวิบูลย์พาณิชย์
- นางสาวณัฐยา เตรียมวิทยา
- นายจาตุรนต์ สอนไว
- นายชูศักดิ์ อวยพรชัยสกุล
- นายพงศ์สัมพันธ์ อนุรัตน์
- นางสาวรรดา ตันติสุนทร
- นายวัชรินทร์ คิ้วสังข์

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

ไม่มีการถือหน่วยลงทุนเกิน 1 ใน 3 ของบุคคลใดบุคคลหนึ่ง

ผู้ถือหุ้นสามารถตรวจสอบข้อมูลสัดส่วนการถือหน่วยลงทุนโดยตรงได้ที่ www.krungsriasset.com

(4) อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุนของกองทุน (portfolio turnover ratio) ในรอบระยะเวลาที่ผ่านมา เท่ากับ 2.37%

(5) ผลการดำเนินงานของกองทุนหลัก และ ข้อมูลการลงทุน (ข้อมูล ณ วันที่ 31/03/2023)

Past performance does not predict future results.

Performance (Net of Fees)	1 Mo.	3 Mos.	6 Mos.	1 Yr.	3 Yrs.	5 Yrs.	10 Yrs.	SI
Institutional, Acc (%)	1.32	2.22	6.74	-0.98	4.09	2.53	3.96	4.75
Institutional, Inc (%)	1.38	2.23	6.68	-0.91	4.10	2.54	3.96	4.76
Benchmark (%)	2.54	2.96	4.89	-4.78	-2.77	0.91	1.36	—

Past Performance is not a guarantee or reliable indicator of future results and no guarantee is being made that similar returns will be achieved in the future.

Past performance does not predict future results.

Performance (Net of Fees)	Mar'2018-Mar'2019	Mar'2019-Mar'2020	Mar'2020-Mar'2021	Mar'2021-Mar'2022	Mar'2022-Mar'2023
Institutional, Acc (%)	4.14	-3.50	16.20	-1.98	-0.98
Institutional, Inc (%)	4.22	-3.59	16.21	-2.03	-0.91
Benchmark (%)	4.48	8.93	0.71	-4.15	-4.78

Past performance does not predict future results.

Calendar Year (Net of Fees)	2013	2014	2015	2016	2017	2018	2019	2020	2021	2022	YTD
Institutional, Acc (%)	4.70	7.28	2.93	8.30	7.36	0.21	9.15	6.53	2.58	-7.49	2.22
Institutional, Inc (%)	4.79	7.20	2.94	8.37	7.36	0.21	9.11	6.52	2.60	-7.52	2.23
Benchmark (%)	-2.02	5.97	0.55	2.65	3.54	0.01	8.72	7.51	-1.54	-13.01	2.96

Current MIFID legislation prevents us from reporting performance data for funds with less than a 12 month track record.

The benchmark is the Bloomberg U.S. Aggregate Index. All periods longer than one year are annualised. SI is the performance since inception.

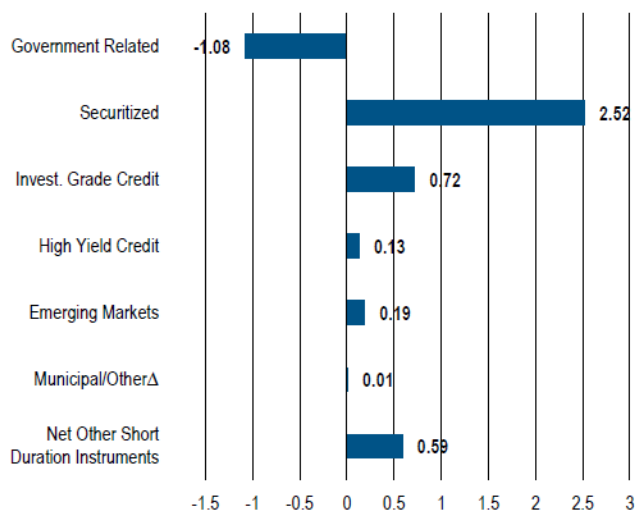
Top 10 Holdings (%MV)*

FNMA TBA 3.5% FEB 30YR	6.4
FNMA TBA 4.0% MAR 30YR	5.5
FNMA TBA 6.0% JAN 30YR	2.9
BNP PARIBAS ISSUANCE BV SR SEC **ABS**	2.8
FNMA TBA 3.0% FEB 30YR	2.6
FNMA TBA 4.5% FEB 30YR	2.5
FNMA TBA 6.0% FEB 30YR	2.1
FNMA TBA 5.0% FEB 30YR	1.5
U S TREASURY INFLATE PROT BD	1.4
U S TREASURY NOTE	1.3

*Top 10 holdings as of 31/12/2022, excluding derivatives.

Source: PIMCO

Sector Allocation (Duration in Years)



Source: PIMCO