



krungsri

Asset
Management

Make Life
Simple

A member of  MUGF
a global financial group

รายงานประจำครึ่งปีแรก 2566

รอบระยะเวลาตั้งแต่วันที่ 1 กรกฎาคม 2566 - 31 ธันวาคม 2566

กองทุนรวม

KF-HGOLD

กองทุนเปิดกรุงศรีโกลด์เฮดจ์

Krungsri Gold Hedged 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

กองทุนเปิดกรุงศรีโกลด์เสตจ์

- สารบัญผู้จัดการ 3
- รายงานผู้ดูแลผลประโยชน์ 4
- งบแสดงฐานะการเงิน งบกำไรขาดทุนเบ็ดเสร็จ และงบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน 6
- รายละเอียดเงินลงทุน การกู้ยืมเงิน และการก่อภาระผูกพันของกองทุนรวม 9
- ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม 12
- คำนายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ 13
- ผลการดำเนินงาน 14
- ข้อมูลอื่นๆ ที่ผู้ถือหน่วยลงทุนควรทราบ 15
 - รายงานบุคคลที่เกี่ยวข้องที่มีการทำธุรกรรมในรอบเวลาที่ผ่านมา
 - รายชื่อผู้จัดการกองทุน
 - การเปิดเผยข้อมูลการถือหน่วยลงทุนเกิน 1 ใน 3
 - อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุนของกองทุน
 - ข้อมูลการลงทุน และผลการดำเนินงานของกองทุนหลัก

สารบริษัทจัดการ

เรียน ผู้ถือหน่วยลงทุน

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด (บริษัท) ขอนำเสนอรายงานสำหรับรอบระยะเวลา 6 เดือน ของกองทุนเปิดกรุงศรีโกลด์เฮดจ์ (KF-HGOLD) ตั้งแต่วันที่ 1 กรกฎาคม 2566 ถึงวันที่ 31 ธันวาคม 2566 มายังผู้ถือหน่วยลงทุน โดยมีรายละเอียดดังนี้

ผลการดำเนินงาน

กองทุนเปิดกรุงศรีโกลด์เฮดจ์ มีมูลค่าทรัพย์สินสุทธิ ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2566 เท่ากับ 225.74 ล้านบาท คิดเป็นมูลค่าทรัพย์สินสุทธิต่อหน่วยลงทุนเท่ากับ 10.7115 บาท โดยมีผลการดำเนินงานย้อนหลัง 6 เดือน เพิ่มขึ้นร้อยละ 5.68 น้อยกว่าเกณฑ์มาตรฐานการวัดผลการดำเนินงาน ที่เพิ่มขึ้นร้อยละ 7.95

ภาวะการลงทุนในช่วงที่ผ่านมา

ในรอบครึ่งปีบัญชีที่ผ่านมา กองทุน SPDR Gold Trust (กองทุนหลัก) ปรับตัวเพิ่มขึ้นประมาณ 8.7% โดยในช่วงแรกราคาทองคำได้รับแรงกดดันจากค่าเงินดอลลาร์สหรัฐ ที่แข็งค่าขึ้นต่อเนื่องจากการดำเนินนโยบายการเงินที่เข้มงวดของธนาคารกลางสหรัฐ (Fed) อย่างไรก็ตาม ในช่วงไตรมาสสุดท้ายของปีราคาทองคำกลับมาขยายตัวได้อีกครั้ง หลังจากความไม่สงบในฝั่งตะวันออกกลางเพิ่มความรุนแรงขึ้นโดยความขัดแย้งระหว่างกลุ่มอิสราเอลและกลุ่มฮามาสมีท่าทีจะยืดเยื้อออกไป อีกทั้งความไม่สงบในฝั่ง Red Sea ที่มีขึ้นต่อเนื่อง ส่งผลให้ราคาทองคำปรับตัวขึ้นมาเนื่องจากนักลงทุนมองว่าเป็นสินทรัพย์ปลอดภัย นอกจากนี้ ในช่วงไตรมาสสุดท้าย ตลาดคาดว่า Fed จะหยุดการขึ้นอัตราดอกเบี้ยนโยบายและมีโอกาสลดอัตราดอกเบี้ยลงได้ต่อเนื่องในปี 2567 ส่งผลให้ค่าเงินดอลลาร์สหรัฐกลับมาอ่อนค่าลงอีกครั้ง ซึ่งเป็นผลดีต่อราคาทองคำ ทั้งนี้ ความเสี่ยงในตลาดยังคงมีอยู่จากความกังวลว่าเศรษฐกิจโลกจะเข้าสู่ภาวะถดถอยส่งผลให้ในช่วงที่ตลาดยังคงมีความเสี่ยง ทองคำยังคงเป็นสินทรัพย์ที่นักลงทุนให้ความสนใจเนื่องจากมองเป็นสินทรัพย์ปลอดภัยและช่วยลดความผันผวนลงได้

ณ สิ้นเดือนธันวาคม 2566 กองทุนหลักถือครองทองคำอยู่ประมาณ 879.11 เมตริกตัน

แนวโน้มการลงทุน

ราคาทองคำมีแนวโน้มดีขึ้น หลังจากธนาคารกลางทั่วโลกเริ่มส่งสัญญาณว่าอาจมีการลดอัตราดอกเบี้ยนโยบายลงได้ในปี 2567 ซึ่งจะส่งผลดีต่อราคาทองคำ เนื่องจากลดแรงกดดันจากเงินดอลลาร์สหรัฐที่แข็งค่า นอกจากนี้ ในปี 2567 จะมีการเลือกตั้งในหลายประเทศ ซึ่งจะทำให้เกิดความเสี่ยงด้านการเมืองระหว่างประเทศเพิ่มขึ้น ประกอบกับสงครามที่ยังยืดเยื้อระหว่างกลุ่มฮามาสและอิสราเอล และระหว่างยูเครนและรัสเซีย ทำให้ความต้องการในสินทรัพย์ปลอดภัยจะยังคงมีอยู่ ซึ่งจะเป็แรงส่งให้กับราคาทองคำ

บริษัทฯ ใคร่ขอขอบพระคุณท่านผู้ถือหน่วยลงทุนที่ได้มอบความไว้วางใจให้บริษัทฯ เป็นผู้บริหารเงินลงทุนของท่าน ทั้งนี้ บริษัทฯ จะพิจารณาดำเนินนโยบายการลงทุนที่เหมาะสมกับสถานการณ์ด้วยความระมัดระวัง และคำนึงถึงผลประโยชน์สูงสุดของผู้ถือหน่วยลงทุนเป็นสำคัญ

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด



รายงานความเห็นของผู้ดูแลผลประโยชน์

เสนอ ผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุนกองทุนเปิดกรุงศรีโกลด์เฮดจ์

ตามที่ธนาคารไทยพาณิชย์ จำกัด (มหาชน) ในฐานะผู้ดูแลผลประโยชน์กองทุนเปิดกรุงศรีโกลด์เฮดจ์ ซึ่งมีบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด เป็นผู้จัดการกองทุน ได้ปฏิบัติหน้าที่ดูแลผลประโยชน์ของกองทุนดังกล่าว สำหรับระยะเวลาตั้งแต่วันที่ 1 กรกฎาคม 2566 ถึงวันที่ 25 กันยายน 2566 แล้วนั้น

ธนาคารฯ เห็นว่าบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด ได้ปฏิบัติหน้าที่ในการจัดการกองทุนเปิดกรุงศรีโกลด์เฮดจ์ โดยถูกต้องตามที่ควร ตามวัตถุประสงค์ที่ได้กำหนดไว้ในโครงการจัดการที่ได้รับอนุมัติจากสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ และภายใต้พระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535

ขอแสดงความนับถือ

ธนาคารไทยพาณิชย์ จำกัด (มหาชน)

(นางสาวกรรณจิต อำนุญธรรม)

ผู้จัดการบริการผู้ดูแลผลประโยชน์และบริการบัญชีกองทุน



รายงานของผู้ดูแลผลประโยชน์

เรียน ผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุน
กองทุนเปิดกรุงศรีโกลด์เฮดจ์

ตามที่ธนาคารสแตนดาร์ดชาร์เตอร์ด (ไทย) จำกัด (มหาชน) (“ธนาคารฯ”) ในฐานะผู้ดูแลผลประโยชน์ กองทุนเปิดกรุงศรีโกลด์เฮดจ์ (“กองทุน”) ได้ปฏิบัติหน้าที่เป็นผู้ดูแลผลประโยชน์ของกองทุน ซึ่งบริหารและจัดการโดย บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด สำหรับระยะเวลา วันที่ 26 กันยายน 2566 ถึง วันที่ 31 ธันวาคม 2566

ธนาคารฯ เห็นว่าสำหรับรอบระยะเวลาดังกล่าว บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด ได้บริหารจัดการกองทุนโดยในสาระสำคัญเป็นไปตามโครงการจัดการกองทุน ซึ่งได้รับอนุมัติจากสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ตลอดจนข้อผูกพันที่ทำไว้กับผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุน ภายใต้พระราชบัญญัติหลักทรัพย์ และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535

ธนาคารสแตนดาร์ดชาร์เตอร์ด (ไทย) จำกัด (มหาชน)

(นางสาวสิวิพรรณ ยิ่งยงค์)

ผู้อำนวยการ บริการกองทุน ฝ่ายปฏิบัติการบริการหลักทรัพย์

ธนาคารสแตนดาร์ดชาร์เตอร์ด (ไทย) จำกัด (มหาชน)
10 มกราคม 2567

โทรศัพท์ 02-106-1471

กรุณาติดต่อ คุณสุทธานิชฐ์ ภาณุภณ Su.tthanit

กองทุนเปิดกรุงศรี โกลด์เฮดจ์

งบแสดงฐานะการเงิน

ณ 31 ธันวาคม 2566

	Unaudited (บาท)
สินทรัพย์	
เงินลงทุนตามราคายุติธรรม (ราคาทุน 193,130,977.62 บาท)	208,361,879.52
เงินฝากธนาคาร	4,536,339.00
ลูกหนี้จากสัญญาอนุพันธ์	18,847,501.67
ลูกหนี้	
จากดอกเบี้ย	21,923.85
จากการขายหน่วยลงทุน	46,522.23
รวมสินทรัพย์	<u>231,814,166.27</u>
หนี้สิน	
เจ้าหนี้จากสัญญาอนุพันธ์	5,681,577.74
เจ้าหนี้	
จากการรับซื้อคืนหน่วยลงทุน	128,633.06
ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย	250,442.55
ภาษีเงินได้ค้างจ่าย	3,288.58
หนี้สินอื่น	6,525.14
รวมหนี้สิน	<u>6,070,467.07</u>
สินทรัพย์สุทธิ	<u>225,743,699.20</u>
สินทรัพย์สุทธิ:	
หน่วยลงทุนจดทะเบียน 100 ล้านหน่วย มูลค่าที่ตราไว้หน่วยละ 10 บาท	
ทุนที่ได้รับจากผู้ถือหน่วยลงทุน	210,748,185.69
กำไรสะสม(ขาดทุนสะสม)	62,434,828.35
บัญชีปรับสมดุล	(47,439,314.84)
สินทรัพย์สุทธิ	<u>225,743,699.20</u>
สินทรัพย์สุทธิต่อหน่วย	10.7115
จำนวนหน่วยลงทุนที่จำหน่ายได้แล้วทั้งหมด ณ วันสิ้นงวด (หน่วย)	21,074,818.4900

กองทุนเปิดกรุงศรี โกลด์เฮดจ์
งบกำไรขาดทุนเบ็ดเสร็จ
สำหรับงวดบัญชีสิ้นสุดวันที่ 31 ธันวาคม 2566

	Unaudited (บาท)
รายได้จากการลงทุน	
รายได้ดอกเบี้ย	26,569.65
รายได้อื่น	910,936.87
รวมรายได้	937,506.52
ค่าใช้จ่าย	
ค่าธรรมเนียมการจัดการ	1,257,774.37
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์	41,925.83
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน	209,629.05
ค่าธรรมเนียมวิชาชีพ	32,678.06
ค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์	170,009.65
รวมค่าใช้จ่าย	1,712,016.96
รายได้จากการลงทุนสุทธิ	(774,510.44)
รายการกำไร (ขาดทุน) สุทธิจากเงินลงทุน	
รายการกำไร (ขาดทุน) สุทธิที่เกิดขึ้นจากเงินลงทุน	7,050,140.40
รายการกำไร (ขาดทุน) สุทธิที่ยังไม่เกิดขึ้นจากเงินลงทุน	17,092,253.02
รายการกำไร (ขาดทุน) สุทธิที่ยังไม่เกิดขึ้นจากสัญญาอนุพันธ์	22,006,756.26
รายการกำไร (ขาดทุน) สุทธิจากอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ	(26,709,596.70)
รวมรายการกำไร (ขาดทุน) สุทธิจากเงินลงทุนที่เกิดขึ้นและยังไม่มีเกิดขึ้น	19,439,552.98
การเพิ่มขึ้นในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงานก่อนภาษีเงินได้	18,665,042.54
หัก ภาษีเงินได้	(3,985.44)
การเพิ่มขึ้นในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงานหลังหักภาษีเงินได้	18,661,057.10

กองทุนเปิดกรุงศรีโกลด์เฮดจ์
งบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน
ณ 31 ธันวาคม 2566

การแสดงรายละเอียดเงินลงทุนใช้การจัดกลุ่มตามประเภทของเงินลงทุนและประเภทของอุตสาหกรรม

ประเภทเงินลงทุน/ผู้ออกตราสาร/ผู้ออกหลักทรัพย์	หมายเลขตราสาร	อัตรา ดอกเบี้ย (%)	วันครบอายุ	เงินต้น (บาท) / จำนวนหุ้น	มูลค่ายุติธรรม (บาท)	Unaudited ร้อยละของ มูลค่าเงิน ลงทุน
หลักทรัพย์ในประเทศ						
เงินฝากออมทรัพย์						
						0.76
บมจ.ท.ทิสโก้		0.600000	เมื่อทวงถาม	9,722.35	9,722.35	0.00
บมจ.ท.ยูโอบี		1.150000	เมื่อทวงถาม	1,579,505.13	1,579,505.13	0.76
หลักทรัพย์ต่างประเทศ						
หน่วยลงทุน						
						99.24
SPDR Gold Trust	US78463V1070			191,541,750.14	206,772,652.04	99.24
จำนวน 31,430.000000 หน่วย						
มูลค่าหน่วยละ 192.6000 USD						
รวมเป็นเงิน 6,053,418.00 USD						
					208,361,879.52	100.00

กองทุนเปิดกรุงศรีโกลด์เฮดจ์

รายละเอียดการลงทุน ณ 31 ธันวาคม 2566

	มูลค่าตามราคาตลาด	% NAV
หลักทรัพย์หรือทรัพย์สินในประเทศ	6,147,490.33	2.72
เงินฝากธนาคาร		
TRIS		
Rate A	9,723.47	0.00
FITCH-LONG		
Rate A-	4,536,947.77	2.01
FITCH_TH-LONG		
Rate AAA	1,600,819.09	0.71
หลักทรัพย์หรือทรัพย์สินต่างประเทศ	206,772,652.04	91.60
หน่วยลงทุน		
จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์	206,772,652.04	91.60
สัญญาซื้อขายล่วงหน้า	13,165,923.93	5.83
สัญญาที่อ้างอิงกับอัตราแลกเปลี่ยน-สัญญาแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ		
TRIS		
Rate A+	9,779,150.61	4.33
Rate A	3,461,200.10	1.53
FITCH-LONG		
Rate AA	(438,787.74)	(0.19)
Rate AA-	364,360.96	0.16
อื่นๆ	(342,367.10)	(0.15)
ลูกหนี้	46,522.23	0.02
เจ้าหนี้	(138,446.78)	(0.06)
ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย	(250,442.55)	(0.11)
มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ	225,743,699.20	100.00

กองทุนเปิดกรุงศรีโกลด์เฮดจ์

รายละเอียดการลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ณ 31 ธันวาคม 2566

ประเภทสัญญา	คู่สัญญา	วัตถุประสงค์	มูลค่าสัญญา (Notional Amount)	% NAV	วันครบ กำหนด	กำไร/ขาดทุน (net gain/loss)
สัญญาที่อ้างอิงกับอัตราแลกเปลี่ยน						
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ท.กรุงศรีอยุธยา	ป้องกันความเสี่ยง	14,962,968.00	(0.0958)	12 ม.ค. 2567	(216,293.76)
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ท.กรุงศรีอยุธยา	ป้องกันความเสี่ยง	16,522,460.00	0.2572	12 ม.ค. 2567	580,654.72
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ท.กสิกรไทย	ป้องกันความเสี่ยง	19,534,425.00	(0.4468)	12 ม.ค. 2567	(1,008,665.94)
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ท.กสิกรไทย	ป้องกันความเสี่ยง	9,758,787.50	(0.1668)	12 ม.ค. 2567	(376,651.00)
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ท.กสิกรไทย	ป้องกันความเสี่ยง	2,780,563.00	(0.0378)	12 ม.ค. 2567	(85,357.21)
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ท.กสิกรไทย	ป้องกันความเสี่ยง	17,395,339.60	0.1645	12 ม.ค. 2567	371,384.74
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ท.กสิกรไทย	ป้องกันความเสี่ยง	14,898,297.60	0.0710	12 ม.ค. 2567	160,309.58
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ท.กสิกรไทย	ป้องกันความเสี่ยง	4,879,504.00	(0.1514)	12 ม.ค. 2567	(341,778.21)
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ท.กสิกรไทย	ป้องกันความเสี่ยง	7,563,780.00	(0.0862)	12 ม.ค. 2567	(194,654.45)
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ท.เกียรตินาคิน	ป้องกันความเสี่ยง	17,445,054.00	(0.4230)	2 ก.พ. 2567	(954,980.40)
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ท.เกียรตินาคิน	ป้องกันความเสี่ยง	11,590,590.00	(0.0029)	23 ก.พ. 2567	(6,581.30)
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ท.เกียรตินาคิน	ป้องกันความเสี่ยง	91,129,274.00	1.9592	15 มี.ค. 2567	4,422,761.80
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ธนาคารไทยพาณิชย์	ป้องกันความเสี่ยง	8,876,916.20	(0.1368)	12 ม.ค. 2567	(308,776.18)
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ธนาคารไทยพาณิชย์	ป้องกันความเสี่ยง	5,075,725.00	(0.0558)	12 ม.ค. 2567	(126,002.68)
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ธนาคารไทยพาณิชย์	ป้องกันความเสี่ยง	19,553,430.00	0.4508	12 ม.ค. 2567	1,017,573.31
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ธนาคารไทยพาณิชย์	ป้องกันความเสี่ยง	21,916,250.00	0.2575	12 ม.ค. 2567	581,240.00
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ธนาคารไทยพาณิชย์	ป้องกันความเสี่ยง	23,848,880.00	0.6826	23 ก.พ. 2567	1,540,829.86
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ธนาคารไทยพาณิชย์	ป้องกันความเสี่ยง	3,942,063.00	(0.0290)	23 ก.พ. 2567	(65,359.16)
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ธนาคารไทยพาณิชย์	ป้องกันความเสี่ยง	31,170,041.50	(0.7100)	15 มี.ค. 2567	(1,602,880.40)
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ท.ทหารไทยชนชาติ	ป้องกันความเสี่ยง	17,188,512.00	(0.1744)	12 ม.ค. 2567	(393,597.05)
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ท.ทหารไทยชนชาติ	ป้องกันความเสี่ยง	141,107,274.00	4.5063	2 ก.พ. 2567	10,172,747.66

คำอธิบายการจัดอันดับตราสารของสถาบันจัดอันดับความน่าเชื่อถือ

• ตราสารหนี้ระยะกลางและระยะยาว

Moody's	S&P	TRIS	Fitch	คำอธิบาย	
Aaa	AAA	AAA	AAA	ความน่าเชื่อถือสูงสุด 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)

กองทุนเปิดกรุงศรีโกลด์เฮดจ์

ตั้งแต่วันที่ 1 กรกฎาคม 2566 ถึงวันที่ 31 ธันวาคม 2566

ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (Fund's Direct Expenses)	จำนวนเงิน (หน่วย: พันบาท)	ร้อยละของมูลค่า ทรัพย์สิน* (ต่อปี) 1/
ค่าธรรมเนียมการจัดการ (Management Fee)	1,257.77	0.9630
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ (Trustee Fee)	41.93	0.0321
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน (Registrar Fee)	209.63	0.1605
ค่าที่ปรึกษาการลงทุน (Advisory Fee)	-	-
ค่าธรรมเนียมสอบบัญชี (Auditing Fee)	32.68	0.0250
ค่าใช้จ่ายอื่น ๆ (Others)	-	-
รวมค่าใช้จ่ายทั้งหมด 2/	1,542.01	1.1806

หมายเหตุ

1/ ค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวมข้างต้น เป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่มหรือภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว

2/ ไม่รวมค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ และค่าธรรมเนียมต่าง ๆ ที่เกิดขึ้นจากการซื้อขายหลักทรัพย์

* มูลค่าทรัพย์สิน ในที่นี้ หมายถึง มูลค่าทรัพย์สินทั้งหมด หักด้วย มูลค่าหนี้สินทั้งหมด

เว้นแต่ค่าธรรมเนียมการจัดการ ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ ค่าธรรมเนียมนายทะเบียนหน่วยลงทุน และค่าใช้จ่ายที่เกี่ยวข้องกับการปฏิบัติการกองทุน ณ วันที่คำนวณ

ค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์
กองทุนเปิดกรุงศรีโกลด์เฮดจ์ / Krungsri Gold Hedged Fund
ตั้งแต่วันที่ 1 กรกฎาคม 2566 ถึงวันที่ 31 ธันวาคม 2566

บริษัท	จำนวนเงิน (ดอลลาร์สหรัฐ)	อัตราส่วน (%)
UOB Kay Hian Pte Ltd	12,458.15	100.00
รวม / Total	12,458.15	100.00

ผลการดำเนินงานของกองทุนเปิดกรุงศรีโกลด์เฮดจ์

ผลการดำเนินงาน สิ้นสุด ณ วันที่ 28 ธันวาคม 2566	% ตามช่วงเวลา			% ต่อปี				นับจากวันเริ่ม โครงการ (12 กรกฎาคม 2555)
	Year to Date	ย้อนหลัง 3 เดือน	ย้อนหลัง 6 เดือน	ย้อนหลัง 1 ปี	ย้อนหลัง 3 ปี	ย้อนหลัง 5 ปี	ย้อนหลัง 10 ปี	
KF-HGOLD	+7.75%	+8.71%	+5.68%	+7.75%	-0.13%	+6.61%	+3.22%	+0.60%
ดัชนีชี้วัด (Benchmark)*	+12.04%	+10.77%	+7.95%	+12.04%	+1.87%	+9.33%	+5.69%	+2.78%
ความผันผวนของผลการดำเนินงาน	+12.20%	+12.85%	+10.69%	+12.20%	+13.42%	+14.48%	+13.30%	+14.13%
ความผันผวนของดัชนีชี้วัด	+12.68%	+15.21%	+12.91%	+12.68%	+14.17%	+15.85%	+14.58%	+15.39%

หมายเหตุ : * ดัชนีชี้วัด (Benchmark) คือ

ดัชนีราคาทองคำในสกุลเงินดอลลาร์สหรัฐ (LBMA Gold Price PM) ปรับด้วยต้นทุนการป้องกันความเสี่ยงด้านอัตราแลกเปลี่ยนเพื่อคำนวณผลตอบแทนเป็นสกุลเงินบาท ณ วันที่ลงทุน

** ผลตอบแทนที่มีอายุเกินหนึ่งปีจะแสดงเป็นผลตอบแทนต่อปี

เอกสารการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวมฉบับนี้ ได้จัดทำตามมาตราฐานการวัดผลดำเนินงานของ
กองทุนรวมของสมาคมบริษัทจัดการลงทุน

ข้อมูลอื่นๆ ที่ผู้ถือหน่วยลงทุนควรทราบ

(1) รายงานบุคคลที่เกี่ยวข้องที่มีการทำธุรกรรมในรอบเวลาที่ผ่านมา (วันที่ 1 กรกฎาคม 2566 ถึงวันที่ 31 ธันวาคม 2566)

ชื่อกองทุน	รายชื่อบุคคลที่เกี่ยวข้อง
กองทุนเปิดกรุงศรี โกลด์เฮดจ์	ธนาคารกรุงศรีอยุธยา จำกัด (มหาชน)

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 ธันวาคม 2566

1. นายชาติ	โชคทิพย์พัฒนา
2. นายสาธิต	บัวชู
3. นางสาวสาวิณี	สุขศรีวงศ์
4. นายปีติ	ประติพัทธ์พงษ์
5. นายกวิฬ	เหรียญเสาวภาคย์
6. นายเอกชัย	บุญยะพงศ์ไชย
7. นายจาตุรงค์	สอนไว
8. นายชูศักดิ์	อวยพรชัยสกุล
9. นายพงศ์สัมพันธ์	อนูรัตน์
10. นางสาววรรดา	ต้นดิสุนทร
11. นายวัชรินทร์	คิ้วตั้งซ์

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

ไม่มีการถือหน่วยลงทุนเกิน 1 ใน 3 ของบุคคลใดบุคคลหนึ่ง

ผู้ถือหน่วยลงทุนสามารถตรวจสอบข้อมูลสัดส่วนการถือหน่วยลงทุนโดยตรงได้ที่ www.krungsriasset.com

(4) อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุนของกองทุน (portfolio turnover ratio) ในรอบระยะเวลาที่ผ่านมา เท่ากับ 72.74%

(5) ข้อมูลการลงทุน และผลการดำเนินงานของกองทุนหลัก (ข้อมูล ณ วันที่ 31/12/2023)

Performance (USD)

	NAV (%)	LBMA Gold Price PM (%)
Cumulative Performance		
1 Month	1.29	2.11
3 Months	10.15	11.11
6 Months	7.64	8.69
Annualized Performance		
1 Year	13.35	14.59
3 Years	2.52	3.26
5 Years	9.54	10.19
10 Years	5.13	5.60
Since Inception (11/18/2004)	7.96	8.43