



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-HSMUS

กองทุนเปิดกรุงศรียูเอสสมอล-มิดแคปอีควิตี้เฮดจ์เอฟเอ็กซ์

Krungsri US Small-Mid Cap Equity 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

รายงานประจำปีครั้งแรก 2566

กองทุนเปิดกรุงศรียูเอเอสสมอล-มิดแคปอควิตี้เฮดจ์เอฟเอ็กซ์

- สารบัญผู้จัดการ 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 ผู้ถือหน่วยลงทุน

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด (บริษัทฯ) ขอ นำส่งรายงานสำหรับรอบระยะเวลา 6 เดือน ของกองทุนเปิดกรุงศรียูเอสเอสแอล-มิดแคปอควิตีไฮด์เจเอฟเอ็กซ์ (KF-HSMUS) ตั้งแต่วันที่ 1 กรกฎาคม 2566 ถึงวันที่ 31 ธันวาคม 2566 มายังผู้ถือหน่วยลงทุน โดยมีรายละเอียดดังนี้

ผลการดำเนินงาน

กองทุนเปิดกรุงศรียูเอสเอสแอล-มิดแคปอควิตีไฮด์เจเอฟเอ็กซ์ มีมูลค่าทรัพย์สินสุทธิ ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2566 เท่ากับ 71.60 ล้านบาท คิดเป็นมูลค่าทรัพย์สินสุทธิต่อหน่วยลงทุนเท่ากับ 12.7642 บาท โดยมีผลการดำเนินงานย้อนหลัง 6 เดือน เพิ่มขึ้นร้อยละ 2.27 เพิ่มขึ้นมากกว่าเกณฑ์มาตรฐานการวัดผลการดำเนินงาน ที่ลดลงร้อยละ 0.23

ภาวะการลงทุนในช่วงที่ผ่านมา

ในรอบครึ่งปีบัญชีที่ผ่านมา กองทุน Schroder International Selection Fund - US Small & Mid Cap Equity (กองทุนหลัก) ปรับตัวเพิ่มขึ้นประมาณ 5.5% โดยในช่วงครึ่งหลังของปี 2566 ตลาดหุ้นสหรัฐฯ ทอยปรับตัวขึ้นต่อเนื่อง หลังภาพเงินเฟ้อส่งสัญญาณชะลอตัวลง ทำให้ตลาดคาดว่าธนาคารกลางสหรัฐฯ (Fed) มีโอกาสลดอัตราดอกเบี้ยนโยบายลงมาได้เร็วกว่าที่คาดการณ์ โดยมองว่าอาจลดลงมาได้ในไตรมาส 2 ของปี 2567 นอกจากนี้ ตลาดยังคาดว่าเศรษฐกิจสหรัฐฯ จะไม่มีการหดตัวที่รุนแรง (Soft Landing) เนื่องจากการจ้างงานและการบริโภคยังคงแข็งแกร่ง อย่างไรก็ตาม หุ้นกลุ่มขนาดกลางและเล็กของสหรัฐฯ ปรับตัวขึ้นได้น้อยกว่าตลาด เนื่องจากบริษัทขนาดกลางและเล็กยังคงต้องเจอกับต้นทุนการกู้ยืมที่สูงอยู่ อีกทั้งหุ้นที่เติบโตได้ดีในช่วงที่ผ่านมาส่วนใหญ่เป็นหุ้น Big Tech ที่ได้รับแรงส่งจากกลุ่ม AI อย่างไรก็ตาม หาก Fed เริ่มลดอัตราดอกเบี้ยนโยบายลง คาดว่าหุ้นในกลุ่มขนาดกลางและเล็กอาจทยอยกลับมาฟื้นตัวได้ดี ทั้งนี้ ตลาดสหรัฐฯ ยังคงมีความผันผวน โดยต้องจับตามองความเสี่ยงภูมิรัฐศาสตร์ใน Red Sea และความกังวลเรื่องสงครามระหว่างอิสราเอลและกลุ่มฮามาสที่ยืดเยื้อ ซึ่งอาจกดดันให้อัตราเงินเฟ้อปรับตัวขึ้นมาได้

ณ สิ้นเดือนพฤศจิกายน 2566 กองทุนหลักมีสัดส่วนการลงทุนหุ้นหมวดอุตสาหกรรม 20.3% หมวดเทคโนโลยี 15.8% หมวดการเงิน 14.8% และหมวด Healthcare 13.5% เป็นต้น

แนวโน้มการลงทุน

การลงทุนในตลาดสหรัฐฯ มีสัญญาณดีขึ้น ภายหลัง Fed มีการส่งสัญญาณหยุดการขึ้นอัตราดอกเบี้ยนโยบายเนื่องจากตัวเลขเงินเฟ้อส่งสัญญาณชะลอตัว ทั้งนี้ ตลาดมองว่า Fed มีโอกาสที่จะลดอัตราดอกเบี้ยนโยบายลงได้ในช่วงปี 2567 ประมาณ 4 ครั้ง ซึ่งอาจเป็นแรงส่งให้กับตลาดและกองทุนหลักที่เน้นลงทุนในหุ้นสหรัฐฯ ขนาดกลางและเล็ก โดยการลดอัตราดอกเบี้ยนโยบายจะส่งผลให้บริษัทเจอกับต้นทุนการกู้ยืมที่ลดลง อย่างไรก็ตาม ตลาดสหรัฐฯ จะยังคงมีความผันผวน จากทิศทางอัตราดอกเบี้ยนโยบายและความกังวลเรื่องภูมิรัฐศาสตร์ โดยเฉพาะความตึงเครียดที่มากขึ้นในตะวันออกกลาง ประกอบกับต้องจับตามองการเลือกตั้งประธานาธิบดีสหรัฐฯ ในช่วงปลายปี ที่อาจทำให้ตลาดมีความผันผวนขึ้นมาอีกได้

บริษัทฯ ใคร่ขอขอบพระคุณท่านผู้ถือหน่วยลงทุนที่ได้มอบความไว้วางใจให้บริษัทฯ เป็นผู้บริหารเงินลงทุนของท่าน ทั้งนี้ บริษัทฯ จะพิจารณาดำเนินนโยบายการลงทุนที่เหมาะสมกับสถานการณ์ด้วยความระมัดระวัง และคำนึงถึงผลประโยชน์สูงสุดของผู้ถือหน่วยลงทุนเป็นสำคัญ

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด



รายงานของผู้ดูแลผลประโยชน์

เรียน ผู้ถือหุ้นรายย่อย
กองทุนเปิดกรุงศรียูเอสเอสแอล-มิตแคปอิคิวตีเฮดจ์เอฟเอ็กซ์

ตามที่ธนาคารสแตนดาร์ดชาร์เตอร์ด (ไทย) จำกัด (มหาชน) (“ธนาคารฯ”) ในฐานะผู้ดูแลผลประโยชน์ กองทุนเปิดกรุงศรียูเอสเอสแอล-มิตแคปอิคิวตีเฮดจ์เอฟเอ็กซ์ (“กองทุน”) ได้ปฏิบัติหน้าที่เป็นผู้ดูแลผลประโยชน์ของกองทุน ซึ่งบริหารและจัดการโดยบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด สำหรับรอบระยะเวลาตั้งแต่วันที่ 1 กรกฎาคม 2566 ถึงวันที่ 31 ธันวาคม 2566

ธนาคารฯ เห็นว่าสำหรับรอบระยะเวลาดังกล่าว บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด ได้บริหารจัดการกองทุนโดยในสาระสำคัญเป็นไปตามโครงการจัดการกองทุน ซึ่งได้รับอนุมัติจากสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ตลอดจนข้อมูลพื้นที่ทำไว้กับผู้ถือหุ้นรายย่อยภายใต้พระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ 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.athanit

ธนาคารสแตนดาร์ดชาร์เตอร์ด (ไทย) จำกัด (มหาชน)
140 ถนนวิบูลย์ 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

กองทุนเปิดกรุงศรียูเอสสมอล-มิดแคปอิกวิดีเฮดจ์เอฟเอ็กซ์

งบแสดงฐานะการเงิน

ณ 31 ธันวาคม 2566

	Unaudited (บาท)
สินทรัพย์	
เงินลงทุนตามราคายุติธรรม (ราคาทุน 65,221,121.24 บาท)	70,283,123.01
เงินฝากธนาคาร	924,025.23
ลูกหนี้จากสัญญาอนุพันธ์	2,907,013.60
ลูกหนี้	
จากดอกเบี้ย	521.34
จากการขายหน่วยลงทุน	998,030.86
จากการรับเงินค่าตอบแทนจากเงินลงทุนในต่างประเทศ	40,537.35
รวมสินทรัพย์	<u>75,153,251.39</u>
หนี้สิน	
เจ้าหนี้จากสัญญาอนุพันธ์	2,162.30
เจ้าหนี้	
จากการรับซื้อคืนหน่วยลงทุน	20,000.00
จากการซื้อเงินลงทุน	3,415,800.00
ค่าธรรมเนียมสับเปลี่ยนหน่วยลงทุน	25,197.48
ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย	90,706.65
ภาษีเงินได้ค้างจ่าย	78.20
หนี้สินอื่น	1,578.15
รวมหนี้สิน	<u>3,555,522.78</u>
สินทรัพย์สุทธิ	<u>71,597,728.61</u>
สินทรัพย์สุทธิ:	
หน่วยลงทุนจดทะเบียน 300 ล้านหน่วย มูลค่าที่ตราไว้หน่วยละ 10 บาท	
ทุนที่ได้รับจากผู้ถือหน่วยลงทุน	56,092,261.22
กำไรสะสม(ขาดทุนสะสม)	61,171,631.74
บัญชีปรับสมดุล	(45,666,164.35)
สินทรัพย์สุทธิ	<u>71,597,728.61</u>
สินทรัพย์สุทธิต่อหน่วย	12.7642
จำนวนหน่วยลงทุนที่จำหน่ายได้แล้วทั้งหมด ณ วันสิ้นงวด (หน่วย)	5,609,226.1204

กองทุนเปิดกรุงศรียูเอสสมอล-มิดแคปอิกวิดีเฮดจ์เอฟเอ็กซ์
งบกำไรขาดทุนเบ็ดเสร็จ
สำหรับงวดบัญชีสิ้นสุดวันที่ 31 ธันวาคม 2566

	Unaudited (บาท)
รายได้จากการลงทุน	
รายได้ดอกเบี้ย	521.35
รายได้จากการรับเงินค่าตอบแทนจากเงินลงทุนในต่างประเทศ	130,276.46
รวมรายได้	130,797.81
ค่าใช้จ่าย	
ค่าธรรมเนียมการจัดการ	302,904.47
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์	12,116.18
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน	60,580.89
ค่าธรรมเนียมวิชาชีพ	35,191.55
รวมค่าใช้จ่าย	410,793.09
รายได้จากการลงทุนสุทธิ	(279,995.28)
รายการกำไร (ขาดทุน) สุทธิจากเงินลงทุน	
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิที่เกิดขึ้นจากเงินลงทุน	410,431.86
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิที่ยังไม่เกิดขึ้นจากเงินลงทุน	2,011,011.50
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิที่ยังไม่เกิดขึ้นจากสัญญาอนุพันธ์	6,202,522.84
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิจากอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ	(7,987,216.58)
รวมรายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิจากเงินลงทุนที่เกิดขึ้นและยังไม่มีเกิดขึ้น	636,749.62
การเพิ่มขึ้นในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงานก่อนภาษีเงินได้	356,754.34
หัก ภาษีเงินได้	(78.20)
การเพิ่มขึ้นในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงานหลังหักภาษีเงินได้	356,676.14

กองทุนเปิดกรุงศรียูเอสสมอล-มิดแคปอควิตี้เฮดจ์เอพีเอ็กซ์

งบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน

ณ 31 ธันวาคม 2566

การแสดงรายละเอียดเงินลงทุนใช้การจัดกลุ่มตามประเภทของเงินลงทุนและประเภทของอุตสาหกรรม

ประเภทเงินลงทุน/ผู้ออกตราสาร/ผู้ออกหลักทรัพย์	หมายเลขตราสาร	อัตราดอกเบี้ย (%)	วันครบอายุ	เงินต้น (บาท) / จำนวนหุ้น	มูลค่ายุติธรรม (บาท)	Unaudited ร้อยละของมูลค่าเงินลงทุน
หลักทรัพย์ต่างประเทศ						
เงินฝากออมทรัพย์						2.43
บมจ.ธ.สแตนดาร์ดชาร์เตอร์ด(ไทย)			เมื่อทวงถาม	1,707,900.00	1,707,900.00	2.43
จำนวนเงิน 50,000.00 USD						
หน่วยลงทุน						97.57
Schroder International Selection Fund -						
US Small & Mid Cap Equity	LU0607219986			63,513,221.24	68,575,223.01	97.57
จำนวน 4,030.620000 หน่วย						
มูลค่าหน่วยละ 498.0844 USD						
รวมเป็นเงิน 2,007,588.94 USD						
					70,283,123.01	100.00

กองทุนเปิดกรุงศรียูเอสสมอล-มิดแคปอิกวิทีเฮดจ์เอฟเอ็กซ์

รายละเอียดการลงทุน ณ 31 ธันวาคม 2566

	มูลค่าตามราคาตลาด	% NAV
หลักทรัพย์หรือทรัพย์สินในประเทศ	924,546.57	1.29
เงินฝากธนาคาร		
FITCH-LONG		
Rate A-	924,546.57	1.29
หลักทรัพย์หรือทรัพย์สินต่างประเทศ	70,283,123.01	98.17
หน่วยลงทุน		
ไม่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์	68,575,223.01	95.78
เงินฝากธนาคาร		
FITCH-LONG		
Rate A-	1,707,900.00	2.39
สัญญาซื้อขายล่วงหน้า	2,904,851.30	4.06
สัญญาที่อ้างอิงกับอัตราแลกเปลี่ยน-สัญญาแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ		
TRIS		
Rate A+	1,561,153.00	2.18
FITCH-LONG		
Rate AA	1,192,667.25	1.67
Rate AA-	151,031.05	0.21
อื่นๆ	(2,514,792.27)	(3.52)
ลูกหนี้	1,038,568.21	1.45
เจ้าหนี้	(3,462,653.83)	(4.84)
ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย	(90,706.65)	(0.13)
มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ	71,597,728.61	100.00

กองทุนเปิดกรุงศรียูเอสเอสมอล-มิดแคปอิกวิทีเฮดจ์เอฟเอ็กซ์

รายละเอียดการลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ณ 31 ธันวาคม 2566

ประเภทสัญญา	คู่สัญญา	วัตถุประสงค์	มูลค่าสัญญา (Notional Amount)	% NAV	วันครบกำหนด	กำไร/ขาดทุน (net gain/loss)
สัญญาที่อ้างอิงกับอัตราแลกเปลี่ยน						
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ท.กรุงศรีอยุธยา	ป้องกันความเสี่ยง	7,450,395.00	0.2109	15 มี.ค. 2567	151,031.05
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ธนาคารไทยพาณิชย์	ป้องกันความเสี่ยง	24,565,317.00	1.6658	2 ก.พ. 2567	1,192,667.25
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ท.ทหารไทยชนชาติ	ป้องกันความเสี่ยง	1,707,100.00	0.0011	2 ม.ค. 2567	800.00
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ท.ทหารไทยชนชาติ	ป้องกันความเสี่ยง	12,746,813.00	1.3070	12 ม.ค. 2567	935,754.92
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ท.ทหารไทยชนชาติ	ป้องกันความเสี่ยง	16,236,297.00	0.7339	23 ก.พ. 2567	525,446.46
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ท.ทหารไทยชนชาติ	ป้องกันความเสี่ยง	3,869,349.00	0.1415	15 มี.ค. 2567	101,313.92
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ท.ทหารไทยชนชาติ	ป้องกันความเสี่ยง	4,376,905.50	(0.0030)	15 มี.ค. 2567	(2,162.30)

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	ผู้ออกตราสารหนี้มีสถานะทั้งด้านการตลาดและการเงินที่แข็งแกร่งในระดับดี 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)

กองทุนเปิดกรุงศรีอยุธยาเอสเอ็มอี-มิดแคปอิคิวตีเฮดจ์เอฟเอ็กซ์

ตั้งแต่วันที่ 1 กรกฎาคม 2566 ถึงวันที่ 31 ธันวาคม 2566

ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (Fund's Direct Expenses)	จำนวนเงิน (หน่วย: พันบาท)	ร้อยละของมูลค่า ทรัพย์สิน* (ต่อปี) 1/
ค่าธรรมเนียมการจัดการ (Management Fee)	302.90	0.8025
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ (Trustee Fee)	12.12	0.0321
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน (Registrar Fee)	60.58	0.1605
ค่าที่ปรึกษาการลงทุน (Advisory Fee)	-	-
ค่าธรรมเนียมสอบบัญชี (Auditing Fee)	35.19	0.0932
ค่าใช้จ่ายอื่น ๆ (Others)	-	-
รวมค่าใช้จ่ายทั้งหมด 2/	410.79	1.0883

หมายเหตุ

1/ ค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวมข้างต้น เป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่มหรือภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว

2/ ไม่รวมค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ และค่าธรรมเนียมต่าง ๆ ที่เกิดขึ้นจากการซื้อขายหลักทรัพย์

* มูลค่าทรัพย์สิน ในที่นี้ หมายถึง มูลค่าทรัพย์สินทั้งหมด หักด้วย มูลค่าหนี้สินทั้งหมด

เว้นแต่ค่าธรรมเนียมการจัดการ ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ ค่าธรรมเนียมนายทะเบียนหน่วยลงทุน

และค่าใช้จ่ายที่เกี่ยวข้องกับการปฏิบัติการกองทุน ณ วันที่คำนวณ

ผลการดำเนินงานของกองทุนเปิดกรุงศรียูเอเอสสมอล-มิดแคปอิคิวตีไฮด์เจฟเอ็กซ์

ผลการดำเนินงาน สิ้นสุด ณ วันที่ 28 ธ.ค. 2566	% ตามช่วงเวลา			% ต่อปี				นับจากวันเริ่ม โครงการ (30 มิถุนายน 2560)
	Year to Date	ย้อนหลัง 3 เดือน	ย้อนหลัง 6 เดือน	ย้อนหลัง 1 ปี	ย้อนหลัง 3 ปี	ย้อนหลัง 5 ปี	ย้อนหลัง 10 ปี	
KF-HSMUS	6.60%	8.08%	2.27%	6.60%	2.88%	6.77%	N/A	3.83%
ดัชนีชี้วัด (Benchmark)*	-1.41%	-0.02%	-0.23%	-1.41%	-3.60%	6.70%	N/A	4.74%
ความผันผวนของผลการดำเนินงาน	15.67%	16.38%	14.82%	15.67%	18.74%	20.97%	N/A	19.26%
ความผันผวนของตัวชี้วัด	0.90%	0.91%	0.69%	0.90%	16.23%	23.61%	N/A	22.01%

หมายเหตุ : * ดัชนีชี้วัด (Benchmark) คือ ดัชนี Russell 2500 Net TR Lagged ในสกุลเงินเหรียญสหรัฐ ปรับด้วยต้นทุนการป้องกันความเสี่ยงด้านอัตราแลกเปลี่ยน เพื่อเทียบเท่าค่าสกุลเงินบาท ณ วันที่คำนวณผลตอบแทน

** ผลตอบแทนที่มีอายุเกินหนึ่งปีจะแสดงเป็นผลตอบแทนต่อปี

เอกสารการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวมฉบับนี้ ได้จัดทำตามมาตรฐานการวัดผลดำเนินงาน
ของกองทุนรวมของสมาคมบริษัทจัดการลงทุน

ข้อมูลอื่นๆ ที่ผู้ถือหน่วยลงทุนควรทราบ

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

ชื่อกองทุน	รายชื่อบุคคลที่เกี่ยวข้อง
กองทุนเปิดกรุงศรียูเอสสมอล-มิดแคปอควิตีเฮดจ์เอฟเอ็กซ์	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 31 ธันวาคม 2566

- | | |
|--------------------|-----------------|
| 1. นายทลิต | โชคทิพย์พัฒนา |
| 2. นายสาริต | บัวชู |
| 3. นางสาวสาวิณี | สุขศรีวงศ์ |
| 4. นายปีติ | ประติพัทธ์พงษ์ |
| 5. นายกวิพ | เหรียญเสาวภาคย์ |
| 6. นายเอกชัย | บุญยะพงศ์ไชย |
| 7. นายจาตุรงค์ | สอนไว |
| 8. นายชูศักดิ์ | อวยพรชัยสกุล |
| 9. นายพงศ์สัมพันธ์ | อนูรัตน์ |
| 10. นางสาววรรดา | ตันติสุนทร |
| 11. นายวัชรินทร์ | ด้วงสังข์ |

(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 11.47%

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

Share class performance (%)

Performance (%)	1 month	3 months	6 months	YTD	1 year	3 years	5 years	10 years
Fund (bid to bid)	9.1	10.3	5.5	12.1	12.1	17.9	62.0	116.8
Fund (offer to bid)	9.1	10.3	5.5	12.1	12.1	17.9	62.0	116.8
Target	12.5	14.2	9.6	17.9	17.9	13.2	73.7	117.0
Comparator 1	8.8	12.2	7.5	18.4	18.4	12.5	78.9	121.8
Comparator 2	10.3	12.1	8.4	15.0	15.0	24.4	78.1	131.5

Annualized performance (%)	3 years	5 years	10 years
Fund (bid to bid)	5.6	10.1	8.0
Fund (offer to bid)	5.6	10.1	8.0
Target	4.2	11.7	8.1
Comparator 1	4.0	12.3	8.3
Comparator 2	7.5	12.2	8.8

Top 10 holdings (%)

Holding name	%
Masimo Corp	2.3
LiveRamp Holdings Inc	2.0
Assurant Inc	1.8
Stericycle Inc	1.8
Entegris Inc	1.7
Hexcel Corp	1.7
Kemper Corp	1.7
Valvoline Inc	1.7
Kirby Corp	1.6
Lumentum Holdings Inc	1.6

Asset allocation

Sector (%)

