



krungsri

Asset
Management

Make Life
Simple

A member of  MUGF
a global financial group

รายงานประจำปีแรก 2567

รอบระยะเวลาตั้งแต่วันที่ 1 กรกฎาคม 2567 – 31 ธันวาคม 2567

กองทุนรวม

KF-HSMUS

กองทุนเปิดกรุงศรียูเอสสมอล-มิดแคปอิกวิตีเฮดจ์เอฟเอ็กซ์

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 2567

กองทุนเปิดกรุงศรียูเอเอสสมอล-มิดแคปอควิตีไฮด์เจฟเอ็กซ์

- 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 ผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุน

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด (บริษัท) ขอนำเสนอรายงานสำหรับรอบระยะเวลา 6 เดือน ของกองทุนเปิดกรุงศรียูเอสเอสแอล-มิดแคปอิดิวตีไฮด์จ์เอฟเอ็กซ์ (KF-HSMUS) ตั้งแต่วันที่ 1 กรกฎาคม 2567 ถึงวันที่ 31 ธันวาคม 2567 มายังผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุน โดยมีรายละเอียดดังนี้

ผลการดำเนินงาน

กองทุนเปิดกรุงศรียูเอสเอสแอล-มิดแคปอิดิวตีไฮด์จ์เอฟเอ็กซ์ มีมูลค่าทรัพย์สินสุทธิ ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2567 เท่ากับ 387.56 ล้านบาท คิดเป็นมูลค่าทรัพย์สินสุทธิต่อหน่วยลงทุนเท่ากับ 13.3013 บาท โดยมีผลการดำเนินงานย้อนหลัง 6 เดือน เพิ่มขึ้นร้อยละ 2.64 น้อยกว่าเกณฑ์มาตรฐานการวัดผลการดำเนินงาน ที่เพิ่มขึ้นร้อยละ 6.73

ภาวะการลงทุนในช่วงที่ผ่านมา

ในรอบครึ่งปีบัญชีที่ผ่านมา Schroder International Selection Fund-US Small & Mid Cap Equity (กองทุนหลัก) ปรับตัวเพิ่มขึ้นประมาณ 5.9% โดยตลาดหุ้นสหรัฐฯ ปรับตัวดีขึ้นต่อเนื่อง หลังจากที่ทางธนาคารกลางสหรัฐฯ (Fed) ส่งสัญญาณว่าจะสามารถลดอัตราดอกเบี้ยนโยบายลงครั้งแรกได้ในไตรมาสสุดท้ายของปี 2567 เนื่องจากภาพเงินเฟ้อที่ชะลอตัวและการจ้างงานที่ปรับลดลง ทั้งนี้ Fed มีการลดอัตราดอกเบี้ยนโยบายครั้งแรกลง 50bps ในเดือนกันยายน 2567 และปรับลดลงอีก 25bps ในเดือนพฤศจิกายน และธันวาคม ปี 2567 ส่งผลให้อัตราดอกเบี้ยนโยบายของสหรัฐฯ ลดลงมาอยู่ที่ระดับ 4.25-4.5% ซึ่งเป็นผลดีต่อหุ้นขนาดกลางและเล็กของสหรัฐฯ ที่มีการกู้ยืมที่สูง อย่างไรก็ตาม ตลาดยังคงมีความผันผวน โดยเฉพาะช่วงใกล้การเลือกตั้งประธานาธิบดีสหรัฐฯ โดยหลังจากที่ทรัมป์ชนะการเลือกตั้ง และพรรค Republican ได้ครองเสียงส่วนมากทั้งในสภานบนและสภาล่าง ตลาดสหรัฐฯ ปรับตัวขึ้นได้แรง โดยเฉพาะในกลุ่ม Mid-Small Cap เนื่องจากคาดว่าทรัมป์จะมีการนโยบายลดภาษีนิติบุคคล อีกทั้งนโยบายที่เอื้อต่อบริษัทสหรัฐฯ มากขึ้น ทั้งนี้ กองทุนหลักเน้นลงทุนในหุ้นขนาดกลางและเล็กของสหรัฐฯ ที่คาดว่าจะสามารถทยอยฟื้นตัวได้จากอัตราดอกเบี้ยนโยบายที่ลดลง อีกทั้งแนวโน้มการลดภาษีของทรัมป์ที่จะช่วยให้หุ้นกลุ่มขนาดกลางและเล็กกลับมาขยายตัวได้

ณ สิ้นเดือนพฤศจิกายน 2567 กองทุนหลักมีสัดส่วนการลงทุนหุ้นหมวดเทคโนโลยี 21.2% หมวด Industrials 16.0% หมวด Financials 15.9% และหมวด Healthcare 13.0% เป็นต้น

แนวโน้มการลงทุน

สำหรับแนวโน้มการลงทุน กองทุนหลักยังคงมีมุมมองที่ดีต่อการลงทุนในหุ้นขนาดกลางและเล็กตลาดสหรัฐฯ โดยเฉพาะหลังจากที่ทรัมป์ชนะการเลือกตั้ง คาดว่าจะเห็นนโยบายกระตุ้นเศรษฐกิจในสหรัฐฯ และนโยบายการลดภาษีนิติบุคคล อย่างไรก็ตาม การมาของทรัมป์อาจสร้างความผันผวนมากขึ้นในตลาด โดยเฉพาะจากความไม่แน่นอนทางการเมือง อีกทั้งทิศทางเงินเฟ้อที่มีแนวโน้มเร่งตัวขึ้นจากการใช้นโยบายกระตุ้นของสหรัฐฯ ซึ่งอาจทำให้ Fed ไม่สามารถลดอัตราดอกเบี้ยนโยบายลงได้เร็วเท่ากับที่ตลาดคาด อย่างไรก็ตาม คาดว่า Fed จะยังคงอยู่ในทิศทางลดอัตราดอกเบี้ยซึ่งอาจทำได้ประมาณ 1-2 ครั้งในปี 2568

บริษัทฯ ใคร่ขอขอบพระคุณท่านผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุนที่ได้มอบความไว้วางใจให้บริษัทฯ เป็นผู้บริหารเงินลงทุนของท่าน ทั้งนี้ บริษัทฯ จะพิจารณาดำเนินนโยบายการลงทุนที่เหมาะสมกับสถานการณ์ด้วยความระมัดระวัง และคำนึงถึงผลประโยชน์สูงสุดของผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุนเป็นสำคัญ

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด



รายงานของผู้ดูแลผลประโยชน์

เรียน ผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุน
กองทุนเปิดกรุงศรียูเอสเอสโมล-มิตแคปอิควิตีเฮดจ์เอฟเอ็กซ์

ตามที่ธนาคารสแตนดาร์ดชาร์เตอร์ด (ไทย) จำกัด (มหาชน) (“ธนาคาร”) ในฐานะผู้ดูแลผลประโยชน์ กองทุนเปิดกรุงศรียูเอสเอสโมล-มิตแคปอิควิตีเฮดจ์เอฟเอ็กซ์ (“กองทุน”) ได้ปฏิบัติหน้าที่เป็นผู้ดูแลผลประโยชน์ของกองทุน ซึ่งบริหารและจัดการโดยบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด สำหรับรอบระยะเวลาตั้งแต่วันที่ 1 กรกฎาคม 2567 ถึงวันที่ 31 ธันวาคม 2567

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

ธนาคารสแตนดาร์ดชาร์เตอร์ด (ไทย) จำกัด (มหาชน)

(นางสาวกัลยวีร์ สัจจะสุวรรณ)

ผู้ช่วยผู้อำนวยการบริการกองทุน

ฝ่ายปฏิบัติการบริการหลักทรัพย์สายงานพัฒนาและปฏิรูป เทคโนโลยี และปฏิบัติการ

ธนาคารสแตนดาร์ดชาร์เตอร์ด (ไทย) จำกัด (มหาชน)

10 มกราคม 2568

โทรศัพท์ 02-106-1468

กรุณาติดต่อ คุณอัญชลี บางพันธ์

ธนาคารสแตนดาร์ดชาร์เตอร์ด (ไทย) จำกัด (มหาชน)
140 ถนนวิทญู 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-มิดแคปอิกวิตีเฮดจ์เอฟเอ็กซ์

งบแสดงฐานะการเงิน

ณ 31 ธันวาคม 2567

	Unaudited (บาท)
สินทรัพย์	
เงินลงทุนตามราคายุติธรรม (ราคาทุน 402,705,768.62 บาท)	401,332,603.31
เงินฝากธนาคาร	3,633,122.09
ลูกหนี้จากสัญญาอนุพันธ์	8,193,758.18
ลูกหนี้	
จากดอกเบี้ย	5,023.17
จากการขายหน่วยลงทุน	11,903,722.42
จากการรับเงินค่าตอบแทนจากเงินลงทุนในต่างประเทศ	178,383.42
รวมสินทรัพย์	<u>425,246,612.59</u>
หนี้สิน	
เจ้าหนี้จากสัญญาอนุพันธ์	5,508,137.37
เจ้าหนี้	
จากการรับซื้อคืนหน่วยลงทุน	503,144.88
จากการซื้อเงินลงทุน	30,271,920.00
ค่าธรรมเนียมสับเปลี่ยนหน่วยลงทุน	1,062,355.65
ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย	335,593.39
ภาษีเงินได้ค้างจ่าย	753.48
หนี้สินอื่น	5,865.58
รวมหนี้สิน	<u>37,687,770.35</u>
สินทรัพย์สุทธิ	<u>387,558,842.24</u>
สินทรัพย์สุทธิ:	
หน่วยลงทุนจดทะเบียน 300 ล้านหน่วย มูลค่าที่ตราไว้หน่วยละ 10 บาท	
ทุนที่ได้รับจากผู้ถือหน่วยลงทุน	291,369,114.41
กำไรสะสม(ขาดทุนสะสม)	60,788,802.32
บัญชีปรับสมดุล	35,400,925.51
สินทรัพย์สุทธิ	<u>387,558,842.24</u>
สินทรัพย์สุทธิต่อหน่วย	13.3013
จำนวนหน่วยลงทุนที่จำหน่ายได้แล้วทั้งหมด ณ วันสิ้นงวด (หน่วย)	29,136,911.4336

กองทุนเปิดกรุงศรียูเอสสมอล-มิดแคปอิกวิดีเฮดจ์เอฟเอ็กซ์
งบกำไรขาดทุนเบ็ดเสร็จ
สำหรับงวดบัญชีสิ้นสุดวันที่ 31 ธันวาคม 2567

	Unaudited (บาท)
รายได้จากการลงทุน	
รายได้ดอกเบี้ย	5,023.14
รายได้จากการรับเงินค่าตอบแทนจากเงินลงทุนในต่างประเทศ	349,141.72
รวมรายได้	354,164.86
ค่าใช้จ่าย	
ค่าธรรมเนียมการจัดการ	1,100,931.45
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์	44,037.33
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน	220,186.31
ค่าธรรมเนียมวิชาชีพ	35,287.52
รวมค่าใช้จ่าย	1,400,442.61
รายได้จากการลงทุนสุทธิ	(1,046,277.75)
รายการกำไร (ขาดทุน) สุทธิจากเงินลงทุน	
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิที่เกิดขึ้นจากเงินลงทุน	11,033,064.94
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิที่ยังไม่เกิดขึ้นจากเงินลงทุน	(6,177,478.22)
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิที่ยังไม่เกิดขึ้นจากสัญญาอนุพันธ์	3,662,685.54
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิจากอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ	(8,353,426.85)
รวมรายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิจากเงินลงทุนที่เกิดขึ้นและยังไม่มีเกิดขึ้น	164,845.41
การเพิ่มขึ้นในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงานก่อนภาษีเงินได้	(881,432.34)
หัก ภาษีเงินได้	(753.47)
การเพิ่มขึ้นในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงานหลังหักภาษีเงินได้	(882,185.81)

กองทุนเปิดกรุงศรียูเอสสมอล-มิดแคปอิกวิดีเซคจ์เอฟเอ็กซ์

งบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน

ณ 31 ธันวาคม 2567

การแสดงรายละเอียดเงินลงทุนใช้การจัดกลุ่มตามประเภทของเงินลงทุนและประเภทของอุตสาหกรรม

ประเภทเงินลงทุน/ผู้ออกตราสาร/ผู้ออกหลักทรัพย์	หมายเลขตราสาร	อัตรา ดอกเบี้ย วันครบอายุ (%)	เงินต้น (บาท) / จำนวนหุ้น	มูลค่ายุติธรรม (บาท)	Unaudited ร้อยละของ มูลค่าเงิน ลงทุน	
หลักทรัพย์ต่างประเทศ						
เงินฝากออมทรัพย์					2.81	
บมจ.ธ.สแตนดาร์ดชาร์เตอร์ด(ไทย)			เมื่อทวงถาม	11,283,790.00	11,283,790.00	2.81
จำนวนเงิน 331,000.00 USD						
หน่วยลงทุน					97.19	
Schroder International Selection Fund - US Small & Mid Cap Equity	LU0607219986			391,421,978.62	390,048,813.31	97.19
จำนวน 20,833.780000 หน่วย						
มูลค่าหน่วยละ 549.1916 USD						
รวมเป็นเงิน 11,441,736.97 USD						
				401,332,603.31	100.00	

กองทุนเปิดกรุงศรียูเอสสมอล-มิดแคปอิกวิทีเฮดจ์เอฟเอ็กซ์

รายละเอียดการลงทุน ณ 31 ธันวาคม 2567

	มูลค่าตามราคาตลาด	% NAV
หลักทรัพย์หรือทรัพย์สินในประเทศ	3,638,145.26	0.94
เงินฝากธนาคาร		
FITCH-LONG		
Rate A-	3,638,145.26	0.94
หลักทรัพย์หรือทรัพย์สินต่างประเทศ	401,332,603.31	103.55
หน่วยลงทุน		
ไม่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์	390,048,813.31	100.64
เงินฝากธนาคาร		
FITCH-LONG		
Rate A-	11,283,790.00	2.91
สัญญาซื้อขายล่วงหน้า	2,685,620.81	0.69
สัญญาที่อ้างอิงกับอัตราแลกเปลี่ยน-สัญญาแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ		
TRIS		
Rate A+	(3,214,326.46)	(0.83)
Rate A	6,447,562.90	1.66
FITCH-LONG		
Rate AA	(547,615.63)	(0.14)
อื่นๆ	(20,097,527.14)	(5.18)
ลูกหนี้	12,082,105.84	3.12
เจ้าหนี้	(31,844,039.59)	(8.21)
ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย	(335,593.39)	(0.09)
มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ	387,558,842.24	100.00

กองทุนเปิดกรุงศรียูเอสสมอล-มิดแคปอิกวิทีเฮดจ์เอฟเอ็กซ์

รายละเอียดการลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ณ 31 ธันวาคม 2567

ประเภทสัญญา	คู่สัญญา	วัตถุประสงค์	มูลค่าสัญญา (Notional Amount)	% NAV	วันครบ กำหนด	กำไร/ขาดทุน (net gain/loss)
สัญญาที่อ้างอิงกับอัตราแลกเปลี่ยน						
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ช.กลีกรไทย	ป้องกันความเสี่ยง	18,919,062.00	0.0178	2 ม.ค. 2568	69,068.00
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ช.กลีกรไทย	ป้องกันความเสี่ยง	25,553,476.00	0.1423	10 ม.ค. 2568	551,413.10
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ช.กลีกรไทย	ป้องกันความเสี่ยง	28,793,856.00	0.1171	10 ม.ค. 2568	453,791.94
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ช.กลีกรไทย	ป้องกันความเสี่ยง	34,044,046.00	0.0352	21 ก.พ. 2568	136,353.24
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ช.กลีกรไทย	ป้องกันความเสี่ยง	22,725,595.50	(0.0013)	21 ก.พ. 2568	(5,003.45)
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ช.กลีกรไทย	ป้องกันความเสี่ยง	9,889,164.00	(0.0648)	14 มี.ค. 2568	(251,188.34)
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ช.กลีกรไทย	ป้องกันความเสี่ยง	21,670,928.00	(0.0128)	4 เม.ย. 2568	(49,602.50)
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ช.กลีกรไทย	ป้องกันความเสี่ยง	22,091,466.00	(0.0216)	4 เม.ย. 2568	(83,712.00)
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ช.กลีกรไทย	ป้องกันความเสี่ยง	66,231,352.00	(0.1731)	2 พ.ค. 2568	(670,769.47)
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ช.เกียรตินาคินภัทร	ป้องกันความเสี่ยง	80,008,510.50	1.0465	10 ม.ค. 2568	4,055,748.00
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ช.เกียรตินาคินภัทร	ป้องกันความเสี่ยง	11,368,430.50	0.0479	21 ก.พ. 2568	185,819.20
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ช.เกียรตินาคินภัทร	ป้องกันความเสี่ยง	68,519,900.40	0.5692	21 ก.พ. 2568	2,205,995.70
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ธนาคารไทยพาณิชย์	ป้องกันความเสี่ยง	83,103,362.00	(0.2451)	10 ม.ค. 2568	(949,795.00)
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ธนาคารไทยพาณิชย์	ป้องกันความเสี่ยง	11,137,627.00	0.0079	10 ม.ค. 2568	30,481.00
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ธนาคารไทยพาณิชย์	ป้องกันความเสี่ยง	20,722,044.00	0.0683	21 ก.พ. 2568	264,616.93
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ธนาคารไทยพาณิชย์	ป้องกันความเสี่ยง	12,836,020.00	(0.0112)	4 เม.ย. 2568	(43,269.08)
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ช.ทหารไทยชนชาติ	ป้องกันความเสี่ยง	93,468,312.00	(0.8914)	14 มี.ค. 2568	(3,454,797.53)
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ช.ทหารไทยชนชาติ	ป้องกันความเสี่ยง	18,949,332.00	0.0620	4 เม.ย. 2568	240,471.07

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)

กองทุนเปิดกรุงศรีอยุธยาเอสเอ็มอี-มิดแคปอิคิวตีเฮดจ์เอฟเอ็กซ์

ตั้งแต่วันที่ 1 กรกฎาคม 2567 ถึงวันที่ 31 ธันวาคม 2567

ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (Fund's Direct Expenses)	จำนวนเงิน (หน่วย: พันบาท)	ร้อยละของมูลค่า ทรัพย์สิน* (ต่อปี) 1/
ค่าธรรมเนียมการจัดการ (Management Fee)	1,100.93	0.8025
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ (Trustee Fee)	44.04	0.0321
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน (Registrar Fee)	220.19	0.1605
ค่าที่ปรึกษาการลงทุน (Advisory Fee)	-	-
ค่าธรรมเนียมสอบบัญชี (Auditing Fee)	35.29	0.0257
ค่าใช้จ่ายอื่น ๆ (Others)	-	-
รวมค่าใช้จ่ายทั้งหมด 2/	1,400.45	1.0208

หมายเหตุ

1/ ค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวมข้างต้น เป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่มหรือภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว

2/ ไม่รวมค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ และค่าธรรมเนียมต่าง ๆ ที่เกิดขึ้นจากการซื้อขายหลักทรัพย์

* มูลค่าทรัพย์สิน ในที่นี้ หมายถึง มูลค่าทรัพย์สินทั้งหมด หักด้วย มูลค่าหนี้สินทั้งหมด

เว้นแต่ค่าธรรมเนียมการจัดการ ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ ค่าธรรมเนียมนายทะเบียนหน่วยลงทุน

และค่าใช้จ่ายที่เกี่ยวข้องกับการปฏิบัติการกองทุน ณ วันที่คำนวณ

ผลการดำเนินงานของกองทุนเปิดกรุงศรียูเอเอสสมอล-มิดแคปอควิตี้เฮดจ์เอฟเอ็กซ์

ผลการดำเนินงาน สิ้นสุด ณ วันที่ 30 ธันวาคม 2567	% 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 (30 มิถุนายน 2560)
KF-HSMUS	+3.45%	-0.68%	+2.64%	+3.45%	-2.52%	+2.64%	N/A	+3.78%
ดัชนีชี้วัด (Benchmark)*	+9.47%	-0.45%	+6.73%	+9.47%	+1.87%	+6.55%	N/A	+7.07%
ความผันผวนของผลการดำเนินงาน	+15.11%	+15.50%	+16.91%	+15.11%	+18.41%	+21.40%	N/A	+18.75%
ความผันผวนของดัชนีชี้วัด	+15.31%	+16.09%	+17.15%	+15.31%	+18.99%	+21.93%	N/A	+19.27%

หมายเหตุ : * ดัชนีชี้วัด (Benchmark) คือ

ผลการดำเนินงานของกองทุนหลัก สัดส่วน 100.00% ปรับด้วยต้นทุนการป้องกันความเสี่ยงด้านอัตราแลกเปลี่ยน เพื่อเทียบกับค่าสกุลเงินบาท ณ วันที่คำนวณผลตอบแทน

** ผลตอบแทนที่มีอายุเกินหนึ่งปีจะแสดงเป็นผลตอบแทนต่อปี

เอกสารการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวมฉบับนี้ ได้จัดทำตามมาตรฐานการวัดผลดำเนินงานของ
กองทุนรวมของสมาคมบริษัทจัดการลงทุน

ข้อมูลอื่นๆ ที่ผู้ถือหน่วยลงทุนควรทราบ

(1) รายงานบุคคลที่เกี่ยวข้องที่มีการทำธุรกรรมในรอบเวลาที่ผ่านมา (วันที่ 1 กรกฎาคม 2567 ถึงวันที่ 31 ธันวาคม 2567)

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 2567

1. นายชลิต โชคติพิพัฒน์
2. นายสาธิต บัวชู
3. นางสาวสาวิณี สุขศรีวงศ์
4. นายปีติ ประดิพัทธ์พงษ์
5. นายกวิพ เจริญเสาวภาคย์
6. นายเอกชัย บุญยะพงศ์ไชย
7. นายจาตุรงค์ สอนไ
8. นายชูศักดิ์ อวยพรชัยสกุล
9. นายพงศ์สัมพันธ์ อนุรัตน์
10. นางสาววรรดา ตันติสุนทร
11. นายวัชรินทร์ ค้วงสังข์

(3) การเปิดเผยข้อมูลการถือหน่วยลงทุนเกิน 1 ใน 3 ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2567

ไม่มีการถือหน่วยลงทุนเกิน 1 ใน 3 ของบุคคลใดบุคคลหนึ่ง

ผู้ถือหน่วยลงทุนสามารถตรวจสอบข้อมูลสัดส่วนการถือหน่วยลงทุนโดยตรงได้ที่ www.krungsriasset.com

(4) อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุนของกองทุน (portfolio turnover ratio) ในรอบระยะเวลาที่ผ่านมา 1.51 เท่า

(5) ข้อมูลการลงทุน และผลการดำเนินงานของกองทุนหลัก (ข้อมูล ณ วันที่ 31/12/2024)

Performance (%)	1 month	3 months	6 months	YTD	1 year	3 years	5 years	10 years
Fund (bid to bid)	-5.7	0.3	7.5	10.3	10.3	7.0	38.7	114.0
Fund (offer to bid)	-5.7	0.3	7.5	10.3	10.3	7.0	38.7	114.0
Target	-7.4	0.6	9.5	11.1	11.1	6.7	50.8	123.7
Comparator 1	-6.7	-0.3	7.0	10.3	10.3	3.9	51.8	125.9
Comparator 2	-7.2	0.2	7.2	13.0	13.0	13.0	58.9	136.1

Annualized performance (%)	3 years	5 years	10 years
Fund (bid to bid)	2.3	6.8	7.9
Fund (offer to bid)	2.3	6.8	7.9
Target	2.2	8.6	8.4
Comparator 1	1.3	8.7	8.5
Comparator 2	4.2	9.7	9.0

Top 10 holdings (%)

Holding name	%
Kemper Corp	2.3
Rentokil Initial PLC	2.1
Aramark	2.0
Assurant Inc	1.9
Masimo Corp	1.8
Lumentum Holdings Inc	1.8
Dolby Laboratories Inc	1.7
Viavi Solutions Inc	1.7
Hexcel Corp	1.6
Match Group Inc	1.6

Asset allocation

Sector (%)

