



krungsri

Asset  
Management

Make Life  
Simple

A member of  MUFJ  
a global financial group

# รายงานประจำครึ่งปีแรก 2566

รอบระยะเวลาตั้งแต่วันที่ 28 มิถุนายน 2566 – 30 พฤศจิกายน 2566

กองทุนรวม

KFCSI300

กองทุนเปิดกรุงศรีชีน่าอิกวิตี CSI 300

Krungsri China Equity CSI 300 Fund

กองทุนนี้มีการแบ่งชนิดหน่วยลงทุนเป็น 3 ชนิด ได้แก่

1. หน่วยลงทุนชนิดสะสมมูลค่า :

กองทุนเปิดกรุงศรีชีน่าอิกวิตี CSI 300-สะสมมูลค่า (ชื่อย่อ: KFCSI300-A)

2. หน่วยลงทุนชนิดผู้ลงทุนสถาบัน :

กองทุนเปิดกรุงศรีชีน่าอิกวิตี CSI 300-ผู้ลงทุนสถาบัน (KFCSI300-I)

3. หน่วยลงทุนชนิดจ่ายเงินปันผล :

กองทุนเปิดกรุงศรีชีน่าอิกวิตี CSI 300-ปันผล (ชื่อย่อ: KFCSI300-D)  
(บริษัทจัดการยังไม่เปิดขายหน่วยลงทุนชนิดนี้)

**Krungsri Asset Management Co., Ltd.**

1<sup>st</sup>-2<sup>nd</sup> Zone A, 12<sup>th</sup>, 18<sup>th</sup> 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

### กองทุนเปิดกรุงศรีชีนาอัครวิทย์ CSI 300

- สารบัญผู้จัดการ 3
- รายงานผู้ดูแลผลประโยชน์ 4
- งบแสดงฐานะการเงิน งบกำไรขาดทุนเบ็ดเสร็จ และงบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน 5
- รายละเอียดเงินลงทุน การกู้ยืมเงิน และการก่อภาระผูกพันของกองทุนรวม 8
- ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม 11
- คำนายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ 12
- ผลการดำเนินงาน 13
- ข้อมูลอื่นๆ ที่ผู้ถือหน่วยลงทุนควรทราบ 15
  - รายงานบุคคลที่เกี่ยวข้องที่มีการทำธุรกรรมในรอบเวลาที่ผ่านมา
  - รายชื่อผู้จัดการกองทุน
  - การเปิดเผยข้อมูลการถือหน่วยลงทุนเกิน 1 ใน 3
  - อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุนของกองทุน
  - ข้อมูลการลงทุน และผลการดำเนินงานของกองทุนหลัก

## สารบริษัทจัดการ

เรียน ผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุน

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด (บริษัทฯ) ขอนำเสนอรายงานสำหรับรอบระยะเวลา 6 เดือน ของกองทุนเปิดกรุงศรี ไซน่าอิควิตี้ CSI 300 (KFCSI300) ตั้งแต่วันที่ 28 มิถุนายน 2566 ถึงวันที่ 30 พฤศจิกายน 2566 มายังผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุน โดยมีรายละเอียดดังนี้

### ผลการดำเนินงาน

กองทุนเปิดกรุงศรีไซน่าอิควิตี้ CSI 300 มีมูลค่าทรัพย์สินสุทธิ ณ วันที่ 30 พฤศจิกายน 2566 ซึ่งแบ่งตามชนิดหน่วยลงทุน ดังนี้

- KFCSI300-A จำนวน 97.14 ล้านบาท คิดเป็นมูลค่าทรัพย์สินสุทธิต่อหน่วยลงทุน 8.9554 บาท
- KFCSI300-I จำนวน 14.05 ล้านบาท คิดเป็นมูลค่าทรัพย์สินสุทธิต่อหน่วยลงทุน 8.9552 บาท

และมีผลการดำเนินงานตั้งแต่จัดตั้งกองทุน โดยแบ่งตามชนิดหน่วยลงทุน ได้แก่

- KFCSI300-A ลดลงร้อยละ 10.45 ลดลงมากกว่าเกณฑ์มาตรฐานการวัดผลการดำเนินงาน ที่ลดลงร้อยละ 7.64
- KFCSI300-I ลดลงร้อยละ 10.45 ลดลงมากกว่าเกณฑ์มาตรฐานการวัดผลการดำเนินงาน ที่ลดลงร้อยละ 7.64

### ภาวะการลงทุนในช่วงที่ผ่านมา

ในรอบครึ่งปีบัญชีที่ผ่านมา ChinaAMC CSI 300 Index ETF (กองทุนหลัก) ปรับตัวลดลงประมาณ 8.6% โดยตลาดหุ้นจีนปรับตัวลงต่อเนื่องจากภาพเศรษฐกิจที่ยังส่งสัญญาณชะลอตัว โดยเฉพาะในภาคการผลิตและภาคอสังหาริมทรัพย์ นอกจากนี้ การบริโภคของจีนกลับฟื้นตัวได้ช้ากว่าที่หลายฝ่ายคาด เนื่องจากความกังวลต่อเศรษฐกิจจีนที่ชะลอตัวส่งผลให้ผู้บริโภคไม่กล้าที่จะใช้จ่าย ประกอบกับการชะลอตัวในราคาบ้านและสภาพคล่องในกลุ่มอสังหาริมทรัพย์เองก็เป็นอีกปัจจัยกดดันตลาดหุ้นจีน อย่างไรก็ตาม รัฐบาลจีนกลับมาให้ความสำคัญกับการเติบโตของเศรษฐกิจมากขึ้น โดยทางธนาคารกลางจีน (PBOC) เดินหน้าลดอัตราดอกเบี้ยนโยบายลง และออกมาตรการผ่อนคลายในการซื้อบ้านและนโยบายเพิ่มสภาพคล่องในตลาดอสังหาริมทรัพย์ ด้าน Valuations ของตลาดหุ้นจีนยังคงอยู่ในระดับที่น่าสนใจหลังปรับตัวลดลงมาอย่างต่อเนื่อง โดยระดับราคาของตลาดหุ้นจีนในปัจจุบันต่ำกว่าช่วงที่เกิด COVID-19 โดยตลาดหุ้นจีนจะยังคงมีความผันผวน โดยต้องระวังความเสี่ยงจากความไม่แน่นอนด้านการเมืองระหว่างประเทศที่จะยังคงกดดันตลาดหุ้นอยู่เป็นระยะ อีกทั้ง ภาพเศรษฐกิจที่ชะลอตัว โดยหากเราเห็นตัวเลขเศรษฐกิจจีนที่ฟื้นตัว และการใช้จ่ายของผู้บริโภคกลับมาอาจเป็นแรงส่งให้กับตลาดหุ้นได้

ณ สิ้นเดือนตุลาคม 2566 กองทุนหลักมีสัดส่วนการลงทุนในหมวดการเงิน 19.9% หมวด Information Technology 14.6% หมวดอุตสาหกรรม 14% และหมวดสินค้าจำเป็น 12.4% เป็นต้น

### แนวโน้มการลงทุน

สำหรับแนวโน้มการลงทุน กองทุนหลักยังคงมีมุมมองที่ดีต่อการลงทุนในตลาดหุ้นจีนในระยะยาว โดยเฉพาะหลังจากที่ทางการจีนกลับมาให้ความสำคัญต่อการเติบโตทางเศรษฐกิจ โดยคาดว่าจะเห็นนโยบายกระตุ้นเศรษฐกิจออกมาต่อเนื่อง ประกอบกับการดำเนินนโยบายการเงินที่ยังคงผ่อนคลายของ PBOC อย่างไรก็ตาม การฟื้นตัวของเศรษฐกิจจีนจะยังคงมีความผันผวน โดยต้องจับตามองการฟื้นตัวของบริโภคในประเทศ และภาคอสังหาริมทรัพย์ของจีนที่ยังคงชะลอตัว อีกทั้งต้องระวังความเสี่ยงจากการเมืองระหว่างประเทศโดยเฉพาะความสัมพันธ์ระหว่างสหรัฐฯ และจีนที่กลับมาตึงเครียดอีกครั้ง โดยนักลงทุนยังคงขาดความมั่นใจในตลาดหุ้นทำให้ Sentiment การลงทุนยังไม่กลับมาถึงแม้ว่ารัฐบาลจะเดินหน้าออกนโยบายมาช่วยกระตุ้นเศรษฐกิจอย่างต่อเนื่อง

บริษัทฯ ใคร่ขอขอบพระคุณท่านผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุนที่ได้มอบความไว้วางใจให้บริษัทฯ เป็นผู้บริหารเงินลงทุนของท่าน ทั้งนี้ บริษัทฯ จะพิจารณาดำเนินนโยบายการลงทุนที่เหมาะสมกับสถานการณ์ด้วยความระมัดระวัง และคำนึงถึงผลประโยชน์สูงสุดของผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุนเป็นสำคัญ

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด

### รายงานผู้ดูแลผลประโยชน์

เสนอ ผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุนกองทุนเปิดกรุงศรี ไซน่าอิกวิตี CSI 300

ธนาคารซีทีแบงก์ เอ็น เอ สาขากรุงเทพฯ ในฐานะผู้ดูแลผลประโยชน์ กองทุนเปิดกรุงศรี ไซน่าอิกวิตี CSI 300 อันมีบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด เป็นผู้จัดตั้งและจัดการกองทุน ได้ปฏิบัติหน้าที่ดูแลผลประโยชน์กองทุนรวมดังกล่าว สำหรับรอบระยะเวลาตั้งแต่วันที่ 28 มิถุนายน 2566 ถึงวันที่ 30 พฤศจิกายน 2566 แล้วนั้น

ธนาคารฯ ได้จัดทำรายงานฉบับนี้ขึ้นบนพื้นฐานของแหล่งข้อมูลที่ได้รับ ณ วันที่ในจดหมายนี้โดยเชื่อว่าเชื่อถือได้ แต่ธนาคารไม่รับรองความถูกต้องหรือความสมบูรณ์ของข้อมูลดังกล่าว และขอสงวนสิทธิในความรับผิดชอบต่อความผิดพลาด ความละเอียด (รวมถึงไปถึงความรับผิดชอบต่อบุคคลที่สาม) อย่างชัดเจน ไม่มีการรับประกันว่าเหตุการณ์หรือผลลัพธ์ในอนาคตจะตรงกันกับรายงานดังกล่าว ธนาคารฯ กรรมการ พนักงาน หรือตัวแทนของธนาคารไม่รับประกันใดๆ ต่อการจ่ายคืนเงินลงทุน การกระทำการ หรือการแจกจ่ายกองทุน และไม่รับผิดชอบต่อความเสียหายที่เป็นผลมาจากการกระทำ หรือการละเลยที่เกิดขึ้นอันเกี่ยวข้องกับรายงานฉบับนี้

ธนาคารฯ เห็นว่าบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด ได้ปฏิบัติหน้าที่ในการจัดการโดยถูกต้องตามที่ควรตามวัตถุประสงค์ที่ได้กำหนดไว้ในโครงการจัดการที่ได้รับอนุมัติจากสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ และภายใต้พระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535

ขอแสดงความนับถืออย่างสูง



(คุณปานรดา โกจรรย์ศรี คุณเจดจันทร์ สุนันทพงษ์ศักดิ์)

Citibank N.A.

ผู้ดูแลผลประโยชน์กองทุนรวม

ธนาคารซีทีแบงก์ เอ็น เอ สาขากรุงเทพฯ

20 ธันวาคม 2566 *๑/๒*

กองทุนเปิดกรุงศรี 300 CSI 300

งบแสดงฐานะการเงิน

ณ 30 พฤศจิกายน 2566

	Unaudited (บาท)
สินทรัพย์	
เงินลงทุนตามราคายุติธรรม (ราคาทุน 119,369,225.05 บาท)	108,044,860.35
เงินฝากธนาคาร	11,847,278.05
ลูกหนี้จากสัญญาอนุพันธ์	859,292.10
ลูกหนี้	
จากดอกเบี้ย	3,327.64
จากการขายหน่วยลงทุน	32,835.77
รวมสินทรัพย์	<u>120,787,593.91</u>
หนี้สิน	
เจ้าหนี้จากสัญญาอนุพันธ์	639,492.74
เจ้าหนี้	
จากการรับซื้อคืนหน่วยลงทุน	453,618.40
จากการซื้อเงินลงทุน	8,335,890.48
ค่าธรรมเนียมสับเปลี่ยนหน่วยลงทุน	51,202.51
ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย	113,644.00
ภาษีเงินได้ค้างจ่าย	499.15
หนี้สินอื่น	2,665.40
รวมหนี้สิน	<u>9,597,012.68</u>
สินทรัพย์สุทธิ	<u>111,190,581.23</u>
สินทรัพย์สุทธิ:	
หน่วยลงทุนจดทะเบียน 10,000 ล้านหน่วย มูลค่าที่ตราไว้หน่วยละ 10 บาท	
ทุนที่ได้รับจากผู้ถือหน่วยลงทุน	124,160,000.32
กำไรสะสม	(15,128,239.91)
บัญชีปรับสมดุล	2,158,820.82
สินทรัพย์สุทธิ	<u>111,190,581.23</u>
ชนิดสะสมมูลค่า	
สินทรัพย์สุทธิ	97,141,048.07
หน่วยลงทุนที่ออกจำหน่ายแล้ว ณ วันสิ้นปี (หน่วย)	10,847,146.9805
สินทรัพย์สุทธิต่อหน่วย	8.9554
ชนิดผู้ลงทุนสถาบัน	
สินทรัพย์สุทธิ	14,049,533.16
หน่วยลงทุนที่ออกจำหน่ายแล้ว ณ วันสิ้นปี (หน่วย)	1,568,853.0512
สินทรัพย์สุทธิต่อหน่วย	8.9552

กองทุนเปิดกรุงศรีชีนาอิกวิตี CSI 300  
งบกำไรขาดทุนเบ็ดเสร็จ  
สำหรับงวดบัญชีสิ้นสุดวันที่ 30 พฤศจิกายน 2566

	Unaudited (บาท)
รายได้จากการลงทุน	
รายได้ดอกเบี้ย	4,375.06
รายได้เงินปันผล	1,789,432.53
รวมรายได้	1,793,807.59
ค่าใช้จ่าย	
ค่าธรรมเนียมการจัดการ	457,272.44
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์	18,290.85
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน	91,454.47
ค่าธรรมเนียมวิชาชีพ	27,610.44
ค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์	220,385.72
รวมค่าใช้จ่าย	815,013.92
รายได้จากการลงทุนสุทธิ	978,793.67
รายการกำไร (ขาดทุน) สุทธิจากเงินลงทุน	
รายการกำไร (ขาดทุน) สุทธิที่เกิดขึ้นจากเงินลงทุน	(4,407,895.91)
รายการกำไร (ขาดทุน) สุทธิที่ยังไม่เกิดขึ้นจากเงินลงทุน	(11,324,364.70)
รายการกำไร (ขาดทุน) สุทธิที่ยังไม่เกิดขึ้นจากสัญญาอนุพันธ์	219,799.36
รายการกำไร (ขาดทุน) สุทธิจากอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ	(593,916.07)
รวมรายการกำไร (ขาดทุน) สุทธิจากเงินลงทุนที่เกิดขึ้นและยังไม่มีเกิดขึ้น	(16,106,377.32)
หัก ภาษีเงินได้	(656.26)
การเพิ่มขึ้นในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงานหลังหักภาษีเงินได้	(15,128,239.91)
การเพิ่มขึ้นในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงานแยกตามชนิดหน่วยลงทุน มีดังนี้	
ชนิดสะสมมูลค่า	(13,057,309.63)
ชนิดผู้ลงทุนสถาบัน	(2,070,930.28)
รวม	(15,128,239.91)

กองทุนเปิดกรุงศรี ไลน์เอควิตี้ CSI 300

งบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน

ณ 30 พฤศจิกายน 2566

การแสดงรายละเอียดเงินลงทุนใช้การจัดกลุ่มตามประเภทของเงินลงทุนและประเภทของอุตสาหกรรม

ประเภทเงินลงทุน/ผู้ออกตราสาร/ผู้ออกหลักทรัพย์	หมายเลขตราสาร	อัตรา		เงินต้น (บาท) / จำนวนหุ้น	มูลค่ายุติธรรม (บาท)	Unaudited ร้อยละของ มูลค่าเงิน ลงทุน
		ดอกเบี้ย (%)	วันครบอายุ			
หลักทรัพย์ต่างประเทศ						
หน่วยลงทุน						100.00
ChinaAMC CSI 300 Index ETF	HK0000110269			119,369,225.05	108,044,860.35	100.00
จำนวน 611,000.000000 หน่วย						
มูลค่าหน่วยละ 35.8600 CNH						
รวมเป็นเงิน 21,910,460.00 CNH						
					108,044,860.35	100.00

## กองทุนเปิดกรุงศรีชีชน่าอควิตี้ CSI 300

รายละเอียดการลงทุน ณ 30 พฤศจิกายน 2566

	มูลค่าตามราคาตลาด	% NAV
<b>หลักทรัพย์หรือทรัพย์สินในประเทศ</b>	<b>11,850,605.69</b>	<b>10.66</b>
เงินฝากธนาคาร		
S&P		
Rate A-	11,850,605.69	10.66
<b>หลักทรัพย์หรือทรัพย์สินต่างประเทศ</b>	<b>108,044,860.35</b>	<b>97.17</b>
หน่วยลงทุน		
จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์	108,044,860.35	97.17
<b>สัญญาซื้อขายล่วงหน้า</b>	<b>219,799.36</b>	<b>0.19</b>
สัญญาที่อ้างอิงกับอัตราแลกเปลี่ยน-สัญญาแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ		
TRIS		
Rate A+	414,617.49	0.37
Rate A	(98,950.20)	(0.09)
FITCH-LONG		
Rate AA	(100,180.29)	(0.09)
Rate AA-	4,312.36	0.00
<b>อื่นๆ</b>	<b>(8,924,684.17)</b>	<b>(8.02)</b>
ลูกหนี้	32,835.77	0.03
เจ้าหนี้	(8,843,875.94)	(7.95)
ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย	(113,644.00)	(0.10)
<b>มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ</b>	<b>111,190,581.23</b>	<b>100.00</b>



# กองทุนเปิดกรุงศรีฯ ไซน่าอิกวิตี CSI 300

รายละเอียดการลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ณ 30 พฤศจิกายน 2566

ประเภทสัญญา	คู่สัญญา	วัตถุประสงค์	มูลค่าสัญญา (Notional Amount)	% NAV	วันครบ กำหนด	กำไร/ขาดทุน (net gain/loss)
<b>สัญญาที่อ้างอิงกับอัตราแลกเปลี่ยน</b>						
สัญญาฟอว์เวิร์ด	บมจ.ธ.กรุงศรีอยุธยา	ป้องกันความเสี่ยง	2,567,240.00	0.0039	12 ม.ค. 2567	4,312.36
สัญญาฟอว์เวิร์ด	บมจ.ธ.เกียรตินาคิน	ป้องกันความเสี่ยง	3,597,215.00	(0.0879)	12 ม.ค. 2567	(97,767.00)
สัญญาฟอว์เวิร์ด	บมจ.ธ.เกียรตินาคิน	ป้องกันความเสี่ยง	4,860,980.00	(0.0011)	12 ม.ค. 2567	(1,183.20)
สัญญาฟอว์เวิร์ด	บมจ.ธนาคารไทยพาณิชย์	ป้องกันความเสี่ยง	3,399,309.60	(0.0901)	12 ม.ค. 2567	(100,180.29)
สัญญาฟอว์เวิร์ด	บมจ.ธ.ทหารไทยธนชาติ	ป้องกันความเสี่ยง	8,254,411.34	0.0733	1 ธ.ค. 2566	81,479.14
สัญญาฟอว์เวิร์ด	บมจ.ธ.ทหารไทยธนชาติ	ป้องกันความเสี่ยง	48,838,365.10	0.2302	21 ธ.ค. 2566	255,961.23
สัญญาฟอว์เวิร์ด	บมจ.ธ.ทหารไทยธนชาติ	ป้องกันความเสี่ยง	12,423,220.00	(0.3477)	12 ม.ค. 2567	(386,640.24)
สัญญาฟอว์เวิร์ด	บมจ.ธ.ทหารไทยธนชาติ	ป้องกันความเสี่ยง	5,655,485.00	0.1310	12 ม.ค. 2567	145,671.41
สัญญาฟอว์เวิร์ด	บมจ.ธ.ทหารไทยธนชาติ	ป้องกันความเสี่ยง	5,098,688.00	0.1309	12 ม.ค. 2567	145,517.96
สัญญาฟอว์เวิร์ด	บมจ.ธ.ทหารไทยธนชาติ	ป้องกันความเสี่ยง	49,514,000.00	0.2036	12 ม.ค. 2567	226,350.00
สัญญาฟอว์เวิร์ด	บมจ.ธ.ทหารไทยธนชาติ	ป้องกันความเสี่ยง	5,443,290.00	(0.0483)	20 ก.พ. 2567	(53,722.01)

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)

กองทุนเปิดกรุงศรีไฮน่าอควิตี้ CSI 300

ตั้งแต่วันที่ 28 มิถุนายน 2566 ถึงวันที่ 30 พฤศจิกายน 2566

ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (Fund's Direct Expenses)	จำนวนเงิน หน่วย: พันบาท	ร้อยละของมูลค่า ทรัพย์สิน* (ต่อปี) 1/
ค่าธรรมเนียมการจัดการ (Management Fee)	457.27	0.8025
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ (Trustee Fee)	18.29	0.0321
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน (Registrar Fee)	91.45	0.1605
ค่าที่ปรึกษาการลงทุน (Advisory Fee)	-	-
ค่าธรรมเนียมสอบบัญชี (Auditing Fee)	27.61	0.0485
ค่าใช้จ่ายอื่น ๆ (Others)	-	-
<b>รวมค่าใช้จ่ายทั้งหมด 2/</b>	<b>594.62</b>	<b>1.0436</b>

หมายเหตุ

1/ ค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวมข้างต้น เป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่มหรือภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว

2/ ไม่รวมค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ และค่าธรรมเนียมต่าง ๆ ที่เกิดขึ้นจากการซื้อขายหลักทรัพย์

\* มูลค่าทรัพย์สิน ในที่นี้ หมายถึง มูลค่าทรัพย์สินทั้งหมด หักด้วย มูลค่าหนี้สินทั้งหมด

เว้นแต่ค่าธรรมเนียมการจัดการ ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ ค่าธรรมเนียมนายทะเบียนหน่วยลงทุน

และค่าใช้จ่ายที่เกี่ยวข้องกับการปฏิบัติการกองทุน ณ วันที่คำนวณ

**ค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์**  
**กองทุนเปิดกรุงศรีชีนาอิกวิตี CSI 300 / Krungsri China Equity CSI 300 Fund**  
**ตั้งแต่วันที่ 28 มิถุนายน 2566 ถึงวันที่ 30 พฤศจิกายน 2566**

บริษัท	จำนวนเงิน (CNH)	อัตราส่วน (%)
UOB Kay Hian Pte Ltd	75,848.18	100.00
<b>รวม / Total</b>	<b>75,848.18</b>	<b>100.00</b>

ผลการดำเนินงานของกองทุนเปิดกรุงศรีไฮน่าอควิตี้ CSI 300-สะสมมูลค่า

ผลการดำเนินงาน สิ้นสุด ณ วันที่ 30 พฤศจิกายน 2566	% ตามช่วงเวลา			% ต่อปี				นับจากวันเริ่ม โครงการ (28 มิถุนายน 2566)
	Year to Date	ย้อนหลัง 3 เดือน	ย้อนหลัง 6 เดือน	ย้อนหลัง 1 ปี	ย้อนหลัง 3 ปี	ย้อนหลัง 5 ปี	ย้อนหลัง 10 ปี	
KFCSI300-A	N/A	-8.48%	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	-10.45%
ดัชนีชี้วัด (Benchmark)*	N/A	-5.40%	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	-7.64%
ความผันผวนของผลการดำเนินงาน	N/A	+15.46%	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	+19.21%
ความผันผวนของดัชนีชี้วัด	N/A	+17.04%	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	+21.14%

หมายเหตุ : \* ดัชนีชี้วัด (Benchmark) คือ

ผลการดำเนินงานของกองทุนหลัก สัดส่วน 100.00% ปรับด้วยอัตราแลกเปลี่ยนเพื่อเทียบเท่ากับค่าสกุลเงินบาท ณ วันที่คำนวณผลตอบแทน

\*\* ผลตอบแทนที่มีอายุเกินหนึ่งปีจะแสดงผลตอบแทนต่อปี

เอกสารการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวมฉบับนี้ ได้จัดทำตามมาตรฐานการวัดผลดำเนินงานของ  
กองทุนรวมของสมาคมบริษัทจัดการลงทุน

ผลการดำเนินงานของกองทุนเปิดกรุงศรีไฮน่าอัครวิดี CSI 300-ผู้ลงทุนสถาบัน

ผลการดำเนินงาน สิ้นสุด ณ วันที่ 30 พฤศจิกายน 2566	% ตามช่วงเวลา			% ต่อปี				นับจากวันเริ่ม โครงการ (28 มิถุนายน 2566)
	Year to Date	ย้อนหลัง 3 เดือน	ย้อนหลัง 6 เดือน	ย้อนหลัง 1 ปี	ย้อนหลัง 3 ปี	ย้อนหลัง 5 ปี	ย้อนหลัง 10 ปี	
KFCSI300-I	N/A	-8.48%	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	-10.45%
ดัชนีชี้วัด (Benchmark)*	N/A	-5.40%	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	-7.64%
ความผันผวนของผลการดำเนินงาน	N/A	+15.46%	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	+19.21%
ความผันผวนของดัชนีชี้วัด	N/A	+17.04%	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	+21.14%

หมายเหตุ : \* ดัชนีชี้วัด (Benchmark) คือ

ผลการดำเนินงานของกองทุนหลัก สัดส่วน 100.00% ปรับด้วยอัตราแลกเปลี่ยนเพื่อเทียบเท่ากับค่าสกุลเงินบาท ณ วันที่คำนวณผลตอบแทน

\*\* ผลตอบแทนที่มีอายุเกินหนึ่งปีจะแสดงผลตอบแทนต่อปี

เอกสารการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวมฉบับนี้ ได้จัดทำตามมาตรฐานการวัดผลดำเนินงานของ  
กองทุนรวมของสมาคมบริษัทจัดการลงทุน

## ข้อมูลอื่นๆ ที่ผู้ถือหุ้นควรทราบ

(1) รายงานบุคคลที่เกี่ยวข้องที่มีการทำธุรกรรมในรอบเวลาที่ผ่านมา (วันที่ 28 มิถุนายน 2566 ถึงวันที่ 30 พฤศจิกายน 2566)

ชื่อกองทุน	รายชื่อบุคคลที่เกี่ยวข้อง
กองทุนเปิดกรุงศรี ไซน่าอิลลิมิ ซีไอ 300	1. ธนาคารกรุงศรีอยุธยา จำกัด (มหาชน) 2. บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด

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 30 พฤศจิกายน 2566

- นายชาติ โขภทพิพัฒน์
- นายสาธิต บัวชู
- นางสาวสาวิณี สุขศรีวงศ์
- นายปีติ ประดิพัทธ์พงษ์
- นายกวิพ เจริญเสาวภาคย์
- นายเอกชัย บุญยะพงศ์ไชย
- นายจาตุรันต์ สอนไว
- นายชูศักดิ์ อวยพรชัยสกุล
- นายพงศ์สันต์ อนุรัตน์
- นางสาวรรดา ดันดีสุนทร
- นายวัชรินทร์ ค้วงสังข์

(3) การเปิดเผยข้อมูลการถือหุ้นรายละไม่เกิน 1 ใน 3 ณ วันที่ 30 พฤศจิกายน 2566

ไม่มีการถือหุ้นรายละไม่เกิน 1 ใน 3 ของบุคคลใดบุคคลหนึ่ง

ผู้ถือหุ้นรายละไม่เกิน 1 ใน 3 สามารถตรวจสอบข้อมูลสัดส่วนการถือหุ้นรายละไม่เกิน 1 ใน 3 โดยตรงได้ที่ [www.krungsriasset.com](http://www.krungsriasset.com)

(4) อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุนของกองทุน (portfolio turnover ratio) ในรอบระยะเวลาที่ผ่านมา

- KFCSI300-A (portfolio turnover ratio) เท่ากับ 183.99%
- KFCSI300-I (portfolio turnover ratio) เท่ากับ 183.99%

(5) ผลการดำเนินงานและข้อมูลการลงทุนของกองทุนหลัก (ข้อมูล ณ วันที่ 30/11/2023)

▲ Cumulative Return<sup>1</sup>

	1-Month	6-Month	1-Year	3-Year	5-Year	Since Inception <sup>6</sup>
ChinaAMC CSI 300 Index ETF <sup>1</sup>	-2.20%	-6.57%	-7.92%	-27.14%	+15.90%	+65.36%
CSI 300 Index (Total Return) <sup>2</sup>	-2.11%	-5.97%	-6.92%	-24.84%	+22.74%	+85.97%

▲ Yearly Return<sup>1</sup>

	2018	2019	2020	2021	2022	2023YTD
ChinaAMC CSI 300 Index ETF <sup>1</sup>	-24.53%	+37.19%	+28.16%	-4.52%	-20.58%	-8.42%
CSI 300 Index (Total Return) <sup>2</sup>	-23.64%	+39.19%	+29.89%	-3.52%	-19.84%	-7.51%

<sup>1</sup> Past performance information is not indicative of future performance. Investors may not get back the full amount invested. The computation basis of the performance is calculated on NAV-to-NAV, with dividend reinvested. With effective from 8 November 2021, the investment strategy of the Fund was changed. The performance of the Fund prior to 8 November 2021 was achieved under circumstances that no longer apply. Besides, Performance analytics here refer to RMB counter unit.

<sup>2</sup> Based on total return and is denominated in RMB.

<sup>3</sup> Please refer to the Fund's prospectus for further details (including fees).

<sup>4</sup> Total expense ratio is based on expenses for the year ended 31 December 2022, which include management fee, trust fee, etc. It does not represent tracking error.

<sup>5</sup> The latest NAV per Unit is available on the Manager's website at <https://www.chinaamc.com.hk/zh-hant/product/chinaamc-csi-300-index-etf-3188-hk-83188-hk/>.

<sup>6</sup> Calculated since 16 July 2012, the first official NAV date of the fund.

Source: China Asset Management (Hong Kong) Limited and Bloomberg unless specified otherwise.

▲ Top 10 Holdings

Security Name	Weight
CSIN0300	8.95%
Renminbi Money Market Fund	6.25%
Kweichow Moutai Co Ltd	5.94%
Ping An Insurance Group Co of China Ltd	2.33%
Contemporary Amperex Technology Co Ltd	2.33%
China Merchants Bank Co Ltd	1.88%
Wuliangye Yibin Co Ltd	1.53%
Midea Group Co Ltd	1.34%
China Yangtze Power Co Ltd	1.18%
Jiangsu Hengrui Pharmaceuticals Co Ltd	1.13%

▲ Portfolio Allocation

