



krungsri

Asset
Management

Make Life
Simple

A member of  MUFJ
a global financial group

รายงานประจำปีแรก 2566

รอบระยะเวลาตั้งแต่วันที่ 1 พฤษภาคม 2566 – 31 ตุลาคม 2566

กองทุนรวม

KFDIVERSE

กองทุนเปิดกรุงศรีไดเวอร์ซิไฟด์อินคัม

Krungsri Diversified Income Fund

กองทุนนี้มีการแบ่งชนิดหน่วยลงทุนเป็น 2 ชนิด ได้แก่

1. หน่วยลงทุนชนิดสะสมมูลค่า :

กองทุนเปิดกรุงศรีไดเวอร์ซิไฟด์อินคัม-สะสมมูลค่า (KFDIVERS-A)

2. หน่วยลงทุนชนิดรับซื้อคืนหน่วยลงทุนอัตโนมัติ:

กองทุนเปิดกรุงศรีไดเวอร์ซิไฟด์อินคัม-รับซื้อคืนอัตโนมัติ (KFDIVERS-R)

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

กองทุนเปิดกรุงศรีไดเวอร์ซิไฟด์อินแคม

- สารบัญบริหารจัดการ 3
- รายงานผู้ดูแลผลประโยชน์ 4
- งบแสดงฐานะการเงิน งบกำไรขาดทุนเบ็ดเสร็จ และงบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน 6
- รายละเอียดเงินลงทุน การกู้ยืมเงิน และการก่อภาระผูกพันของกองทุนรวม 9
- ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม 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 ของกองทุนเปิดกรุงศรีไคเวอริซีไฟต์อินแคม (KFDIVSE) ตั้งแต่วันที่ 1 พฤษภาคม 2566 ถึงวันที่ 31 ตุลาคม 2566 มายังผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุน โดยมีรายละเอียดดังนี้

ผลการดำเนินงาน

กองทุนเปิดกรุงศรีไคเวอริซีไฟต์อินแคม มีมูลค่าทรัพย์สินสุทธิ ณ วันที่ 31 ตุลาคม 2566 ซึ่งแบ่งตามชนิดหน่วยลงทุน ดังนี้

- KFDIVERS-A จำนวน 324.70 ล้านบาท คิดเป็นมูลค่าทรัพย์สินสุทธิต่อหน่วยลงทุน 8.4997 บาท

- KFDIVERS-R จำนวน 5.87 ล้านบาท คิดเป็นมูลค่าทรัพย์สินสุทธิต่อหน่วยลงทุน 8.4998 บาท

และมีผลการดำเนินงานย้อนหลัง 6 เดือน โดยแบ่งตามชนิดหน่วยลงทุน ได้แก่

- KFDIVERS-A ลดลงร้อยละ 4.28 ลดลงมากกว่าเกณฑ์มาตรฐานการวัดผลการดำเนินงาน ที่ลดลงร้อยละ 2.56

- KFDIVERS-R ลดลงร้อยละ 4.28 ลดลงมากกว่าเกณฑ์มาตรฐานการวัดผลการดำเนินงาน ที่ลดลงร้อยละ 2.56

ภาวะการลงทุนในช่วงที่ผ่านมา

ในรอบครึ่งปีบัญชีที่ผ่านมา ธนาคารกลางสหรัฐฯ (Fed) ปรับอัตราดอกเบี้ยขึ้นสองครั้ง ครั้งละ 0.25% สู่ระดับ 5.25% - 5.50% จากอัตราว่างงานในสหรัฐฯ ที่ลดลงและอัตราเงินเฟ้อที่ยังอยู่ในระดับเกินเป้าหมายระยะยาว ภาวะสงครามระหว่างยูเครนกับรัสเซียในปี 2565 และสงครามระหว่างกลุ่มฮามาสกับอิสราเอล ทำให้ราคาพลังงานเพิ่มสูงขึ้น ทำให้กิจการต่างๆ มีต้นทุนในการดำเนินการเพิ่มขึ้น โดยต้นทุนด้านค่าจ้างแรงงานที่เพิ่มขึ้นแล้วก็ได้มีแนวโน้มปรับตัวลงตามไปด้วย เพราะเศรษฐกิจที่เติบโตอย่างร้อนแรงหลัง COVID-19 ทำให้ยังคงมีความต้องการแรงงานในระดับสูง นี่เป็นสาเหตุหลักให้ตลาดตราสารหนี้ทั่วโลกได้รับผลกระทบเชิงลบด้านราคาจากผลตอบแทนที่เพิ่มสูงขึ้น โดยกองทุนหลักได้รับผลกระทบเชิงลบจากตลาดอสังหาริมทรัพย์ในจีน ตราสารหนี้ High Yield ในภาคการสื่อสาร และ Agency MBS ที่ทำผลตอบแทนได้น้อยกว่าตลาด ปัจจัยบวกในช่วงที่ผ่านมาได้แก่ ตราสารหนี้ระดับลงทุนได้ในภาคธนาคารและอุตสาหกรรมการบิน

กองทุนหลักถือครองตราสารหนี้ High Yield 26% ตราสารหนี้ระดับลงทุนได้ 24% ตราสารหนี้ที่เกิดจากกระบวนการแปลงสินทรัพย์ให้เป็นหลักทรัพย์ 17.7% ภาครัฐของประเทศในตลาดเกิดใหม่ประมาณ 11% โดยมีการลงทุนส่วนใหญ่ในหมวดธนาคารและการเงิน 7.7% หมวดธุรกิจสายสื่อสาร 3.8% และ หมวดอุตสาหกรรมยานยนต์ 3.2%

แนวโน้มการลงทุน

เครดิตสเปรดที่กว้างกว่าหลังช่วง COVID-19 จากความไม่แน่นอนทางเศรษฐกิจ ทำให้กองทุนมีมุมมองระมัดระวังต่อตลาดตราสารหนี้ในภาพรวม การลงทุนบนตราสารหนี้ที่เกิดจากกระบวนการแปลงสินทรัพย์ให้เป็นหลักทรัพย์ เช่น agency และ non-agency MBS ถือเป็นการลงทุนที่เพิ่มความมั่นคงให้แก่กองทุนหลัก บนมุมมองระยะกลางราคาตราสารหนี้ High Yield ในปัจจุบันถือว่าน่าสนใจ โดยตราสารหนี้ในตลาดพัฒนาแล้วมีความน่าสนใจมากกว่าตลาดเกิดใหม่ เนื่องจากต้นทุนทางการเงินที่สูงขึ้นและความเสี่ยงเศรษฐกิจถดถอย บริษัทที่กองทุนหลักให้ความสนใจจึงได้แก่ ภาคธุรกิจที่ผลการดำเนินการอ้างอิงกับวัฏจักรเศรษฐกิจน้อย เช่น กลุ่มสื่อสาร ภาคธนาคาร และธุรกิจที่ได้รับประโยชน์จากราคาสินค้าโภคภัณฑ์ที่เพิ่มขึ้น

บริษัทฯ ใคร่ขอขอบพระคุณท่านผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุนที่ได้มอบความไว้วางใจให้บริษัทฯ เป็นผู้บริหารเงินลงทุนของท่าน ทั้งนี้ บริษัทฯ จะพิจารณาดำเนินนโยบายการลงทุนที่เหมาะสมกับสถานการณ์ด้วยความระมัดระวัง และคำนึงถึงผลประโยชน์สูงสุดของผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุนเป็นสำคัญ

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด



รายงานความเห็นของผู้ดูแลผลประโยชน์

เสนอ ผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุนกองทุนเปิดกรุงศรีไดเวอร์ซิไฟด์อินคัม

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

ธนาคารฯ เห็นว่าบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด ได้ปฏิบัติหน้าที่ในการจัดการกองทุนเปิดกรุงศรีไดเวอร์ซิไฟด์อินคัม โดยถูกต้องตามที่ควรตามวัตถุประสงค์ที่ได้กำหนดไว้ในโครงการจัดการที่ได้รับอนุมัติจากสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ และภายใต้พระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535

ขอแสดงความนับถือ

ธนาคารไทยพาณิชย์ จำกัด (มหาชน)

(นางสาวกรรณจิต อำนุญธรรม)

ผู้จัดการบริการผู้ดูแลผลประโยชน์และบริการบัญชีกองทุน



ความเห็นของผู้ดูแลผลประโยชน์

วันที่ 20 พฤศจิกายน 2566

เรียน ผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุนกองทุนเปิดกรุงศรีไดเวอร์ซิไฟด์อินคัม

ธนาคารกรุงเทพ จำกัด (มหาชน) ในฐานะผู้ดูแลผลประโยชน์ ได้ดูแลการจัดการกองทุนเปิดกรุงศรีไดเวอร์ซิไฟด์อินคัม ซึ่งจัดการโดยบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด สำหรับระยะเวลาตั้งแต่วันที่ 26 กันยายน 2566 ถึงวันที่ 31 ตุลาคม 2566 แล้ว

ธนาคารฯ เห็นว่าบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด ได้ปฏิบัติหน้าที่ในการจัดการกองทุนเปิดกรุงศรีไดเวอร์ซิไฟด์อินคัม เหมาะสมตามสมควรแห่งวัตถุประสงค์ที่ได้กำหนดไว้ในโครงการและภายใต้พระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535

(นาถฤดี ลีโทชาลิต)

ธนาคารกรุงเทพ จำกัด (มหาชน)

ในฐานะผู้ดูแลผลประโยชน์

กองทุนเปิดกรุงศรีไควเวอร์ซิไฟด์อินคัม

งบแสดงฐานะการเงิน

ณ 31 ตุลาคม 2566

	Unaudited (บาท)
สินทรัพย์	
เงินลงทุนตามราคายุติธรรม (ราคาทุน 414,727,030.92 บาท)	337,903,577.00
เงินฝากธนาคาร	974,459.29
ลูกหนี้จากสัญญาอนุพันธ์	643,480.20
ลูกหนี้	
จากดอกเบี้ย	20,941.24
รวมสินทรัพย์	339,542,457.73
หนี้สิน	
เจ้าหนี้จากสัญญาอนุพันธ์	6,943,893.19
เจ้าหนี้	
จากการรับซื้อคืนหน่วยลงทุน	1,649,476.68
ค่าธรรมเนียมสับเปลี่ยนหน่วยลงทุน	804.74
ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย	367,632.73
ภาษีเงินได้ค้างจ่าย	3,141.19
หนี้สินอื่น	8,880.78
รวมหนี้สิน	8,973,829.31
สินทรัพย์สุทธิ	330,568,628.42
สินทรัพย์สุทธิ:	
หน่วยลงทุนจดทะเบียน 300 ล้านหน่วย มูลค่าที่ตราไว้หน่วยละ 10 บาท	
ทุนที่ได้รับจากผู้ถือหน่วยลงทุน	388,914,152.00
กำไรสะสม	(14,721,087.31)
บัญชีปรับสมดุล	(43,624,436.27)
สินทรัพย์สุทธิ	330,568,628.42
ชนิดสะสมมูลค่า	
สินทรัพย์สุทธิ	324,702,129.32
หน่วยลงทุนที่ออกจำหน่ายแล้ว ณ วันสิ้นปี (หน่วย)	38,201,228.4343
สินทรัพย์สุทธิต่อหน่วย	8.4997
ชนิดรับซื้อคืนหน่วยลงทุนอัตโนมัติ	
สินทรัพย์สุทธิ	5,866,499.10
หน่วยลงทุนที่ออกจำหน่ายแล้ว ณ วันสิ้นปี (หน่วย)	690,186.7653
สินทรัพย์สุทธิต่อหน่วย	8.4998

กองทุนเปิดกรุงศรีไดเวอร์ซิไฟด์อินแคม
งบกำไรขาดทุนเบ็ดเสร็จ
สำหรับงวดบัญชีสิ้นสุดวันที่ 31 ตุลาคม 2566

	Unaudited (บาท)
รายได้จากการลงทุน	
รายได้ดอกเบี้ย	29,291.58
รายได้เงินปันผล	8,808,314.78
รวมรายได้	8,837,606.36
ค่าใช้จ่าย	
ค่าธรรมเนียมการจัดการ	1,714,243.32
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์	57,141.40
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน	285,707.24
ค่าธรรมเนียมวิชาชีพ	28,253.46
รวมค่าใช้จ่าย	2,085,345.42
รายได้จากการลงทุนสุทธิ	6,752,260.94
รายการกำไร (ขาดทุน) สุทธิจากเงินลงทุน	
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิที่เกิดขึ้นจากเงินลงทุน	(9,663,996.70)
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิที่ยังไม่เกิดขึ้นจากเงินลงทุน	(10,080,333.48)
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิที่ยังไม่เกิดขึ้นจากสัญญาอนุพันธ์	(9,123,463.18)
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิจากอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ	6,985,912.75
รวมรายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิจากเงินลงทุนที่เกิดขึ้นและยังไม่มีเกิดขึ้น	(21,881,880.61)
หัก ภาษีเงินได้	(4,393.74)
การเพิ่มขึ้นในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงานหลังหักภาษีเงินได้	(15,134,013.41)
การเพิ่มขึ้นในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงานแยกตามชนิดหน่วยลงทุน มีดังนี้	
ชนิดสะสมมูลค่า	(14,868,243.82)
ชนิดรับซื้อคืนหน่วยลงทุนอัตโนมัติ	(265,769.59)
รวม	(15,134,013.41)

กองทุนเปิดกรุงศรีไดเวอร์ซิไฟด์อินคัม

งบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน

ณ 31 ตุลาคม 2566

การแสดงรายละเอียดเงินลงทุนใช้การจัดกลุ่มตามประเภทของเงินลงทุนและประเภทของอุตสาหกรรม

ประเภทเงินลงทุน/ผู้ออกตราสาร/ผู้ออกหลักทรัพย์	หมายเลขตราสาร	อัตรา ดอกเบี้ย (%)	วันครบอายุ	เงินต้น (บาท) / จำนวนหุ้น	มูลค่ายุติธรรม (บาท)	Unaudited ร้อยละของ มูลค่าเงิน ลงทุน
หลักทรัพย์ในประเทศ						
เงินฝากออมทรัพย์						2.99
บมจ.ช.ยู.โอ.บี		1.150000	เมื่อทวงถาม	10,117,897.49	10,117,897.49	2.99
หลักทรัพย์ต่างประเทศ						
หน่วยลงทุน						97.01
PIMCO GIS Diversified Income Fund, Class Institutional - Income (USD)	PIMDIFI			404,609,133.43	327,785,679.51	97.01
จำนวน 744,118.820000 หน่วย						
มูลค่าหน่วยละ 12.2600 USD						
รวมเป็นเงิน 9,122,896.73 USD						
					337,903,577.00	100.00

กองทุนเปิดกรุงศรีไคเวอร์ซิไฟด์อินแคม

รายละเอียดการลงทุน ณ 31 ตุลาคม 2566

	มูลค่าตามราคาตลาด	% NAV
หลักทรัพย์หรือทรัพย์สินในประเทศ	11,113,298.02	3.37
เงินฝากธนาคาร		
FITCH-LONG		
Rate BBB	976,050.06	0.30
FITCH_TH-LONG		
Rate AAA	10,137,247.96	3.07
หลักทรัพย์หรือทรัพย์สินต่างประเทศ	327,785,679.51	99.16
หน่วยลงทุน		
ไม่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์	327,785,679.51	99.16
สัญญาซื้อขายล่วงหน้า	(6,300,412.99)	(1.91)
สัญญาที่อ้างอิงกับอัตราแลกเปลี่ยน-สัญญาแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ		
TRIS		
Rate A+	(125,361.43)	(0.04)
Rate A	643,480.20	0.19
FITCH-LONG		
Rate AA	(2,803,815.42)	(0.85)
Rate AA-	(4,014,716.34)	(1.21)
อื่นๆ	(2,029,936.12)	(0.62)
เจ้าหนี้	(1,662,303.39)	(0.51)
ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย	(367,632.73)	(0.11)
มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ	330,568,628.42	100.00

กองทุนเปิดกรุงศรีไดเวอร์ซิไฟด์อินคัม

รายละเอียดการลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ณ 31 ตุลาคม 2566

ประเภทสัญญา	คู่สัญญา	วัตถุประสงค์	มูลค่าสัญญา (Notional Amount)	% NAV	วันครบกำหนด	กำไร/ขาดทุน (net gain/loss)
สัญญาที่อ้างอิงกับอัตราแลกเปลี่ยน						
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ธ.กรุงศรีอยุธยา	ป้องกันความเสี่ยง	112,710,360.00	(1.2145)	12 ม.ค. 2567	(4,014,716.34)
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ธ.กสิกรไทย	ป้องกันความเสี่ยง	71,565,764.40	(0.8482)	17 พ.ย. 2566	(2,803,815.42)
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ธ.เกียรตินาคิน	ป้องกันความเสี่ยง	128,822,425.00	0.1947	15 มี.ค. 2567	643,480.20
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ธ.ทหารไทยธนชาติ	ป้องกันความเสี่ยง	10,657,170.00	(0.0379)	12 ม.ค. 2567	(125,361.43)

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)

กองทุนเปิดกรุงศรีไดเวอร์ซิไฟด์อินคัม

ตั้งแต่วันที่ 1 พฤษภาคม 2566 ถึงวันที่ 31 ตุลาคม 2566

ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (Fund's Direct Expenses)	จำนวนเงิน (หน่วย: พันบาท)	ร้อยละของมูลค่า ทรัพย์สิน* (ต่อปี) 1/
ค่าธรรมเนียมการจัดการ (Management Fee)	1,714.24	0.9630
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ (Trustee Fee)	57.14	0.0321
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน (Registrar Fee)	285.71	0.1605
ค่าที่ปรึกษาการลงทุน (Advisory Fee)	-	-
ค่าธรรมเนียมสอบบัญชี (Auditing Fee)	28.25	0.0158
ค่าใช้จ่ายอื่น ๆ (Others)	-	-
รวมค่าใช้จ่ายทั้งหมด 2/	2,085.34	1.1714

หมายเหตุ

1/ ค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวมข้างต้น เป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่มหรือภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว

2/ ไม่รวมค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ และค่าธรรมเนียมต่าง ๆ ที่เกิดขึ้นจากการซื้อขายหลักทรัพย์

* มูลค่าทรัพย์สิน ในที่นี้ หมายถึง มูลค่าทรัพย์สินทั้งหมด หักด้วย มูลค่าหนี้สินทั้งหมด

เว้นแต่ค่าธรรมเนียมการจัดการ ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ ค่าธรรมเนียมนายทะเบียนหน่วยลงทุน

และค่าใช้จ่ายที่เกี่ยวข้องกับการปฏิบัติการกองทุน ณ วันที่คำนวณ

ผลการดำเนินงานของกองทุนเปิดกรุงศรีไควเวอร์ซีไฟด์อินคัม-สะสมมูลค่า

ผลการดำเนินงาน สิ้นสุด ณ วันที่ 31 ตุลาคม 2566	% ตามช่วงเวลา			% ต่อปี				นับจากวันเริ่ม โครงการ (28 พฤษภาคม 2563)
	Year to Date	ย้อนหลัง 3 เดือน	ย้อนหลัง 6 เดือน	ย้อนหลัง 1 ปี	ย้อนหลัง 3 ปี	ย้อนหลัง 5 ปี	ย้อนหลัง 10 ปี	
KFDIVERS-A	-3.15%	-4.07%	-4.28%	+0.21%	-6.33%	N/A	N/A	-4.63%
ดัชนีชี้วัด (Benchmark)*	+0.44%	-3.00%	-2.56%	+2.79%	-3.40%	N/A	N/A	-1.65%
ความผันผวนของผลการดำเนินงาน	+5.18%	+5.24%	+4.82%	+5.55%	+5.55%	N/A	N/A	+5.33%
ความผันผวนของดัชนีชี้วัด	+4.82%	+4.94%	+4.52%	+5.17%	+5.04%	N/A	N/A	+4.95%

หมายเหตุ : * ดัชนีชี้วัด (Benchmark) คือ

1. Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets, USD Hedged Index สัดส่วน 33.34%
2. ICE BofAML BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index, USD Hedged Index สัดส่วน 33.33%
3. JPMorgan EMBI Global, USD Hedged Index สัดส่วน 33.33%

บริษัทจัดการจะใช้ตัวชี้วัดตามกองทุนหลักในสกุลเงินเหรียญสหรัฐ ปรับด้วยต้นทุนการป้องกันความเสี่ยงด้านอัตราแลกเปลี่ยน เพื่อเทียบกับค่าสกุลเงินบาท ณ วันที่คำนวณผลตอบแทน

** ผลตอบแทนที่มีอายุเกินหนึ่งปีจะแสดงเป็นผลตอบแทนต่อปี

เอกสารการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวมฉบับนี้ ได้จัดทำตามมาตรฐานการวัดผลดำเนินงานของ
กองทุนรวมของสมาคมบริษัทจัดการลงทุน

ผลการดำเนินงานของกองทุนเปิดกรุงศรีไดเวอร์ซีไฟด์อินคัม-รับซื้อคืนอัตโนมัติ

ผลการดำเนินงาน สิ้นสุด ณ วันที่ 31 ตุลาคม 2566	% ตามช่วงเวลา			% ต่อปี				นับจากวันเริ่ม โครงการ (28 พฤษภาคม 2563)
	Year to Date	ย้อนหลัง 3 เดือน	ย้อนหลัง 6 เดือน	ย้อนหลัง 1 ปี	ย้อนหลัง 3 ปี	ย้อนหลัง 5 ปี	ย้อนหลัง 10 ปี	
KFDIVERS-R	-3.15%	-4.07%	-4.28%	+0.21%	-6.33%	N/A	N/A	-4.63%
ดัชนีชี้วัด (Benchmark)*	+0.44%	-3.00%	-2.56%	+2.79%	-3.40%	N/A	N/A	-1.65%
ความผันผวนของผลการดำเนินงาน	+5.18%	+5.24%	+4.82%	+5.55%	+5.55%	N/A	N/A	+5.33%
ความผันผวนของดัชนีชี้วัด	+4.82%	+4.94%	+4.52%	+5.17%	+5.04%	N/A	N/A	+4.95%

หมายเหตุ : * ดัชนีชี้วัด (Benchmark) คือ

1. Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets, USD Hedged Index สัดส่วน 33.34%
2. ICE BofAML BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index, USD Hedged Index สัดส่วน 33.33%
3. JPMorgan EMBI Global, USD Hedged Index สัดส่วน 33.33%

บริษัทจัดการจะใช้ตัวชี้วัดตามกองทุนหลักในสกุลเงินเหรียญสหรัฐ ปรับด้วยต้นทุนการป้องกันความเสี่ยงด้านอัตราแลกเปลี่ยน เพื่อเทียบกับค่าสกุลเงินบาท ณ วันที่คำนวณผลตอบแทน

** ผลตอบแทนที่มีอายุเกินหนึ่งปีจะแสดงเป็นผลตอบแทนต่อปี

เอกสารการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวมฉบับนี้ ได้จัดทำตามมาตรฐานการวัดผลดำเนินงานของ
กองทุนรวมของสมาคมบริษัทจัดการลงทุน

ข้อมูลอื่นๆ ที่ผู้ถือหน่วยลงทุนควรทราบ

(1) รายงานบุคคลที่เกี่ยวข้องที่มีการทำธุรกรรมในรอบเวลาที่ผ่านมา (วันที่ 1 พฤษภาคม 2566 ถึงวันที่ 31 ตุลาคม 2566)

ชื่อกองทุน	รายชื่อบุคคลที่เกี่ยวข้อง
กองทุนเปิดกรุงศรีไคเวอร์ซิไฟด์อินคัม	1. ธนาคารกรุงศรีอยุธยา จำกัด (มหาชน) 2. บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด

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 ตุลาคม 2566

- นางสาวพรทิพา หนึ่งน้ำใจ
- นายธีรภาพ จิรศักยกุล
- นางสาวรัมภารัจน์ ยุธานัส
- นายเอกพจน์ ภูวิบูลย์พาณิชย์
- นางสาวณัฐยา เจริญวิทยา
- นายจตุรันต์ สอนไฉ
- นายชูศักดิ์ อวยพรชัยสกุล
- นายพงศ์สัมพันธ์ อนุรัตน์
- นางสาววรรดา ดันติสุนทร
- นายวัชรินทร์ คิ้วสังข์

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

ไม่มีการถือหน่วยลงทุนเกิน 1 ใน 3 ของบุคคลใดบุคคลหนึ่ง

ผู้ถือหน่วยลงทุนสามารถตรวจสอบข้อมูลสัดส่วนการถือหน่วยลงทุนโดยตรงได้ที่ www.krungsriasset.com

(4) อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุนของกองทุน (portfolio turnover ratio) ในรอบระยะเวลาที่ผ่านมา เท่ากับ 1.85%

(5) ผลการดำเนินงานของกองทุนหลัก และ ข้อมูลการลงทุน (ข้อมูล ณ วันที่ 31/10/2023)

Performance (Net of Fees)	1 Mo.	3 Mos.	6 Mos.	1 Yr.	3 Yrs.	5 Yrs.	10 Yrs.	SI
Institutional, Acc (%) ¹	-1.21	-3.15	-2.19	5.71	-4.00	0.81	2.52	4.82
Net of 5% Preliminary Charge ²	-6.14	-8.00	-7.10	0.42	-5.63	-0.22	2.00	4.52
Institutional, Inc (%) ¹	-1.21	-3.13	-2.17	5.70	-4.01	0.83	2.53	4.75
Net of 5% Preliminary Charge ²	-6.13	-7.94	-7.08	0.42	-5.64	-0.20	2.01	4.40
Benchmark (%)	-1.01	-3.26	-1.81	5.95	-2.56	1.43	2.67	—

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.

Calendar Year (Net of Fees)	2013	2014	2015	2016	2017	2018	2019	2020	2021	2022	YTD
Institutional, Acc (%) ¹	-0.70	4.02	-0.63	11.98	8.40	-1.26	14.34	7.86	-0.11	-16.30	0.77
Net of 5% Preliminary Charge ²	-5.69	-1.19	-5.61	6.39	2.99	-6.21	8.62	2.48	-5.1	-20.49	-4.28
Institutional, Inc (%) ¹	-0.67	4.00	-0.59	11.98	8.41	-1.31	14.40	7.83	-0.10	-16.28	0.76
Net of 5% Preliminary Charge ²	-5.64	-1.18	-5.55	6.42	3.02	-6.27	8.69	2.42	-5.08	-20.48	-4.24
Benchmark (%)	-0.35	5.48	0.16	9.81	7.29	-2.23	13.68	6.60	0.62	-13.42	1.77

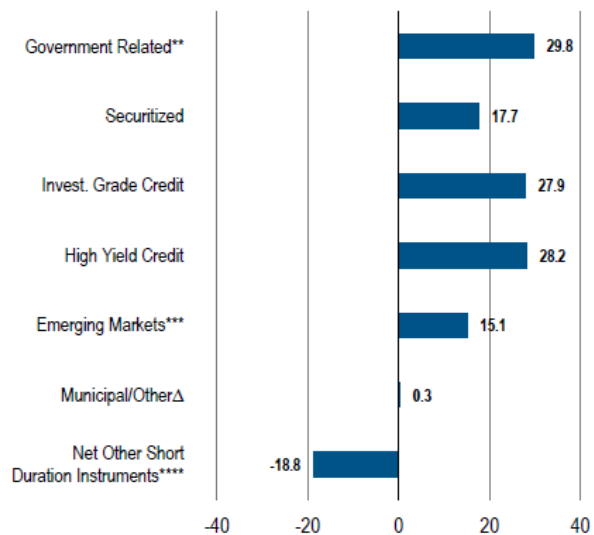
Past performance is not necessarily indicative of future performance. The benchmark is the Inception to November 9, 2015 1/3 each-BBG Global Aggregate Credit Component USD Hdgd; ICE BofAML Global High Yield BB-B Rated Constrained USD Hdgd; JPM EMBI Global, November 10, 2015 onwards 1/3 each - BBG Global Aggregate Credit ex Emerging Markets, USD Hedged; ICE BofAML BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index, USD Hedged; and JPM EMBI Global, USD Hdgd. All periods longer than one year are annualised. SI is the performance since inception. ¹ Performance shown is on a NAV-to-NAV basis in the denominated currency, excluding the preliminary charge and on the assumption that distributions are reinvested, as applicable. ² Performance shown is on a NAV-to-NAV basis in the denominated currency, taking into account the preliminary charge and on the assumption that distributions are reinvested, as applicable. A preliminary charge of up to 5% may or may not be deducted from the subscription amount depending on the distributor from whom you had purchased shares, as such this may not represent actual performance returns. Investment returns denominated in non-local currency may be exposed to exchange rate fluctuations.

Top 10 Holdings (% Market Value)*

FNMA TBA 5.5% AUG 30YR	1.9
U S TREASURY BOND	1.2
FNMA TBA 6.5% AUG 30YR	1.2
FNMA TBA 5.0% AUG 30YR	1.2
UNICREDIT SPA SR UNSEC 144A	1.0
MUNDYS SPA SR UNSEC SMR	0.9
PIMCO ASIA HGH YLD BD-Z ACC	0.9
FNMA TBA 6.0% AUG 30YR	0.8
FNMA TBA 5.0% JUL 30YR	0.7
CREDIT SUISSE AG COCO SUB 144A	0.7

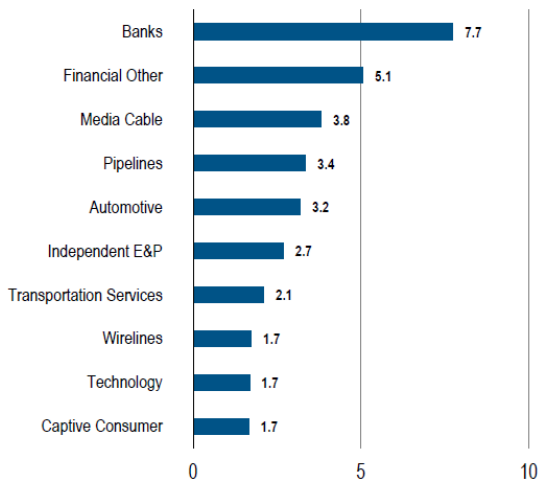
*Top 10 holdings as of 06/30/2023, excluding derivatives.

Sector Allocation (% Market Value)



Market Value % may not equal 100 due to rounding.

pimco.com.sg
Top 10 Industries (% Market Value)



PIMCO
Duration (% Duration Weighted Exposure)

