



krungsri

Asset  
Management

Make Life  
Simple

A member of  MUGF  
a global financial group

# รายงานประจำปี 2566

รอบระยะเวลาตั้งแต่วันที่ 1 ตุลาคม 2565 – 30 กันยายน 2566

กองทุนรวม

KFCORE

กองทุนเปิดกรุงศรีโกลบอลคอร์วอลเคชั่น

Krungsri Global Core Allocation Fund

**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

## รายงานประจำปี 2566

### กองทุนเปิดกรุงศรีโกลบอลคอร์ปอเรชัน

- สารบัญจัดการ 3
- รายงานผู้ดูแลผลประโยชน์ 4
- รายงานของผู้สอบบัญชีและงบการเงิน 5
- รายละเอียดเงินลงทุน การกู้ยืมเงิน และการก่อภาระผูกพันของกองทุนรวม 22
- ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม 25
- คำนายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ 26
- ผลการดำเนินงาน 28
- รายงานสรุปเกี่ยวกับการใช้สิทธิออกเสียงในที่ประชุมผู้ถือหุ้น 29
- ข้อมูลอื่นๆ ที่ผู้ถือหุ้นควรทราบ 30
  - รายงานบุคคลที่เกี่ยวข้องที่มีการทำธุรกรรมในรอบเวลาที่ผ่านมา
  - รายชื่อผู้จัดการกองทุน
  - การเปิดเผยข้อมูลการถือหุ้นของกองทุนเกิน 1 ใน 3
  - อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุนของกองทุน
  - ข้อมูลการลงทุน และผลการดำเนินงานของกองทุนหลัก

## สารบริษัทจัดการ

เรียน ผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุน

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด (บริษัทฯ) ขอนำเสนอรายงานประจำปี ของกองทุนเปิดกรุงศรีโกลบอลคอร์ปอเรชัน (KFCORE) ตั้งแต่วันที่ 1 ตุลาคม 2565 ถึงวันที่ 30 กันยายน 2566 มายังผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุน โดยมีรายละเอียดดังนี้

### ผลการดำเนินงาน

กองทุนเปิดกรุงศรีโกลบอลคอร์ปอเรชัน มีมูลค่าทรัพย์สินสุทธิ ณ วันที่ 30 กันยายน 2566 เท่ากับ 3,415.11 ล้านบาท คิดเป็นมูลค่าทรัพย์สินสุทธิต่อหน่วยลงทุนเท่ากับ 8.6914 บาท โดยมีผลการดำเนินงานย้อนหลัง 12 เดือน ลดลงร้อยละ 3.91

### ภาวะการลงทุนในช่วงที่ผ่านมา

ในรอบปีบัญชีที่ผ่านมา กองทุนปรับตัวลดลง 3.9% จากสภาพตลาดที่มีความผันผวนและซับซ้อนมากขึ้น โดยกองทุนได้เปลี่ยนการลงทุนจากกองทุนรวมหน่วยลงทุน (Fund of Funds) เป็นกองทุนรวม Feeder Fund ที่เน้นลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมต่างประเทศเพียงกองทุนเดียวไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน คือ BGF ESG Multi-Asset Fund (กองทุนหลัก) ในเดือนธันวาคม 2565 โดยกองทุนหลักมีการเพิ่มเครื่องมือในการลงทุนที่หลากหลาย เพื่อสร้างโอกาสรับผลตอบแทนที่ดีในภาวะตลาดที่มีความไม่แน่นอนสูงขึ้น นอกจากนี้ยังให้ความสำคัญและนำนโยบายด้านความยั่งยืน (ESG Policy) มาประกอบการพิจารณาในการลงทุน ทั้งนี้ ในไตรมาสที่ 1 กองทุนได้รับแรงสนับสนุนจากการปรับตัวลดลงของราคาพลังงานในภูมิภาคยุโรป การกลับมาเปิดประเทศของจีน และสัญญาณการปรับตัวลดลงของอัตราเงินเฟ้อ ส่งผลให้นักลงทุนคาดว่าธนาคารกลางจะชะลอหรือยุติการปรับขึ้นอัตราดอกเบี้ย ส่งผลบวกต่อการลงทุนในตลาดหุ้น ตราสารหนี้ และทองคำ อย่างไรก็ตาม ความผันผวนในตลาดปรับตัวสูงขึ้นในไตรมาสที่ 2 จากวิกฤติสภาพคล่องของธนาคารในสหรัฐฯ ความกังวลเรื่องเพดานหนี้สหรัฐฯ และเศรษฐกิจจีนที่ฟื้นตัวไม่เป็นไปตามคาดภายหลังการกลับมาเปิดประเทศ อย่างไรก็ตาม หุ้นกลุ่มเทคโนโลยีขนาดใหญ่ในสหรัฐฯ ปรับตัวได้อย่างแข็งแกร่งกว่าตลาดโดยรวม เนื่องจากความสนใจที่เพิ่มขึ้นเกี่ยวกับศักยภาพของปัญญาประดิษฐ์ที่สามารถสร้างเนื้อหาได้เอง (Generative AI) สำหรับในไตรมาสที่ 3 กองทุนได้รับปัจจัยกดดันมาจากข้อมูลเศรษฐกิจที่อ่อนแอของจีน และ Bond yield สหรัฐฯ ที่ปรับตัวเพิ่มขึ้น หลังจากธนาคารกลางสหรัฐฯ (Fed) มีแนวโน้มขึ้นอัตราดอกเบี้ยอีกครั้งในช่วงปลายปี ส่งผลให้กองทุนได้รับปัจจัยลบจากสัดส่วนการลงทุนในประเทศพัฒนาแล้วและการลงทุนในกลุ่มสินทรัพย์ทางเลือก อย่างไรก็ตาม ผู้จัดการกองทุนยังคงเน้นให้ความสำคัญกับการป้องกันความเสี่ยงขาด และยังคงติดตามปัจจัยเสี่ยงหลักอย่างต่อเนื่อง อาทิเช่น ความตึงเครียดทางภูมิรัฐศาสตร์และการเปลี่ยนแปลงมุมมองต่อแนวโน้มการเติบโตของเศรษฐกิจโลก นอกจากนี้ผู้จัดการกองทุนมีมุมมองเชิงบวกต่อสินทรัพย์ที่มีคุณภาพสูง เนื่องจากความสามารถในการสร้างรายได้สม่ำเสมอ สิ้นเดือนสิงหาคม 2566 กองทุนมีสัดส่วนการลงทุนในหุ้น 57.5% ตราสารหนี้ 40.5% และกลุ่มสินทรัพย์ทางเลือก 5.5%

### แนวโน้มการลงทุน

กองทุนมีกลยุทธ์การลงทุนที่ยืดหยุ่น ปรับพอร์ตรวดเร็ว และกระจายการลงทุนในหลายสินทรัพย์ทั่วโลก โดยมีเป้าหมายเพื่อสร้างผลตอบแทนที่ดี และสม่ำเสมอในทุกภาวะตลาด กองทุนมีแนวโน้มฟื้นตัวต่อเนื่อง โดยได้รับปัจจัยบวกจากการดำเนินนโยบายการเงินที่ผ่อนคลายมากขึ้น หลังจากสหรัฐฯ และยุโรป มีแนวโน้มสิ้นสุดวัฏจักรอัตราดอกเบี้ยขาขึ้น การชะลอตัวของอัตราเงินเฟ้อ และการกลับมาเปิดประเทศของจีน อย่างไรก็ตาม ความเสี่ยงเรื่องเศรษฐกิจหดตัว เป็นปัจจัยเสี่ยงหลักที่จะส่งผลให้ความผันผวนในตลาดปรับตัวสูงขึ้น

บริษัทฯ ใคร่ขอขอบพระคุณท่านผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุนที่ได้มอบความไว้วางใจให้บริษัทฯ เป็นผู้บริหารเงินลงทุนของท่าน ทั้งนี้ บริษัทฯ จะพิจารณาดำเนินนโยบายการลงทุนที่เหมาะสมกับสถานการณ์ด้วยความระมัดระวัง และคำนึงถึงผลประโยชน์สูงสุดของผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุนเป็นสำคัญ

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด

### รายงานผู้ดูแลผลประโยชน์

เสนอ ผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุนกองทุนเปิดกรุงศรี โกลบอลคอร์ปอเรชั่น

ธนาคารซีทีแบงก์ เอ็น เอ สาขากรุงเทพฯ ในฐานะผู้ดูแลผลประโยชน์ กองทุนเปิดกรุงศรี โกลบอลคอร์ปอเรชั่น อันมีบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด เป็นผู้จัดตั้งและจัดการกองทุน ได้ปฏิบัติหน้าที่ดูแลผลประโยชน์กองทุนรวมดังกล่าว สำหรับรอบระยะเวลาตั้งแต่วันที่ 1 ตุลาคม 2565 ถึงวันที่ 30 กันยายน 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



(คุณสุวสี ธรรมวาสิ คุณปานรดา โกจารย์ศรี)

Citibank N.A.

ผู้ดูแลผลประโยชน์กองทุนรวม

ธนาคารซีทีแบงก์ เอ็น เอ สาขากรุงเทพฯ

30 ตุลาคม 2566 NS. PA

กองทุนเปิดกรุงศรี โกลบอลคอรี่ โลเคชั่น  
งบการเงินและรายงานของผู้สอบบัญชีรับอนุญาต  
สำหรับปีสิ้นสุดวันที่ 30 กันยายน 2566

## รายงานของผู้สอบบัญชีรับอนุญาต

เสนอ ผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุนของกองทุนเปิดกรุงศรีโกลบอลคอร์ปอเรชั่น

### ความเห็น

ข้าพเจ้าได้ตรวจสอบงบการเงินของกองทุนเปิดกรุงศรีโกลบอลคอร์ปอเรชั่น (“กองทุน”) ซึ่งประกอบด้วยงบแสดงฐานะการเงินและงบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน ณ วันที่ 30 กันยายน 2566 และงบกำไรขาดทุนเบ็ดเสร็จ และงบแสดงการเปลี่ยนแปลงสินทรัพย์สุทธิสำหรับปีสิ้นสุดวันเดียวกัน และหมายเหตุประกอบงบการเงินรวมถึงสรุปนโยบายการบัญชีที่สำคัญ

ข้าพเจ้าเห็นว่า งบการเงินข้างต้นนี้แสดงฐานะการเงินของกองทุนเปิดกรุงศรีโกลบอลคอร์ปอเรชั่น ณ วันที่ 30 กันยายน 2566 และผลการดำเนินงาน และการเปลี่ยนแปลงสินทรัพย์สุทธิสำหรับปีสิ้นสุดวันเดียวกัน โดยถูกต้องตามที่ควรในสาระสำคัญตามแนวปฏิบัติทางบัญชีสำหรับกองทุนรวมและกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ ที่สมาคมบริษัทจัดการลงทุนกำหนดโดยได้รับความเห็นชอบจากสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

### เกณฑ์ในการแสดงความเห็น

ข้าพเจ้าได้ปฏิบัติตามตรวจสอบตามมาตรฐานการสอบบัญชี ความรับผิดชอบของข้าพเจ้าได้กล่าวไว้ในวรรคความรับผิดชอบของผู้สอบบัญชีต่อการตรวจสอบงบการเงินในรายงานของข้าพเจ้า ข้าพเจ้ามีความเป็นอิสระจากกองทุนตามประมวลจรรยาบรรณของผู้ประกอบวิชาชีพบัญชี รวมถึง มาตรฐานเรื่องความเป็นอิสระ ที่กำหนดโดยสภาวิชาชีพบัญชี (ประมวลจรรยาบรรณของผู้ประกอบวิชาชีพบัญชี) ในส่วนที่เกี่ยวข้องกับการตรวจสอบงบการเงิน และข้าพเจ้าได้ปฏิบัติตามความรับผิดชอบด้านจรรยาบรรณอื่น ๆ ตามประมวลจรรยาบรรณของผู้ประกอบวิชาชีพบัญชี ข้าพเจ้าเชื่อว่าหลักฐานการสอบบัญชีที่ข้าพเจ้าได้รับเพียงพอและเหมาะสมเพื่อใช้เป็นเกณฑ์ในการแสดงความเห็นของข้าพเจ้า

### ข้อมูลอื่น

ผู้บริหารเป็นผู้รับผิดชอบต่อข้อมูลอื่น ข้อมูลอื่นประกอบด้วย ข้อมูลซึ่งรวมอยู่ในรายงานประจำปี แต่ไม่รวมถึงงบการเงินและรายงานของผู้สอบบัญชีที่อยู่ในรายงานประจำปีนั้น ข้าพเจ้าคาดว่าข้าพเจ้าจะได้รับรายงานประจำปีภายหลังวันที่ในรายงานของผู้สอบบัญชี

ความเห็นของข้าพเจ้าต่องบการเงิน ไม่ครอบคลุมถึงข้อมูลอื่น และข้าพเจ้าไม่ได้ให้ความเชื่อมั่นต่อข้อมูลอื่น

ความรับผิดชอบของข้าพเจ้าที่เกี่ยวข้องกับการตรวจสอบงบการเงินคือ การอ่านและพิจารณาว่าข้อมูลอื่นมีความขัดแย้งที่มีสาระสำคัญกับงบการเงินหรือกับความรู้ที่ได้รับจากการตรวจสอบของข้าพเจ้า หรือปรากฏว่าข้อมูลอื่นมีการแสดงข้อมูลที่ขัดต่อข้อเท็จจริงอันเป็นสาระสำคัญหรือไม่

เมื่อข้าพเจ้าได้อ่านรายงานประจำปี หากข้าพเจ้าสรุปได้ว่ามีการแสดงข้อมูลที่ขัดต่อข้อเท็จจริงอันเป็นสาระสำคัญ ข้าพเจ้าต้องสื่อสารเรื่องดังกล่าวกับผู้บริหารเพื่อให้ผู้บริหารดำเนินการแก้ไขข้อมูลที่แสดงขัดต่อข้อเท็จจริง



- สรุปเกี่ยวกับความเหมาะสมของการใช้เกณฑ์การบัญชีสำหรับการดำเนินงานต่อเนื่องของผู้บริหารและจากหลักฐานการสอบบัญชีที่ได้รับ สรุปว่ามีความไม่แน่นอนที่มีสาระสำคัญที่เกี่ยวกับเหตุการณ์หรือสถานการณ์ที่อาจเป็นเหตุให้เกิดข้อสงสัยอย่างมีนัยสำคัญต่อความสามารถของกองทุนในการดำเนินงานต่อเนื่องหรือไม่ ถ้าข้าพเจ้าได้ข้อสรุปว่ามีความไม่แน่นอนที่มีสาระสำคัญ ข้าพเจ้าต้องกล่าวไว้ในรายงานของผู้สอบบัญชีของข้าพเจ้าโดยให้ข้อสังเกตถึงการเปิดเผยข้อมูลในงบการเงินที่เกี่ยวข้อง หรือถ้าการเปิดเผยดังกล่าวไม่เพียงพอ ความเห็นของข้าพเจ้าจะเปลี่ยนแปลงไป ข้อสรุปของข้าพเจ้าขึ้นอยู่กับหลักฐานการสอบบัญชีที่ได้รับจนถึงวันที่ในรายงานของผู้สอบบัญชีของข้าพเจ้า อย่างไรก็ตาม เหตุการณ์หรือสถานการณ์ในอนาคตอาจเป็นเหตุให้กองทุนต้องหยุดการดำเนินงานต่อเนื่อง
- ประเมินการนำเสนอ โครงสร้างและเนื้อหาของงบการเงินโดยรวม รวมถึงการเปิดเผยข้อมูลว่างบการเงินแสดงรายการและเหตุการณ์ในรูปแบบที่ทำให้มีการนำเสนอข้อมูลโดยถูกต้องตามที่ควรหรือไม่

ข้าพเจ้าได้สื่อสารกับผู้บริหารในเรื่องต่าง ๆ ที่สำคัญ ซึ่งรวมถึงขอบเขตและช่วงเวลาของการตรวจสอบตามที่ได้วางแผนไว้ ประเด็นที่มีนัยสำคัญที่พบจากการตรวจสอบรวมถึงข้อบกพร่องที่มีนัยสำคัญในระบบการควบคุมภายในหากข้าพเจ้าได้พบในระหว่างการตรวจสอบของข้าพเจ้า



(นางสาวชมนุช แซ่แต้)

ผู้สอบบัญชีรับอนุญาต เลขทะเบียน 8382

บริษัท พีวี ออดิท จำกัด

กรุงเทพฯ 6 พฤศจิกายน 2566



กองทุนเปิดกรุงศรีโกลบอลคอร์ปอเรชัน

งบแสดงฐานะการเงิน

ณ วันที่ 30 กันยายน 2566

|  | หมายเหตุ | บาท                     |                         |
|--|----------|-------------------------|-------------------------|
|  |          | 2566                    | 2565                    |
| สินทรัพย์  | 7        |                         |                         |
| เงินลงทุนแสดงด้วยมูลค่ายุติธรรม                          | 3, 4     | 3,539,196,106.24        | 3,695,029,961.94        |
| เงินฝากธนาคาร  |          | 5,083,208.60            | 4,075,056.06            |
| ลูกหนี้  |          |                         |                         |
| จากเงินปันผลและดอกเบี้ย                                  |          | 159,559.12              | 128,678.99              |
| จากการขายเงินลงทุน                                       |          | 71,743,308.69           | -                       |
| จากการขายหน่วยลงทุน                                      |          | 101,970.63              | 4,926.13                |
| ลูกหนี้จากสัญญาอนุพันธ์                                  | 3, 6     | -                       | 47,048,057.06           |
| รายได้อื่นค้างรับ  |          | -                       | 1,179,606.22            |
| ลูกหนี้อื่น  |          | 244,934.93              | 650,880.00              |
| รวมสินทรัพย์   |          | <u>3,616,529,088.21</u> | <u>3,748,117,166.40</u> |
| หนี้สิน  | 7        |                         |                         |
| เจ้าหนี้จากการรับซื้อคืนหน่วยลงทุน                       |          | 30,064,805.45           | 7,335,076.83            |
| เจ้าหนี้จากสัญญาอนุพันธ์                                 | 3, 5, 6  | 168,905,714.80          | 201,822,817.08          |
| ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย                                       | 5        | 2,330,395.87            | 4,702,930.80            |
| ภาษีเงินได้ค้างจ่าย                                      |          | 23,933.86               | 6,729.59                |
| เจ้าหนี้อื่น   | 5        | 28,547.99               | 8,680.11                |
| หนี้สินอื่น  |          | 66,267.28               | 161,732.23              |
| รวมหนี้สิน   |          | <u>201,419,665.25</u>   | <u>214,037,966.64</u>   |
| สินทรัพย์สุทธิ   |          | <u>3,415,109,422.96</u> | <u>3,534,079,199.76</u> |
| สินทรัพย์สุทธิ:  |          |                         |                         |
| ทุนที่ได้รับจากผู้ถือหน่วยลงทุน                          |          | 3,929,277,944.52        | 3,907,326,950.12        |
| กำไร(ขาดทุน)สะสม   |          |                         |                         |
| บัญชีปรับสมดุล   |          | 96,775,371.10           | 95,233,821.97           |
| ขาดทุนสะสมจากการดำเนินงาน                                |          | (610,943,892.66)        | (468,481,572.33)        |
| สินทรัพย์สุทธิ   |          | <u>3,415,109,422.96</u> | <u>3,534,079,199.76</u> |
| สินทรัพย์สุทธิต่อหน่วย                                   |          | 8.6914                  | 9.0447                  |
| จำนวนหน่วยลงทุนที่จำหน่ายแล้วทั้งหมด ณ วันสิ้นปี (หน่วย) |          | 392,927,794.4515        | 390,732,695.0120        |
| หมายเหตุประกอบงบการเงินเป็นส่วนหนึ่งของงบการเงินนี้      |          |                         | 4                       |

กองทุนเปิดกรุงศรีโกลบอลคอร์ปอเรชัน

งบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน

ณ วันที่ 30 กันยายน 2566

การแสดงรายละเอียดเงินลงทุน ใช้การจัดกลุ่มตามประเภทของเงินลงทุน

| ประเภทเงินลงทุน/ผู้ออกตราสาร/ผู้ออกหลักทรัพย์      | หมายเลขตราสาร | อัตรา           |             | เงินต้น (บาท)/<br>จำนวนหน่วย | มูลค่ายุติธรรม<br>(บาท) | ร้อยละ<br>ของมูลค่า<br>เงินลงทุน |
|--|---------------|-----------------|-------------|------------------------------|-------------------------|----------------------------------|
|  |               | ดอกเบี้ย<br>(%) | วันครบอายุ  |                              |                         |                                  |
| <b>เงินฝากออมทรัพย์</b>                            |               |                 |             |                              |                         |                                  |
| บมจ.ท.ทีเอสโก้                                     |               | 0.50            | เมื่อทวงถาม | 4,409.87                     | 4,409.87                | -                                |
| บมจ.ธ.ยูโอบี                                       |               | 1.05            | เมื่อทวงถาม | 55,746,500.09                | 55,746,500.09           | 1.58                             |
| <b>หน่วยลงทุน</b>                                  |               |                 |             |                              |                         |                                  |
| BGF ESG Multi-Asset Fund *                         |               |                 |             |                              |                         |                                  |
| มูลค่าหน่วยละ 9.67 ดอลลาร์สหรัฐอเมริกา             |               |                 |             |                              |                         |                                  |
| รวมเป็นเงิน 95,523,218.15 ดอลลาร์สหรัฐอเมริกา      | LU2349430145  |                 |             | 9,878,305.91                 | 3,483,445,196.28        | 98.42                            |
| <b>รวมเงินลงทุน (ราคาทุน 3,668,763,061.49 บาท)</b> |               |                 |             |                              | <b>3,539,196,106.24</b> | <b>100.00</b>                    |

\* BGF ESG Multi-Asset Fund มีนโยบายการลงทุนในตราสารทุน ตราสารหนี้ที่เปลี่ยนมือได้ หน่วยลงทุนของกองทุนรวม เงินสด เงินฝาก และตราสารตลาดเงินของประเทศต่าง ๆ ทั่วโลก เพื่อให้ได้รับผลตอบแทนสูงสุด ตามหลักการลงทุนที่คำนึงถึงปัจจัยด้านความยั่งยืน ที่มีผลกระทบต่อสิ่งแวดล้อม สังคม และบรรษัทภิบาล

กองทุนเปิดกรุงศรีโกลบอลคอร์ปอเรชัน

งบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน

ณ วันที่ 30 กันยายน 2565

การแสดงรายละเอียดเงินลงทุนใช้การจัดกลุ่มตามประเภทของเงินลงทุน

| ประเภทเงินลงทุน/ผู้ออกตราสาร/ผู้ออกหลักทรัพย์        | อัตรา           |             | เงินต้น/<br>จำนวนหน่วย    | มูลค่าธุรกรรม<br>(บาท)  | ร้อยละ<br>ของมูลค่า<br>เงินลงทุน |
|--|-----------------|-------------|---------------------------|-------------------------|----------------------------------|
|  | ดอกเบี้ย<br>(%) | วันครบอายุ  |                           |                         |                                  |
| <b>เงินฝากออมทรัพย์</b>                              |                 |             |                           |                         |                                  |
| บมจ.ท.ทีสโก้   | 0.15            | เมื่อทวงถาม | 4,398.05                  | 4,398.05                | -                                |
| บมจ.ช.ยูโอบี   | 0.25            | เมื่อทวงถาม | 52,424,031.73             | 52,424,031.73           | 1.42                             |
| ช.ซีทีแบงก์ สาขากรุงเทพฯ                             |                 | เมื่อทวงถาม | 13,775,838.28 ดอลลาร์     | 520,065,446.75          | 14.07                            |
|  |                 |             | สหรัฐอเมริกา              |                         |                                  |
| ช.ซีทีแบงก์ สาขากรุงเทพฯ                             |                 | เมื่อทวงถาม | 251,155.55 ยูโร           | 9,326,209.27            | 0.25                             |
| ช.ซีทีแบงก์ สาขากรุงเทพฯ                             |                 | เมื่อทวงถาม | 224,122.58 ปอนด์สเตอร์ลิง | 9,491,613.68            | 0.26                             |
| <b>หน่วยลงทุน</b>                                    |                 |             |                           |                         |                                  |
| iShares Core DAX UCITS ETF                           |                 |             | 16,905                    | 64,091,921.77           | 1.73                             |
| iShares Core FTSE 100 UCITS ETF                      |                 |             | 85,490                    | 24,278,255.70           | 0.66                             |
| iShares Core S&P 500 UCITS ETF                       |                 |             | 241,212                   | 332,377,592.98          | 9.00                             |
| iShares MSCI Taiwan UCITS ETF                        |                 |             | 22,871                    | 47,358,915.66           | 1.28                             |
| iShares Core UK Gilts UCITS ETF                      |                 |             | 429,050                   | 189,152,931.32          | 5.12                             |
| iShares USD Treasury Bond 7-10yr UCITS ETF           |                 |             | 63,428                    | 330,721,043.52          | 8.95                             |
| iShares Core MSCI Japan IMI UCITS ETF                |                 |             | 14,027                    | 20,424,639.52           | 0.55                             |
| iShares MSCI Canada UCITS ETF                        |                 |             | 24,284                    | 138,184,676.98          | 3.74                             |
| iShares MSCI South Africa UCITS ETF                  |                 |             | 43,711                    | 43,886,475.38           | 1.19                             |
| iShares MSCI Australia UCITS ETF                     |                 |             | 54,358                    | 77,139,311.69           | 2.09                             |
| iShares Germany Govt Bond UCITS ETF                  |                 |             | 54,893                    | 250,136,457.61          | 6.77                             |
| iShares USD Ultrashort Bond UCITS ETF                |                 |             | 79,650                    | 299,266,380.27          | 8.10                             |
| iShares USD Floating Rate Bond UCITS ETF             |                 |             | 1,451,169                 | 291,618,064.42          | 7.89                             |
| iShares USD Treasury Bond 20+yr UCITS ETF            |                 |             | 816,556                   | 147,335,840.31          | 3.99                             |
| BlackRock Advantage US Equity Fund                   |                 |             | 25,232.02                 | 131,991,120.48          | 3.57                             |
| BlackRock Advantage World Equity Fund                |                 |             | 57,323.26                 | 264,851,727.29          | 7.17                             |
| iShares MSCI China A UCITS ETF                       |                 |             | 503,247                   | 86,842,512.69           | 2.35                             |
| iShares EUR Govt Bond 20yr Target Duration UCITS ETF |                 |             | 961,980                   | 142,946,309.47          | 3.87                             |
| iShares USD Corp Bond UCITS ETF                      |                 |             | 1,147,647                 | 221,114,085.40          | 5.98                             |
| <b>รวมเงินลงทุน (ราคาทุน 3,928,378,340.43 บาท)</b>   |                 |             |                           | <b>3,695,029,961.94</b> | <b>100.00</b>                    |

กองทุนเปิดกรุงศรีโกลบอลคอร์ปอเรชัน  
งบกำไรขาดทุนเบ็ดเสร็จ  
สำหรับปีสิ้นสุดวันที่ 30 กันยายน 2566

|   | หมายเหตุ | บาท              |                  |
|---|----------|------------------|------------------|
|   |          | 2566             | 2565             |
| รายได้  | 3        |                  |                  |
| รายได้เงินปันผล   |          | -                | 18,477,024.73    |
| รายได้ดอกเบี้ย  |          | 500,825.72       | 293,147.12       |
| รายได้อื่น  | 8        | 730,237.50       | 6,098,122.06     |
| รวมรายได้   |          | 1,231,063.22     | 24,868,293.91    |
| ค่าใช้จ่าย  | 3        |                  |                  |
| ค่าธรรมเนียมการจัดการ   | 5        | 25,605,308.85    | 55,662,285.00    |
| ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์                                   |          | 1,217,814.81     | 1,781,193.11     |
| ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน  | 5        | 5,771,780.37     | 6,679,474.23     |
| ค่าธรรมเนียมวิชาชีพ   |          | 76,200.00        | 76,200.00        |
| ค่าใช้จ่ายอื่น  |          | 5,358.67         | 285,581.45       |
| รวมค่าใช้จ่าย   |          | 32,676,462.70    | 64,484,733.79    |
| ขาดทุนสุทธิ   |          | (31,445,399.48)  | (39,616,439.88)  |
| รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิจากเงินลงทุน                             | 3        |                  |                  |
| รายการขาดทุนสุทธิที่เกิดขึ้นจากเงินลงทุน                        |          | (81,459,910.95)  | (225,801,684.91) |
| รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิที่ยังไม่เกิดขึ้นจากเงินลงทุน            |          | 103,781,423.24   | (340,890,166.00) |
| รายการขาดทุนสุทธิที่เกิดขึ้นจากสัญญาอนุพันธ์                    |          | (27,229,339.84)  | (315,520,856.51) |
| รายการขาดทุนสุทธิที่ยังไม่เกิดขึ้นจากสัญญาอนุพันธ์              | 6, 7     | (14,130,954.78)  | (7,586,295.22)   |
| รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิจากอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ      |          | (91,903,014.69)  | 342,532,369.74   |
| รวมรายการขาดทุนสุทธิจากเงินลงทุนที่เกิดขึ้นและที่ยังไม่เกิดขึ้น |          | (110,941,797.02) | (547,266,632.90) |
| การลดลงในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงานก่อนภาษีเงินได้           |          | (142,387,196.50) | (586,883,072.78) |
| หัก ภาษีเงินได้   | 3        | (75,123.83)      | (41,499.33)      |
| การลดลงในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงานหลังหักภาษีเงินได้        |          | (142,462,320.33) | (586,924,572.11) |

หมายเหตุประกอบงบการเงินเป็นส่วนหนึ่งของงบการเงินนี้

กองทุนเปิดกรุงศรีโกลบอลคอร์ปอเรชัน  
งบแสดงการเปลี่ยนแปลงสินทรัพย์สุทธิ  
สำหรับปีสิ้นสุดวันที่ 30 กันยายน 2566

|   | บาท              |                  |
|---|------------------|------------------|
|   | 2566             | 2565             |
| การเพิ่มขึ้น(ลดลง)สุทธิของสินทรัพย์สุทธิจาก               |                  |                  |
| การดำเนินงาน  | (142,462,320.33) | (586,924,572.11) |
| การเพิ่มขึ้นของทุนที่ได้รับจากผู้ถือหน่วยลงทุนในระหว่างปี | 369,791,376.26   | 1,078,775,211.13 |
| การลดลงของทุนที่ได้รับจากผู้ถือหน่วยลงทุนในระหว่างปี      | (346,298,832.73) | (799,507,594.53) |
| การลดลงของสินทรัพย์สุทธิในระหว่างปี                       | (118,969,776.80) | (307,656,955.51) |
| สินทรัพย์สุทธิ ณ วันต้นปี                                 | 3,534,079,199.76 | 3,841,736,155.27 |
| สินทรัพย์สุทธิ ณ วันปลายปี                                | 3,415,109,422.96 | 3,534,079,199.76 |

|   | หน่วย             |                   |
|---|-------------------|-------------------|
|   | 2566              | 2565              |
| <u>การเปลี่ยนแปลงของจำนวนหน่วยลงทุน</u>         |                   |                   |
| (มูลค่าหน่วยละ 10 บาท)                          |                   |                   |
| หน่วยลงทุน ณ วันต้นปี                           | 390,732,695.0120  | 367,116,233.7278  |
| <u>บวก</u> : หน่วยลงทุนที่ขายในระหว่างปี        | 40,910,461.1049   | 102,374,578.5053  |
| <u>หัก</u> : หน่วยลงทุนที่รับซื้อคืนในระหว่างปี | (38,715,361.6654) | (78,758,117.2211) |
| หน่วยลงทุน ณ วันปลายปี                          | 392,927,794.4515  | 390,732,695.0120  |

## กองทุนเปิดกรุงศรีโกลบอลคอร์ปอเรชัน

### หมายเหตุประกอบงบการเงิน

สำหรับปีสิ้นสุดวันที่ 30 กันยายน 2566

#### 1. ข้อมูลทั่วไป

กองทุนเปิดกรุงศรีโกลบอลคอร์ปอเรชัน (“กองทุน”) จัดทะเบียนเป็นกองทุนร่วมกับสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ (“ก.ล.ต.”) เมื่อวันที่ 29 ตุลาคม 2563 มีเงินทุนจดทะเบียนจำนวน 50,000 ล้านบาท (แบ่งเป็น 5,000 ล้านหน่วยลงทุน มูลค่าหน่วยลงทุนละ 10 บาท) โดยมีบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด (“บริษัทจัดการ”) เป็นผู้จัดการกองทุนและนายทะเบียนหน่วยลงทุน และธนาคารซีทีแบงก์ สาขากรุงเทพฯ เป็นผู้ดูแลผลประโยชน์

กองทุนเป็นกองทุนรวมหน่วยลงทุน ประเภทรับซื้อคืนหน่วยลงทุน ที่ไม่กำหนดระยะเวลาสิ้นสุดของโครงการ โดยจะลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมในต่างประเทศ ชื่อ BGF ESG Multi-Asset Fund, Class I2 Hedged USD ซึ่งจดทะเบียนในประเทศลักเซมเบิร์ก บริหารและจัดการโดย BlackRock (Luxembourg) S.A. โดยเฉลี่ยในรอบปีไม่ต่ำกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน (เดิมมีนโยบายการลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมต่างประเทศและ/หรือกองทุนรวมอิตาลีต่างประเทศ ทั้งนี้จะลงทุนอย่างน้อย 2 กองทุน โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน) ทั้งนี้กองทุนอาจเข้าทำสัญญาอนุพันธ์ (Derivatives) โดยมีวัตถุประสงค์เพื่อป้องกันความเสี่ยง (Hedging) จากอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ

กองทุนมีนโยบายไม่จ่ายเงินปันผลแก่ผู้ถือหน่วยลงทุน

#### 2. เกณฑ์การจัดทำงบการเงิน

งบการเงินนี้ได้จัดทำขึ้นตามแนวปฏิบัติทางบัญชีสำหรับกองทุนรวมและกองทุนสำรองเลี้ยงชีพที่สมาคมบริษัทจัดการลงทุนกำหนด โดยได้รับความเห็นชอบจาก ก.ล.ต. (“แนวปฏิบัติทางบัญชี”) ส่วนเรื่องที่ไม่ปฏิบัติตามบัญชีไม่ได้กำหนดไว้ กองทุนปฏิบัติตามมาตรฐานการรายงานทางการเงินที่ออกโดยสภาวิชาชีพบัญชี

#### 3. สรุปนโยบายการบัญชีที่สำคัญ

##### เงินลงทุน

เงินลงทุนจะรับรู้เป็นสินทรัพย์ด้วยมูลค่ายุติธรรม ณ วันที่กองทุนมีสิทธิในเงินลงทุน

- เงินลงทุนในกองทุนรวมที่เสนอขายในต่างประเทศ แสดงด้วยมูลค่ายุติธรรม โดยใช้ราคาซื้อขายครั้งล่าสุด หรือมูลค่าทรัพย์สินสุทธิต่อหน่วยลงทุนครั้งล่าสุด ณ วันที่วัดค่าเงินลงทุน

กำไรหรือขาดทุนสุทธิที่ยังไม่เกิดขึ้นจากการปรับมูลค่าของเงินลงทุนให้เป็นมูลค่ายุติธรรมจะรับรู้ในกำไรหรือขาดทุนราคาทุนของเงินลงทุนที่จำหน่ายใช้วิธีถัวเฉลี่ยถ่วงน้ำหนัก

### การรับรู้รายได้และค่าใช้จ่าย

รายได้เงินปันผลรับรู้เป็นรายได้นับแต่วันที่ประกาศจ่ายและมีสิทธิที่จะได้รับ

รายได้ดอกเบี้ยรับรู้เป็นรายได้ตามเกณฑ์คงค้าง โดยคำนึงถึงอัตราดอกเบี้ยที่แท้จริง

รายได้อื่นและค่าใช้จ่ายรับรู้ตามเกณฑ์คงค้าง

เมื่อมีการจำหน่ายเงินลงทุน ผลต่างระหว่างสิ่งตอบแทนสุทธิที่ได้รับกับมูลค่าตามบัญชีของเงินลงทุนจะรับรู้ในกำไรหรือขาดทุน

### บัญชีที่เป็นเงินตราต่างประเทศ

บัญชีที่เป็นเงินตราต่างประเทศ แปลงค่าเป็นเงินบาท โดยใช้อัตราแลกเปลี่ยน ณ วันเกิดรายการ สินทรัพย์และหนี้สินที่เป็นเงินตราต่างประเทศ ณ วันสิ้นปีแปลงค่าเป็นเงินบาท โดยใช้อัตราแลกเปลี่ยน ณ วันนั้น และสัญญาอนุพันธ์ ณ วันที่เกิดรายการ แปลงค่าเป็นเงินบาทโดยใช้อัตราตามสัญญา

ณ วันสิ้นปี กำไรหรือขาดทุนที่ยังไม่เกิดขึ้นจากสัญญาอนุพันธ์ที่ยังไม่ครบกำหนด จำนวนโดยปรับสัญญาอนุพันธ์ ณ วันสิ้นปีจากอัตราตามสัญญา เป็นราคาตลาดของสัญญาอนุพันธ์ที่มีอายุคงเหลือเช่นเดียวกัน โดยแสดงรวมในลูกหนี้หรือเจ้าหนี้จากสัญญาอนุพันธ์ในงบแสดงฐานะการเงิน

ผลต่างของอัตราแลกเปลี่ยนที่เกิดขึ้นจากการแปลงค่ารับรู้ในกำไรหรือขาดทุน

### ภาษีเงินได้

กองทุนเสียภาษีเงินได้ตามประมวลรัษฎากรจากรายได้ตามมาตรา 40 (ก) ในอัตราร้อยละ 15 ของรายได้ก่อนหักรายจ่ายใด ๆ

### การใช้ดุลยพินิจและการประมาณการทางบัญชี

ในการจัดทำงบการเงินให้เป็นไปตามแนวปฏิบัติทางบัญชี ฝ่ายบริหารต้องใช้ดุลยพินิจและการประมาณการหลายประการ ซึ่งมีผลกระทบต่อจำนวนเงินที่เกี่ยวข้องกับสินทรัพย์ หนี้สิน รายได้ ค่าใช้จ่าย และการเปิดเผยข้อมูลเกี่ยวกับสินทรัพย์และหนี้สินที่อาจเกิดขึ้น ซึ่งผลที่เกิดขึ้นจริงอาจแตกต่างไปจากจำนวนที่ประมาณการไว้

การใช้ดุลยพินิจและการประมาณการในการจัดทำงบการเงินจะได้รับการทบทวนอย่างต่อเนื่อง การปรับประมาณการทางบัญชีจะบันทึกโดยวิธีเปลี่ยนทันทีเป็นต้นไป

## 4. ข้อมูลเกี่ยวกับการซื้อขายเงินลงทุน

กองทุนได้ซื้อขายเงินลงทุนในระหว่างปี สรุปได้ดังนี้

|               | บาท              |                   |
|---------------|------------------|-------------------|
|               | 2566             | 2565              |
| ซื้อเงินลงทุน | 6,379,867,503.08 | 10,566,747,967.87 |
| ขายเงินลงทุน  | 6,725,631,532.68 | 10,195,702,515.60 |

5. รายการธุรกิจกับกิจการที่เกี่ยวข้องกัน

ในระหว่างปี กองทุนมีรายการธุรกิจระหว่างกันที่สำคัญกับบริษัทจัดการ และกิจการอื่น ซึ่งมีผู้ถือหุ้นและ/หรือ กรรมการเดียวกันกับบริษัทจัดการและกองทุน รายการที่สำคัญดังกล่าวสำหรับปีสิ้นสุดวันที่ 30 กันยายน 2566 และ 2565 มีดังต่อไปนี้

|  | บาท           |                  | นโยบายการกำหนดราคา             |
|--|---------------|------------------|--------------------------------|
|  | 2566          | 2565             |                                |
| บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด |               |                  |                                |
| ค่าธรรมเนียมการจัดการ                      | 25,605,308.85 | 55,662,285.00    | ตามเกณฑ์ที่ระบุในหนังสือชี้ชวน |
| ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน                     | 5,771,780.37  | 6,679,474.23     | ตามเกณฑ์ที่ระบุในหนังสือชี้ชวน |
| ธนาคารกรุงศรีอยุธยา จำกัด (มหาชน)          |               |                  |                                |
| ซื้อเงินตราต่างประเทศ                      | -             | 1,909,343,678.00 | ตามที่ระบุในสัญญา              |
| ขายเงินตราต่างประเทศ                       | 18,692.57     | 1,908,618,363.80 | ตามที่ระบุในสัญญา              |

ณ วันที่ 30 กันยายน 2566 และ 2565 กองทุนมียอดคงเหลือที่มีสาระสำคัญกับกิจการที่เกี่ยวข้องกัน ดังนี้

|  | บาท          |                |
|--|--------------|----------------|
|  | 2566         | 2565           |
| บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด |              |                |
| ค่าธรรมเนียมการจัดการค้างจ่าย              | 1,698,366.74 | 4,016,259.33   |
| ค่าธรรมเนียมนายทะเบียนค้างจ่าย             | 463,190.94   | 481,951.18     |
| เจ้าหนี้อื่น                               | 28,547.99    | 8,680.11       |
| ธนาคารกรุงศรีอยุธยา จำกัด (มหาชน)          |              |                |
| เจ้าหนี้จากสัญญาอนุพันธ์                   | -            | 112,141,048.89 |

6. อนุพันธ์ทางการเงินตามมูลค่ายุติธรรม

|                                       | บาท               |                |                |
|---------------------------------------|-------------------|----------------|----------------|
|                                       | 2566              |                |                |
|                                       | จำนวนเงินตามสัญญา | มูลค่ายุติธรรม |                |
|                                       |                   | สินทรัพย์      | หนี้สิน        |
| สัญญาซื้อขายเงินตราต่างประเทศล่วงหน้า | 3,377,955,924.00  | -              | 168,905,714.80 |



|                     | จำนวนเงินตามสัญญา |                  | มูลค่ายุติธรรม (บาท) |                |
|---------------------|-------------------|------------------|----------------------|----------------|
|                     | USD               | THB              | สินทรัพย์            | หนี้สิน        |
| สัญญาซื้อขายเงินตรา |                   |                  |                      |                |
| ต่างประเทศล่วงหน้า  | 31,307,139.22     | 3,922,021,454.40 | 47,048,057.06        | 201,822,817.08 |

## 7. การเปิดเผยข้อมูลสำหรับเครื่องมือทางการเงิน

### การประมาณมูลค่ายุติธรรม

มูลค่ายุติธรรม หมายถึง ราคาที่จะได้รับจากการขายสินทรัพย์หรือเป็นราคาที่จะจ่ายเพื่อโอนหนี้สินให้ผู้อื่น โดยรายการดังกล่าวเป็นรายการที่เกิดขึ้นในสภาพปกติระหว่างผู้ซื้อและผู้ขาย (ผู้ร่วมตลาด) ณ วันที่วัดมูลค่า กองทุนใช้ราคาเสนอซื้อขายในตลาดที่มีสภาพคล่องในการวัดมูลค่ายุติธรรมของสินทรัพย์และหนี้สินซึ่งแนวปฏิบัติทางบัญชีที่เกี่ยวข้องกำหนดให้ต้องวัดมูลค่าด้วยมูลค่ายุติธรรม ยกเว้นในกรณีที่ไม่มีตลาดที่มีสภาพคล่องสำหรับสินทรัพย์หรือหนี้สินที่มีลักษณะเดียวกันหรือไม่สามารถหาราคาเสนอซื้อขายในตลาดที่มีสภาพคล่องได้ กองทุนจะประมาณมูลค่ายุติธรรมโดยใช้เทคนิคการประเมินมูลค่าที่เหมาะสมกับแต่ละสถานการณ์ และพยายามใช้ข้อมูลที่สามารถสังเกตได้ที่เกี่ยวข้องกับสินทรัพย์หรือหนี้สินที่จะวัดมูลค่ายุติธรรมนั้นให้มากที่สุด

ตารางต่อไปนี้จะแสดงถึงเครื่องมือทางการเงินที่วัดมูลค่าด้วยมูลค่ายุติธรรมจำแนกตามวิธีการประมาณมูลค่าความแตกต่างของระดับข้อมูลสามารถแสดง ได้ดังนี้

- ราคาเสนอซื้อขาย (ไม่ต้องปรับปรุง) ในตลาดที่มีสภาพคล่องสำหรับสินทรัพย์หรือหนี้สินอย่างเดียวกัน (ข้อมูลระดับที่ 1)
- ข้อมูลอื่นนอกเหนือจากราคาเสนอซื้อขายซึ่งรวมอยู่ในระดับที่ 1 ที่สามารถสังเกตได้โดยตรง (ได้แก่ ข้อมูลราคาตลาด) หรือโดยอ้อม (ได้แก่ ข้อมูลที่คำนวณมาจากราคาตลาด) สำหรับสินทรัพย์นั้นหรือหนี้สินนั้น (ข้อมูลระดับที่ 2)
- ข้อมูลสำหรับสินทรัพย์หรือหนี้สินซึ่งไม่ได้อ้างอิงจากข้อมูลที่สามารถสังเกตได้จากตลาด (ข้อมูลที่ไม่สามารถสังเกตได้) (ข้อมูลระดับที่ 3)

|                  | บาท                      |                  |            |                  |
|------------------|--------------------------|------------------|------------|------------------|
|                  | ณ วันที่ 30 กันยายน 2566 |                  |            |                  |
|                  | ระดับที่ 1               | ระดับที่ 2       | ระดับที่ 3 | รวม              |
| <b>สินทรัพย์</b> |                          |                  |            |                  |
| กองทุน           | -                        | 3,483,445,196.28 | -          | 3,483,445,196.28 |
| ตราสารหนี้       | -                        | 55,750,909.96    | -          | 55,750,909.96    |
| <b>หนี้สิน</b>   |                          |                  |            |                  |
| ตราสารอนุพันธ์   | -                        | 168,905,714.80   | -          | 168,905,714.80   |

| บาท                      |                  |                |            |                  |
|--------------------------|------------------|----------------|------------|------------------|
| ณ วันที่ 30 กันยายน 2565 |                  |                |            |                  |
|                          | ระดับที่ 1       | ระดับที่ 2     | ระดับที่ 3 | รวม              |
| <b>สินทรัพย์</b>         |                  |                |            |                  |
| กองทุน                   | 2,706,875,414.69 | 396,842,847.77 | -          | 3,103,718,262.46 |
| ตราสารหนี้               | -                | 591,311,699.48 | -          | 591,311,699.48   |
| ตราสารอนุพันธ์           | -                | 47,048,057.06  | -          | 47,048,057.06    |
| <b>หนี้สิน</b>           |                  |                |            |                  |
| ตราสารอนุพันธ์           | -                | 201,822,817.08 | -          | 201,822,817.08   |

เงินลงทุนต่าง ๆ ซึ่งมูลค่าเงินลงทุนมาจากราคาตลาดที่มีการอ้างอิงไว้อย่างชัดเจนในตลาดที่มีสภาพคล่องและถูกจัดประเภทอยู่ในระดับที่ 1 นั้นประกอบด้วยกองทุนรวมที่จดทะเบียนที่มีสภาพคล่องที่ซื้อขายในตลาดที่จัดตั้งขึ้นอย่างเป็นทางการ กองทุนจะไม่ปรับราคาที่ยังอิงสำหรับเครื่องมือเหล่านี้

เครื่องมือทางการเงินซึ่งซื้อขายในตลาดที่ไม่ได้ถูกพิจารณาว่ามีสภาพคล่องแต่ถูกประเมินค่าจากราคาตลาดที่มีการอ้างอิงไว้อย่างชัดเจน การเสนอราคาซื้อขายโดยผู้ค้าหรือแหล่งกำหนดราคาที่เป็นทางเลือกซึ่งได้รับการสนับสนุนจากข้อมูลที่เกิดขึ้นได้จะถูกจัดอยู่ในระดับที่ 2 เครื่องมือทางการเงินเหล่านี้ประกอบด้วยกองทุนรวมที่มีได้จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ ตราสารหนี้ภาคเอกชนที่อยู่ในกลุ่มระดับลงทุน และอนุพันธ์ในตลาดซื้อขายกันโดยตรง

ในระหว่างปี ไม่มีการโอนรายการระหว่างลำดับชั้นของมูลค่ายุติธรรม

#### ความเสี่ยงด้านอัตราดอกเบี้ย

ความเสี่ยงด้านอัตราดอกเบี้ยคือความเสี่ยงที่มูลค่าของสินทรัพย์ทางการเงินและหนี้สินทางการเงินจะเปลี่ยนแปลงไปเนื่องจากการเปลี่ยนแปลงอัตราดอกเบี้ยในตลาด

ตารางต่อไปนี้ได้สรุปความเสี่ยงด้านอัตราดอกเบี้ยของกองทุน ซึ่งประกอบด้วยสินทรัพย์ทางการเงินและหนี้สินทางการเงินของกองทุนตามมูลค่ายุติธรรมและจำแนกตามประเภทอัตราดอกเบี้ย

| บาท   |   |                          |                        |                  |
|---|---|--------------------------|------------------------|------------------|
| ยอดคงเหลือของเครื่องมือทางการเงินสุทธิ ณ วันที่ 30 กันยายน 2566 |   |                          |                        |                  |
|   | มีอัตราดอกเบี้ย<br>ปรับขึ้นลงตาม<br>อัตราตลาด | มีอัตรา<br>ดอกเบี้ยคงที่ | ไม่มีอัตรา<br>ดอกเบี้ย | รวม              |
| <b>สินทรัพย์ทางการเงิน</b>                                      |   |                          |                        |                  |
| เงินลงทุนแสดงด้วยมูลค่ายุติธรรม                                 | 55,750,909.96                                 | -                        | 3,483,445,196.28       | 3,539,196,106.24 |
| เงินฝากธนาคาร   | 5,083,208.60                                  | -                        | -                      | 5,083,208.60     |
| ลูกหนี้จากดอกเบี้ย  | -   | -                        | 159,559.12             | 159,559.12       |
| ลูกหนี้จากการขายเงินลงทุน                                       | -   | -                        | 71,743,308.69          | 71,743,308.69    |
| ลูกหนี้จากการขายหน่วยลงทุน                                      | -   | -                        | 101,970.63             | 101,970.63       |
| ลูกหนี้อื่น   | -   | -                        | 244,934.93             | 244,934.93       |

|                          | บาท   |          |                |                |
|--------------------------|---|----------|----------------|----------------|
|                          | ยอดคงเหลือของเครื่องมือทางการเงินสุทธิ ณ วันที่ 30 กันยายน 2566 |          |                |                |
|                          | มีอัตราดอกเบี้ย   |          |                |                |
|                          | ปรับขึ้นลงตาม   | มีอัตรา  | ไม่มีอัตรา     |                |
| อัตราตลาด                | ดอกเบี้ยคงที่   | ดอกเบี้ย | รวม            |                |
| <u>หนี้สินทางการเงิน</u> |   |          |                |                |
| เจ้าหนี้จากการรับซื้อคืน |   |          |                |                |
| หน่วยลงทุน               | -   | -        | 30,064,805.45  | 30,064,805.45  |
| เจ้าหนี้จากสัญญาอนุพันธ์ | -   | -        | 168,905,714.80 | 168,905,714.80 |
| ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย       | -   | -        | 2,330,395.87   | 2,330,395.87   |
| ภาษีเงินได้ค้างจ่าย      | -   | -        | 23,933.86      | 23,933.86      |
| เจ้าหนี้อื่น             | -   | -        | 28,547.99      | 28,547.99      |
| หนี้สินอื่น              | -   | -        | 66,267.28      | 66,267.28      |

|                                 | บาท   |          |                  |                  |
|---------------------------------|---|----------|------------------|------------------|
|                                 | ยอดคงเหลือของเครื่องมือทางการเงินสุทธิ ณ วันที่ 30 กันยายน 2565 |          |                  |                  |
|                                 | มีอัตราดอกเบี้ย   |          |                  |                  |
|                                 | ปรับขึ้นลงตาม   | มีอัตรา  | ไม่มีอัตรา       |                  |
| อัตราตลาด                       | ดอกเบี้ยคงที่   | ดอกเบี้ย | รวม              |                  |
| <u>สินทรัพย์ทางการเงิน</u>      |   |          |                  |                  |
| เงินลงทุนแสดงด้วยมูลค่ายุติธรรม | 52,428,429.78   | -        | 3,642,601,532.16 | 3,695,029,961.94 |
| เงินฝากธนาคาร                   | 4,075,056.06  | -        | -                | 4,075,056.06     |
| ลูกหนี้จากเงินปันผลและดอกเบี้ย  | -   | -        | 128,678.99       | 128,678.99       |
| ลูกหนี้จากการขายหน่วยลงทุน      | -   | -        | 4,926.13         | 4,926.13         |
| ลูกหนี้จากสัญญาอนุพันธ์         | -   | -        | 47,048,057.06    | 47,048,057.06    |
| รายได้อื่นค้างรับ               | -   | -        | 1,179,606.22     | 1,179,606.22     |
| ลูกหนี้อื่น                     | -   | -        | 650,880.00       | 650,880.00       |
| <u>หนี้สินทางการเงิน</u>        |   |          |                  |                  |
| เจ้าหนี้จากการรับซื้อคืน        |   |          |                  |                  |
| หน่วยลงทุน                      | -   | -        | 7,335,076.83     | 7,335,076.83     |
| เจ้าหนี้จากสัญญาอนุพันธ์        | -   | -        | 201,822,817.08   | 201,822,817.08   |
| ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย              | -   | -        | 4,702,930.80     | 4,702,930.80     |
| ภาษีเงินได้ค้างจ่าย             | -   | -        | 6,729.59         | 6,729.59         |
| เจ้าหนี้อื่น                    | -   | -        | 8,680.11         | 8,680.11         |
| หนี้สินอื่น                     | -   | -        | 161,732.23       | 161,732.23       |

### ความเสี่ยงด้านเครดิต

กองทุนมีความเสี่ยงด้านเครดิตที่อาจเกิดจากการที่คู่สัญญาไม่สามารถปฏิบัติตามภาระผูกพันที่ระบุไว้ในเครื่องมือทางการเงิน เนื่องจากกองทุนมีลูกหนี้ อย่างไรก็ตาม สินทรัพย์ทางการเงินดังกล่าวจะครบกำหนดในระยะเวลาอันสั้น กองทุนจึงไม่คาดว่าจะได้รับความเสียหายจากการเก็บหนี้

### ความเสี่ยงด้านอัตราแลกเปลี่ยน

ณ วันที่ 30 กันยายน 2566 และ 2565 กองทุนมีบัญชีที่เป็นเงินตราต่างประเทศดังนี้

| รายการ                     | จำนวนเงิน     |               |
|----------------------------|---------------|---------------|
|                            | 2566          | 2565          |
| เงินลงทุน (มูลค่ายุติธรรม) |               |               |
| ดอลลาร์สหรัฐอเมริกา        | 95,523,218.15 | 78,868,830.50 |
| ยูโร                       | -             | 12,562,905.92 |
| ปอนด์สเตอร์ลิง             | -             | 4,690,533.08  |
| ลูกหนี้จากเงินปันผล        |               |               |
| ดอลลาร์สหรัฐอเมริกา        | -             | 2,220.15      |
| ลูกหนี้จากการขายเงินลงทุน  |               |               |
| ดอลลาร์สหรัฐอเมริกา        | 1,967,348.80  | -             |
| รายได้อื่นค้างรับ          |               |               |
| ดอลลาร์สหรัฐอเมริกา        | -             | 26,182.26     |
| ยูโร                       | -             | 4,203.98      |
| ปอนด์สเตอร์ลิง             | -             | 828.01        |

กองทุนได้ทำสัญญาอนุพันธ์เพื่อคุ้มครองความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยนของเงินลงทุนที่เป็นเงินตราต่างประเทศ (ดูหมายเหตุ 6)

### ความเสี่ยงด้านตลาด

กองทุนมีความเสี่ยงด้านตลาดเนื่องจากมีเงินลงทุนในกองทุนรวมในต่างประเทศ ซึ่งผลตอบแทนของเงินลงทุนดังกล่าวขึ้นอยู่กับความผันผวนของภาวะเศรษฐกิจ การเมือง สถานการณ์ตลาดเงินและตลาดทุน ซึ่งสถานการณ์ดังกล่าวอาจมีผลกระทบต่อทางด้านบวกหรือด้านลบต่อผลการดำเนินงานของบริษัทที่ออกตราสาร ทั้งนี้ขึ้นอยู่กับประเภทของธุรกิจของผู้ออกตราสารว่ามีความสัมพันธ์กับความผันผวนของตลาดมากน้อยเพียงใดอันอาจทำให้ราคาของตราสารเพิ่มขึ้นหรือลดลงได้

### การบริหารความเสี่ยง

ผู้บริหารของกองทุน BGF ESG Multi-Asset Fund จะวิเคราะห์ปัจจัยต่าง ๆ ที่มีผลกระทบต่อราคาของหลักทรัพย์ โดยกองทุนมีนโยบายการลงทุนในตราสารทุน ตราสารหนี้ที่เปลี่ยนมือได้ หน่วยลงทุนของกองทุนรวม เงินสด เงินฝาก และตราสารตลาดเงินของประเทศต่าง ๆ ทั่วโลก เพื่อให้ได้รับผลตอบแทนสูงสุด ตามหลักการลงทุนที่คำนึงถึงปัจจัยด้านความยั่งยืน ที่มีผลกระทบต่อสิ่งแวดล้อม สังคม และบรรษัทภิบาล

8. รายได้อื่น

รายได้อื่นรวมเงินจ่ายคืนค่าธรรมเนียมในการจัดการในต่างประเทศให้กับกองทุนตามอัตราที่ตกลงร่วมกันในสัญญา

9. การอนุมัติงบการเงิน

งบการเงินนี้ได้รับการอนุมัติให้ออกโดยผู้มีอำนาจของกองทุนเมื่อวันที่ 6 พฤศจิกายน 2566

# กองทุนเปิดกรุงศรีโกลบอลคอร์ปอเรชั่น

รายละเอียดการลงทุน ณ 30 กันยายน 2566

|  | มูลค่าตามราคาตลาด       | % NAV         |
|--|-------------------------|---------------|
| <b>หลักทรัพย์หรือทรัพย์สินในประเทศ</b>                             | <b>60,993,677.68</b>    | <b>1.79</b>   |
| เงินฝากธนาคาร  |                         |               |
| TRIS   |                         |               |
| Rate A   | 4,415.75                | 0.00          |
| S&P  |                         |               |
| Rate A-  | 5,085,273.82            | 0.15          |
| FITCH_TH-LONG  |                         |               |
| Rate AAA   | 55,903,988.11           | 1.64          |
| <b>หลักทรัพย์หรือทรัพย์สินต่างประเทศ</b>                           | <b>3,483,445,196.28</b> | <b>102.00</b> |
| หน่วยลงทุน   |                         |               |
| จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์  | 3,483,445,196.28        | 102.00        |
| <b>สัญญาซื้อขายล่วงหน้า</b>  | <b>(168,660,779.87)</b> | <b>(4.93)</b> |
| สัญญาที่อ้างอิงกับอัตราแลกเปลี่ยน-สัญญาแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ |                         |               |
| TRIS   |                         |               |
| Rate A+  | (66,399,398.12)         | (1.94)        |
| FITCH-LONG   |                         |               |
| Rate AA  | (102,261,381.75)        | (2.99)        |
| <b>อื่นๆ</b>   | <b>39,331,328.87</b>    | <b>1.14</b>   |
| ลูกหนี้  | 80,845,279.32           | 2.37          |
| เจ้าหนี้   | (39,183,554.58)         | (1.16)        |
| ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย   | (2,330,395.87)          | (0.07)        |
| <b>มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ</b>  | <b>3,415,109,422.96</b> | <b>100.00</b> |

## กองทุนเปิดกรุงศรีโกลบอลคอร์โวลเคชั่น

รายละเอียดการลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ณ 30 กันยายน 2566

| ประเภทสัญญา                       | คู่สัญญา             | วัตถุประสงค์      | มูลค่าสัญญา<br>(Notional Amount) | % NAV    | วันครบ<br>กำหนด | กำไร/ขาดทุน<br>(net gain/loss) |
|-----------------------------------|----------------------|-------------------|----------------------------------|----------|-----------------|--------------------------------|
| สัญญาที่อ้างอิงกับอัตราแลกเปลี่ยน |                      |                   |                                  |          |                 |                                |
| สัญญาฟอร์เวิร์ด                   | บมจ.ธ.กสิกรไทย       | ป้องกันความเสี่ยง | 794,199,879.00                   | (0.8878) | 3 พ.ย. 2566     | (30,319,821.71)                |
| สัญญาฟอร์เวิร์ด                   | บมจ.ธ.กสิกรไทย       | ป้องกันความเสี่ยง | 705,590,220.00                   | (0.8717) | 19 ม.ค. 2567    | (29,768,427.46)                |
| สัญญาฟอร์เวิร์ด                   | บมจ.ธนาคารไทยพาณิชย์ | ป้องกันความเสี่ยง | 71,988,243.62                    | 0.0072   | 4 ต.ค. 2566     | 244,934.93                     |
| สัญญาฟอร์เวิร์ด                   | บมจ.ธนาคารไทยพาณิชย์ | ป้องกันความเสี่ยง | 872,428,697.00                   | (1.2421) | 15 ธ.ค. 2566    | (42,418,067.51)                |
| สัญญาฟอร์เวิร์ด                   | บมจ.ธ.ทหารไทยธนชาติ  | ป้องกันความเสี่ยง | 166,927,616.00                   | (0.3020) | 12 ต.ค. 2566    | (10,312,137.22)                |
| สัญญาฟอร์เวิร์ด                   | บมจ.ธ.ทหารไทยธนชาติ  | ป้องกันความเสี่ยง | 707,035,454.00                   | (1.6096) | 24 พ.ย. 2566    | (54,969,267.48)                |
| สัญญาฟอร์เวิร์ด                   | บมจ.ธ.ทหารไทยธนชาติ  | ป้องกันความเสี่ยง | 131,774,058.00                   | (0.0327) | 15 ธ.ค. 2566    | (1,117,993.42)                 |

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)

กองทุนเปิดกรุงศรีโกลบอลคอร์ปอเรชัน

ตั้งแต่วันที่ 1 ตุลาคม 2565 ถึงวันที่ 30 กันยายน 2566

| ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม<br>(Fund's Direct Expenses) | จำนวนเงิน<br>(หน่วย: พันบาท) | ร้อยละของมูลค่า<br>ทรัพย์สิน* (ต่อปี) 1/ |
|--|------------------------------|--|
| ค่าธรรมเนียมการจัดการ (Management Fee) 2/                      | 25,605.31                    | 0.7120                                   |
| ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ (Trustee Fee) 3/                 | 1,217.81                     | 0.0339                                   |
| ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน (Registrar Fee)                         | 5,771.78                     | 0.1605                                   |
| ค่าที่ปรึกษาการลงทุน (Advisory Fee)                            | -                            | -  |
| ค่าธรรมเนียมสอบบัญชี (Auditing Fee)                            | 76.20                        | 0.0021                                   |
| ค่าใช้จ่ายอื่น ๆ (Others)                                      | -                            | -  |
| <b>รวมค่าใช้จ่ายทั้งหมด 4/</b>                                 | <b>32,671.10</b>             | <b>0.9085</b>                            |

หมายเหตุ

1/ ค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวมข้างต้น เป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่มหรือภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว

2/ ปัจจุบันเรียกเก็บในอัตราร้อยละ 0.5885 ต่อปีของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิ มีผลตั้งแต่วันที่ 1 ธันวาคม 2565 เป็นต้นไป

3/ ปัจจุบันเรียกเก็บในอัตราร้อยละ 0.0321 ต่อปีของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิ มีผลตั้งแต่วันที่ 1 ธันวาคม 2565 เป็นต้นไป

4/ ไม่รวมค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ และค่าธรรมเนียมต่าง ๆ ที่เกิดขึ้นจากการซื้อขายหลักทรัพย์

\* มูลค่าทรัพย์สิน ในที่นี้ หมายถึง มูลค่าทรัพย์สินทั้งหมด หักด้วย มูลค่าหนี้สินทั้งหมด

เว้นแต่ค่าธรรมเนียมการจัดการ ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ ค่าธรรมเนียมนายทะเบียนหน่วยลงทุน

และค่าใช้จ่ายที่เกี่ยวข้องกับการปฏิบัติการกองทุน ณ วันที่คำนวณ

**ค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์**  
**กองทุนเปิดกรุงศรีโกลบอลคอร์โวลเคชั่น / Krungsri Global Core Allocation Fund**  
**ตั้งแต่วันที่ 1 ตุลาคม 2565 ถึงวันที่ 30 กันยายน 2566**

| บริษัท             | จำนวนเงิน<br>(ดอลลาร์สหรัฐ) | อัตราส่วน<br>(%) |
|--------------------|-----------------------------|------------------|
| UBS AG             | 460.13                      | 59.57            |
| HSBC Bank Plc.     | 312.26                      | 40.43            |
| <b>รวม / Total</b> | <b>772.39</b>               | <b>100.00</b>    |

ค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์  
กองทุนเปิดกรุงศรีโกลบอลคอร์โวลเคชั่น / Krungsri Global Core Allocation Fund  
ตั้งแต่วันที่ 1 ตุลาคม 2565 ถึงวันที่ 30 กันยายน 2566

| บริษัท             | จำนวนเงิน<br>(ยูโร) | อัตราส่วน<br>(%) |
|--------------------|---------------------|------------------|
| UBS AG             | 127.42              | 100.00           |
| <b>รวม / Total</b> | <b>127.42</b>       | <b>100.00</b>    |

ผลการดำเนินงานของกองทุนเปิดกรุงศรีโกลบอลคอร์ปอเรชั่น

| ผลการดำเนินงาน<br>สิ้นสุด ณ วันที่<br>29 กันยายน 2566 | % ตามช่วงเวลา   |                     |                     | % ต่อปี          |                  |                  |                   | นับจากวันเริ่ม<br>โครงการ<br>(29 ตุลาคม 2563) |
|---|-----------------|---------------------|---------------------|------------------|------------------|------------------|-------------------|---|
|   | Year to<br>Date | ย้อนหลัง<br>3 เดือน | ย้อนหลัง<br>6 เดือน | ย้อนหลัง<br>1 ปี | ย้อนหลัง<br>3 ปี | ย้อนหลัง<br>5 ปี | ย้อนหลัง<br>10 ปี |   |
| KFCORE  | -1.74%          | -3.62%              | -3.26%              | -3.91%           | N/A              | N/A              | N/A               | -4.69%  |
| ดัชนีชี้วัด (Benchmark)*                              | N/A             | N/A                 | N/A                 | N/A              | N/A              | N/A              | N/A               | N/A   |
| ความผันผวนของผลการดำเนินงาน                           | +6.57%          | +7.67%              | +6.54%              | +7.51%           | N/A              | N/A              | N/A               | +7.16%  |

หมายเหตุ : \* ดัชนีชี้วัด (Benchmark) คือ

ไม่มี ซึ่งสอดคล้องกับกองทุนหลักที่ไม่มีตัวชี้วัดเช่นเดียวกัน

\*\* ผลตอบแทนที่มีอายุเกินหนึ่งปีจะแสดงเป็นผลตอบแทนต่อปี

เอกสารการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวมฉบับนี้ ได้จัดทำตามมาตรฐานการวัดผลดำเนินงานของ  
กองทุนรวมของสมาคมบริษัทจัดการลงทุน

**บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด**  
**รายงาน สรุปเกี่ยวกับการใช้สิทธิออกเสียง**

ชื่อกองทุน กองทุนเปิดกรุงศรีโกลบอลคอร์ปอเรชัน  
ระหว่างวันที่ 1 ตุลาคม 2565 - 30 กันยายน 2566

| ลำดับที่ | ชื่อบริษัท                                      | จำนวนครั้งที่เชิญประชุม (ครั้ง)* | จำนวนครั้งที่เข้าร่วมประชุม (ครั้ง)** | จำนวนครั้งที่ลงมติตามวาระการประชุม*** |         |            |
|----------|---|----------------------------------|---------------------------------------|---------------------------------------|---------|------------|
|          |   |                                  |                                       | เห็นด้วย                              | คัดค้าน | งดออกเสียง |
| 1        | BGF ESG Multi-Asset Fund Class I2<br>Hedged USD | 1                                | 1                                     | 12                                    | -       | -          |

หมายเหตุ \* หมายถึง จำนวนครั้งที่บริษัทที่จัดประชุมเชิญบริษัทจัดการเข้าร่วมประชุมในฐานะผู้ถือหุ้น

\*\* หมายถึง จำนวนครั้งที่บริษัทจัดการเข้าร่วมประชุมในฐานะผู้ถือหุ้น

\*\*\* หมายถึง จำนวนครั้งที่ลงมติออกเสียงในฐานะผู้ถือหุ้น การนับจำนวนครั้งเป็นการนับรวมการลงคะแนนเสียงในวาระเดียวกันรวมทุกธุรกิจจัดการลงทุนเป็น 1 ครั้ง

## ข้อมูลอื่นๆ ที่ผู้ถือหุ้นควรทราบ

(1) รายงานบุคคลที่เกี่ยวข้องที่มีการทำธุรกรรมในรอบเวลาที่ผ่านมา (วันที่ 1 ตุลาคม 2565 ถึงวันที่ 30 กันยายน 2566)

| ชื่อกองทุน                          | รายชื่อบุคคลที่เกี่ยวข้อง         |
|-------------------------------------|-----------------------------------|
| กองทุนเปิดกรุงศรี โกลบอลคอร์ปอเรชัน | ธนาคารกรุงศรีอยุธยา จำกัด (มหาชน) |

หมายเหตุ: ผู้ลงทุนสามารถตรวจสอบการทำธุรกรรมกับบุคคลที่เกี่ยวข้องกับกองทุนรวมได้ที่บริษัทจัดการ โดยตรง หรือที่ web site ของบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด (<http://www.krungsriasset.com>) และสำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ด. (<http://www.sec.or.th>)

(2) รายชื่อผู้จัดการกองทุน ณ วันที่ 30 กันยายน 2566

1. นายหลิต โขกทิพย์พัฒนา
2. นายสาริต บัวชู
3. นางสาวสาวิณี สุขศรีวงศ์
4. นายปิติ ประดิพัทธ์พงษ์
5. นายกวิน เจริญเสาวภาคย์
6. นายจตุรันต์ สอนไว
7. นายชูศักดิ์ อวยพรชัยสกุล
8. นายพงศ์ศักดิ์ อนุรักษ์
9. นางสาวรรดา ตันติสุนทร
10. นายวัชรินทร์ คิ้วสังข์

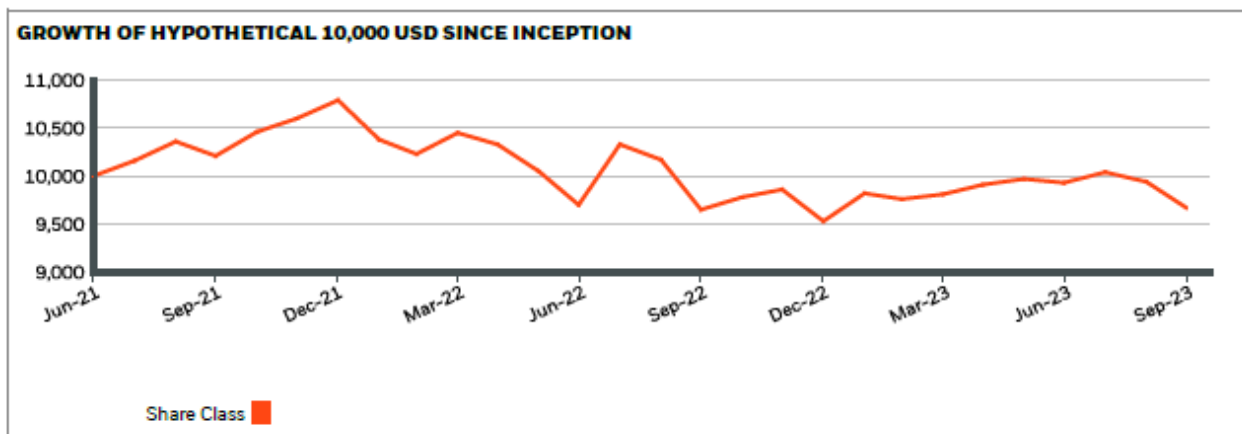
(3) การเปิดเผยข้อมูลการถือหน่วยลงทุนเกิน 1 ใน 3 ณ วันที่ 30 กันยายน 2566

ไม่มีการถือหน่วยลงทุนเกิน 1 ใน 3 ของบุคคลใดบุคคลหนึ่ง

ผู้ถือหุ้นลงทุนสามารถตรวจสอบข้อมูลสัดส่วนการถือหน่วยลงทุน โดยตรงได้ที่ [www.krungsriasset.com](http://www.krungsriasset.com)

(4) อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุนของกองทุน (portfolio turnover ratio) ในรอบระยะเวลาที่ผ่านมา เท่ากับ 10.11%

(5) ผลการดำเนินงานและข้อมูลการลงทุนของกองทุนหลัก (ข้อมูล ณ วันที่ 30/09/2023)



**CUMULATIVE & ANNUALISED PERFORMANCE**

|             | CUMULATIVE (%) |       |       |      | ANNUALISED (% p.a.) |    |    |                 |
|-------------|----------------|-------|-------|------|---------------------|----|----|-----------------|
|             | 1m             | 3m    | 6m    | YTD  | 1y                  | 3y | 5y | Since Inception |
| Share Class | -2.72          | -2.62 | -1.43 | 1.47 | 0.21                | -  | -  | -1.48           |

The figures shown relate to past performance. Past performance is not a reliable indicator of current or future performance and should not be the sole factor of consideration when selecting a product or strategy. Share Class and Benchmark performance displayed in USD, hedged fund benchmark performance is displayed in EUR. Performance is shown on a Net Asset Value (NAV) basis, with gross income reinvested where applicable. The return of your investment may increase or decrease as a result of currency fluctuations if your investment is made in a currency other than that used in the past performance calculation. Refer to the Key Facts section for share class & benchmark information. Source: BlackRock

**TOP HOLDINGS (%)**

|  |               |
|--|---------------|
| MICROSOFT CORP                             | 4.59%         |
| GREENCOAT UK WIND PLC                      | 3.88%         |
| ISHARES PHYSICAL GOLD                      | 1.96%         |
| SYNCONA LIMITED LTD NPV                    | 1.38%         |
| GNMA2 30YR                                 | 1.26%         |
| GERMANY (FEDERAL REPUBLIC OF) 0 08/15/2031 | 1.25%         |
| GREENCOAT RENEWABLES PLC                   | 1.19%         |
| ALPHABET INC CLASS A                       | 1.16%         |
| SDCL ENERGY EFFICIENCY INCOME TRUS         | 1.14%         |
| EUROPEAN UNION MTN RegS 0 03/04/2026       | 1.08%         |
| <b>Total of Portfolio</b>                  | <b>18.89%</b> |

Holdings subject to change

