



krungsri

Asset
Management

Make Life
Simple

A member of  MUGF
a global financial group

รายงานประจำปีแรก 2566

รอบระยะเวลาตั้งแต่วันที่ 1 ธันวาคม 2565 - 31 พฤษภาคม 2566

กองทุนรวม

KFACHINRMF

กองทุนเปิดกรุงศรีชีน่าเอแชนร์อิกวิตีเพื่อการเลี้ยงชีพ

Krungsri China A Shares Equity RMF

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

กองทุนเปิดกรุงศรีไชน่าเอแชนร์อควิตี้เพื่อการเลี้ยงชีพ

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

สารบริษัทจัดการ

เรียน ผู้ถือหน่วยลงทุน

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด (บริษัทฯ) ขอนำเสนอรายงานสำหรับรอบระยะเวลา 6 เดือน ของกองทุนเปิดกรุงศรีไชน่าเอแชนร์ อีควิตี้เพื่อการเลี้ยงชีพ (KFACHINRMF) ตั้งแต่วันที่ 1 ธันวาคม 2565 ถึงวันที่ 31 พฤษภาคม 2566 มายังผู้ถือหน่วยลงทุน โดยมีรายละเอียดดังนี้

ผลการดำเนินงาน

กองทุนเปิดกรุงศรีไชน่าเอแชนร์อีควิตี้เพื่อการเลี้ยงชีพ มีมูลค่าทรัพย์สินสุทธิ ณ วันที่ 31 พฤษภาคม 2566 เท่ากับ 907.33 ล้านบาท คิดเป็นมูลค่าทรัพย์สินสุทธิต่อหน่วยลงทุนเท่ากับ 5.4015 บาท โดยมีผลการดำเนินงานย้อนหลัง 6 เดือน ลดลงร้อยละ 4.47 ลดลงใกล้เคียงกับเกณฑ์มาตรฐานการวัดผลการดำเนินงาน ที่ลดลงร้อยละ 3.33

ภาวะการลงทุนในช่วงที่ผ่านมา

ในรอบครึ่งปีบัญชีที่ผ่านมา กองทุน UBS (Lux) Investment SICAV - China A Opportunity (กองทุนหลัก) ปรับตัวลดลงประมาณ 3.6% โดยในช่วงปลายปี 2565 ตลาดหุ้นจีนปรับตัวดีขึ้นจากข่าวการเปิดประเทศและคลายมาตรการ Zero COVID-19 ก่อนที่ตลาดจีนจะมีทิศทางชะลอตัวลงในปี 2566 จากความกังวลของผู้บริโภคและภาพเศรษฐกิจจีนที่ยังส่งสัญญาณชะลอตัว โดยเฉพาะในภาคการผลิตและภาคอสังหาริมทรัพย์ นอกจากนี้ การบริโภคของจีนกลับฟื้นตัวได้ช้ากว่าที่หลายฝ่ายคาด เนื่องจากความกังวลต่อเศรษฐกิจจีนที่ชะลอตัวส่งผลให้ผู้บริโภคไม่กล้าที่จะใช้เงิน ประกอบกับการชะลอตัวในราคาบ้านและสภาพคล่องในกลุ่มอสังหาริมทรัพย์เองก็เป็นอีกปัจจัยกดดันการเติบโตของเศรษฐกิจจีนต่อเนื่อง อีกทั้งภาคการผลิตที่มีทิศทางชะลอตามการส่งออก และแรงกดดันจากสหรัฐฯ ในเรื่องการค้าและเทคโนโลยี อย่างไรก็ตาม รัฐบาลจีนกลับมาให้ความสำคัญกับการเติบโตของเศรษฐกิจมากขึ้น โดยทางธนาคารกลางจีน (PBOC) เดินหน้าลดอัตราดอกเบี้ยนโยบายลง และออกมาตราการผ่อนคลายในการซื้อบ้านและนโยบายเพิ่มสภาพคล่องในตลาดอสังหาริมทรัพย์ นอกจากนี้ นโยบายเรื่องการควบคุมในภาคธุรกิจต่างๆ ได้ทยอยหมดลง ด้าน valuations ของตลาดหุ้นจีนยังคงอยู่ในระดับที่น่าสนใจหลังปรับตัวลดลงมา อย่างไรก็ตาม ตลาดจีนจะยังคงมีความผันผวน โดยต้องระวังความเสี่ยงจากความไม่แน่นอนด้านการเมืองระหว่างประเทศที่จะยังคงกดดันตลาดจีนอยู่เป็นระยะ

ณ สิ้นเดือนเมษายน 2566 กองทุนหลักมีสัดส่วนการลงทุนในหมวดสินค้าจำเป็น 24.3% หมวด Health Care 22.4% หมวดการเงิน 20.4% และหมวดสินค้าฟุ่มเฟือย 13.7% เป็นต้น

แนวโน้มการลงทุน

กองทุนหลักยังคงมีมุมมองที่ดีต่อการลงทุนในตลาดหุ้นจีน โดยเฉพาะหลังจากที่ทางการจีนกลับมาให้ความสำคัญต่อการเติบโตทางเศรษฐกิจ โดยคาดว่าอาจจะเห็นนโยบายกระตุ้นเศรษฐกิจออกมาต่อเนื่อง ประกอบกับการดำเนินนโยบายการเงินที่ยังคงผ่อนคลายของ PBOC อย่างไรก็ตาม การฟื้นตัวของเศรษฐกิจจีนจะยังคงมีความผันผวน โดยต้องจับตามองการฟื้นตัวของภาคบริโภคในประเทศ อีกทั้งต้องระวังความเสี่ยงจากการเมืองระหว่างประเทศโดยเฉพาะความสัมพันธ์ระหว่างสหรัฐฯ และจีนที่กลับมาตึงเครียดอีกครั้ง และภาคอสังหาริมทรัพย์ของจีนที่ยังคงชะลอตัว

บริษัทฯ ใคร่ขอขอบพระคุณท่านผู้ถือหน่วยลงทุนที่ได้มอบความไว้วางใจให้บริษัทฯ เป็นผู้บริหารเงินลงทุนของท่าน ทั้งนี้ บริษัทฯ จะพิจารณาดำเนินนโยบายการลงทุนที่เหมาะสมกับสถานการณ์ด้วยความระมัดระวัง และคำนึงถึงผลประโยชน์สูงสุดของผู้ถือหน่วยลงทุนเป็นสำคัญ

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด



รายงานความเห็นของผู้ดูแลผลประโยชน์

เสนอ ผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุนกองทุนเปิดกรุงศรีไชน่าเอแซริคิวิตีเพื่อการเลี้ยงชีพ

ตามที่ธนาคารไทยพาณิชย์ จำกัด (มหาชน) ในฐานะผู้ดูแลผลประโยชน์กองทุนเปิดกรุงศรีไชน่าเอแซริคิวิตีเพื่อการเลี้ยงชีพ ซึ่งมีบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด เป็นผู้จัดการกองทุน ได้ปฏิบัติหน้าที่ดูแลผลประโยชน์ของกองทุนดังกล่าว สำหรับระยะเวลาตั้งแต่วันที่ 1 ธันวาคม 2565 ถึงวันที่ 31 พฤษภาคม 2566 แล้วนั้น

ธนาคารฯ เห็นว่าบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด ได้ปฏิบัติหน้าที่ในการจัดการกองทุนเปิดกรุงศรีไชน่าเอแซริคิวิตีเพื่อการเลี้ยงชีพ โดยถูกต้องตามที่ควรตามวัตถุประสงค์ที่ได้กำหนดไว้ในโครงการจัดการที่ได้รับอนุมัติจากสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ และภายใต้ พระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535

ขอแสดงความนับถือ

ธนาคารไทยพาณิชย์ จำกัด (มหาชน)

(นางสาวกรรณจิต อำนวยธรรม)

ผู้จัดการบริการผู้ดูแลผลประโยชน์และบริการบัญชีกองทุน

กองทุนเปิดกรุงศรี ไซน่าเอแชรส์อควิตี้เพื่อการเลี้ยงชีพ

งบแสดงฐานะการเงิน

ณ 31 พฤษภาคม 2566

	Unaudited (บาท)
สินทรัพย์	
เงินลงทุนตามราคายุติธรรม (ราคาทุน 1,376,388,795.56 บาท)	927,968,914.09
เงินฝากธนาคาร	3,493,714.68
ลูกหนี้จากสัญญาอนุพันธ์	69,960.00
ลูกหนี้	
จากดอกเบี้ย	55,718.42
จากการขายหน่วยลงทุน	787,740.00
จากการรับเงินค่าตอบแทนจากเงินลงทุนในต่างประเทศ	1,515,914.58
รวมสินทรัพย์	<u>933,891,961.77</u>
หนี้สิน	
เจ้าหนี้จากสัญญาอนุพันธ์	17,816,200.36
เจ้าหนี้	
จากการรับซื้อคืนหน่วยลงทุน	7,761,488.71
ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย	961,167.33
หนี้สินอื่น	22,656.03
รวมหนี้สิน	<u>26,561,512.43</u>
สินทรัพย์สุทธิ	<u>907,330,449.34</u>
สินทรัพย์สุทธิ:	
หน่วยลงทุนจดทะเบียน 10,000 ล้านหน่วย มูลค่าที่ตราไว้หน่วยละ 10 บาท	
ทุนที่ได้รับจากผู้ถือหน่วยลงทุน	1,679,774,228.34
กำไรสะสม(ขาดทุนสะสม)	(501,143,213.36)
บัญชีปรับสมดุล	(271,300,565.64)
สินทรัพย์สุทธิ	<u>907,330,449.34</u>
สินทรัพย์สุทธิต่อหน่วย	5.4015
จำนวนหน่วยลงทุนที่จำหน่ายได้แล้วทั้งหมด ณ วันสิ้นงวด (หน่วย)	167,977,422.5083

กองทุนเปิดกรุงศรี ไร่นาเอเชอร์ควิตี้เพื่อการเลี้ยงชีพ
งบกำไรขาดทุนเบ็ดเสร็จ
สำหรับงวดบัญชีสิ้นสุดวันที่ 31 พฤษภาคม 2566

	Unaudited (บาท)
รายได้จากการลงทุน	
รายได้ดอกเบี้ย	66,905.33
รายได้จากการรับเงินค่าตอบแทนจากเงินลงทุนในต่างประเทศ	4,332,343.11
รวมรายได้	4,399,248.44
ค่าใช้จ่าย	
ค่าธรรมเนียมการจัดการ	4,172,035.06
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์	156,451.32
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน	782,256.64
ค่าธรรมเนียมวิชาชีพ	34,903.96
รวมค่าใช้จ่าย	5,145,646.98
รายได้จากการลงทุนสุทธิ	(746,398.54)
รายการกำไร (ขาดทุน) สุทธิจากเงินลงทุน	
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิที่เกิดขึ้นจากเงินลงทุน	(3,467,499.35)
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิที่ยังไม่เกิดขึ้นจากเงินลงทุน	(29,447,547.52)
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิที่ยังไม่เกิดขึ้นจากสัญญาอนุพันธ์	(48,950,874.63)
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิจากอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ	23,818,253.77
รวมรายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิจากเงินลงทุนที่เกิดขึ้นและยังไม่มีเกิดขึ้น	(58,047,667.73)
การเพิ่มขึ้นในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงานก่อนภาษีเงินได้	(58,794,066.27)

กองทุนเปิดกรุงศรี ไซน่าเอแชรวิคิตีเพื่อการเลี้ยงชีพ

งบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน

ณ 31 พฤษภาคม 2566

การแสดงรายละเอียดเงินลงทุนใช้การจัดกลุ่มตามประเภทของเงินลงทุนและประเภทของอุตสาหกรรม

ประเภทเงินลงทุน/ผู้ออกตราสาร/ผู้ออกหลักทรัพย์	หมายเลขตราสาร	อัตรา ดอกเบี้ย (%)	วันครบอายุ	เงินต้น (บาท) / จำนวนหุ้น	มูลค่ายุติธรรม (บาท)	Unaudited ร้อยละของ มูลค่าเงิน ลงทุน
หลักทรัพย์ในประเทศ						
เงินฝากออมทรัพย์						
บมจ. ธ.ยู โอบี		0.650000	เมื่อทวง	8,077,179.91	8,077,179.91	0.87
หลักทรัพย์ต่างประเทศ						
หน่วยลงทุน						
UBS (Lux) Investment SICAV-China A Opportunity (USD) (Class P-acc)	UBCAPA2			1,368,311,615.65	919,891,734.18	99.13
จำนวน 111,812.810000 หน่วย						
มูลค่าหน่วยละ 236.5800 USD						
รวมเป็นเงิน 26,452,673.88 USD						
					927,968,914.09	100.00

กองทุนเปิดกรุงศรีฯ ไซน่าเอแชรส์อควิตี้เพื่อการเลี้ยงชีพ

รายละเอียดการลงทุน ณ 31 พฤษภาคม 2566

	มูลค่าตามราคาตลาด	% NAV
หลักทรัพย์หรือทรัพย์สินในประเทศ	11,626,613.01	1.29
เงินฝากธนาคาร		
FITCH-LONG		
Rate BBB	3,499,763.10	0.39
FITCH_TH-LONG		
Rate AAA	8,126,849.91	0.90
หลักทรัพย์หรือทรัพย์สินต่างประเทศ	919,891,734.18	101.38
หน่วยลงทุน		
ไม่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์	919,891,734.18	101.38
สัญญาซื้อขายล่วงหน้า	(17,746,240.36)	(1.96)
สัญญาที่อ้างอิงกับอัตราแลกเปลี่ยน-สัญญาแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ		
FITCH-LONG		
Rate AA	(14,605,407.66)	(1.61)
Rate AA-	(3,140,832.70)	(0.35)
อื่นๆ	(6,441,657.49)	(0.71)
ลูกหนี้	2,303,654.58	0.25
เจ้าหนี้	(7,784,144.74)	(0.85)
ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย	(961,167.33)	(0.11)
มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ	907,330,449.34	100.00

กองทุนเปิดกรุงศรีไชน่าแชนร์อัครวิทย์เพื่อการเลี้ยงชีพ

รายละเอียดการลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ณ 31 พฤษภาคม 2566

ประเภทสัญญา	คู่สัญญา	วัตถุประสงค์	มูลค่าสัญญา (Notional Amount)	% NAV	วันครบกำหนด	กำไร/ขาดทุน (net gain/loss)
สัญญาที่อ้างอิงกับอัตราแลกเปลี่ยน						
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ธ.กรุงศรีอยุธยา	ป้องกันความเสี่ยง	169,932,262.50	(0.3462)	27 ก.ค. 2566	(3,140,832.70)
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ธ.กสิกรไทย	ป้องกันความเสี่ยง	205,645,640.00	(1.1336)	16 มี.ย. 2566	(10,285,385.78)
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ธ.กสิกรไทย	ป้องกันความเสี่ยง	202,650,442.90	(0.0288)	7 ก.ค. 2566	(260,946.92)
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ธ.กสิกรไทย	ป้องกันความเสี่ยง	138,351,576.00	(0.2637)	18 ส.ค. 2566	(2,392,467.12)
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ธ.กสิกรไทย	ป้องกันความเสี่ยง	40,163,453.00	0.0077	18 ส.ค. 2566	69,960.00
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ธนาคารไทยพาณิชย์	ป้องกันความเสี่ยง	187,629,232.00	(0.1914)	18 ส.ค. 2566	(1,736,567.84)

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)

กองทุนเปิดกรุงศรีไชน่าเอแชรส์อควิตีเพื่อการเลี้ยงชีพ

ตั้งแต่วันที่ 1 ธันวาคม 2565 ถึงวันที่ 31 พฤษภาคม 2566

ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (Fund's Direct Expenses)	จำนวนเงิน (หน่วย: พันบาท)	ร้อยละของมูลค่า ทรัพย์สิน* (ต่อปี) 1/
ค่าธรรมเนียมการจัดการ (Management Fee)	4,172.04	0.8560
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ (Trustee Fee)	156.45	0.0321
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน (Registrar Fee)	782.26	0.1605
ค่าที่ปรึกษาการลงทุน (Advisory Fee)	-	-
ค่าธรรมเนียมสอบบัญชี (Auditing Fee)	34.90	0.0072
ค่าใช้จ่ายอื่น ๆ (Others)	-	-
รวมค่าใช้จ่ายทั้งหมด 2/	5,145.65	1.0558

หมายเหตุ

1/ ค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวมข้างต้น เป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่มหรือภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว

2/ ไม่รวมค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ และค่าธรรมเนียมต่าง ๆ ที่เกิดขึ้นจากการซื้อขายหลักทรัพย์

* มูลค่าทรัพย์สิน ในที่นี้ หมายถึง มูลค่าทรัพย์สินทั้งหมด หักด้วย มูลค่าหนี้สินทั้งหมด

เว้นแต่ค่าธรรมเนียมการจัดการ ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ ค่าธรรมเนียมนายทะเบียนหน่วยลงทุน และค่าใช้จ่ายที่เกี่ยวข้องกับการปฏิบัติการกองทุน ณ วันที่คำนวณ

ผลการดำเนินงานของกองทุนเปิดกรุงศรีไชน่าเอแชนร์อควิตี้เพื่อการเลี้ยงชีพ

ผลการดำเนินงาน สิ้นสุด ณ วันที่ 31 พฤษภาคม 2566	% ตามช่วงเวลา			% ต่อปี				นับจากวันเริ่ม โครงการ (29 ธันวาคม 2563)
	Year to Date	ย้อนหลัง 3 เดือน	ย้อนหลัง 6 เดือน	ย้อนหลัง 1 ปี	ย้อนหลัง 3 ปี	ย้อนหลัง 5 ปี	ย้อนหลัง 10 ปี	
KFACHINRMF	-9.65%	-12.14%	-4.47%	-19.05%	N/A	N/A	N/A	-22.48%
ดัชนีชี้วัด (Benchmark)*	-3.01%	-10.64%	-3.33%	-9.55%	N/A	N/A	N/A	-5.84%
ความผันผวนของผลการดำเนินงาน	16.83%	16.36%	17.40%	22.41%	N/A	N/A	N/A	23.10%
ความผันผวนของดัชนีชี้วัด	13.74%	14.26%	14.85%	17.37%	N/A	N/A	N/A	19.73%

- หมายเหตุ :
- * ดัชนีชี้วัด (Benchmark) คือ ดัชนี MSCI China A Onshore สัดส่วน 100% บริษัทจัดการจะใช้ดัชนีชี้วัดตามกองทุนหลัก
ในสกุลเงินเหรียญสหรัฐ ปรับด้วยอัตราแลกเปลี่ยนเพื่อเทียบเท่ากับค่าสกุลเงินบาท ณ วันที่คำนวณผลตอบแทน
 - ** ผลตอบแทนที่มีอายุเกินหนึ่งปีจะแสดงเป็นผลตอบแทนต่อปี

เอกสารการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวมฉบับนี้ ได้จัดทำตามมาตรฐานการวัดผลการดำเนินงานของ

กองทุนรวมของสมาคมบริษัทจัดการลงทุน

ข้อมูลอื่นๆ ที่ผู้ถือหน่วยลงทุนควรทราบ

(1) รายงานบุคคลที่เกี่ยวข้องที่มีการทำธุรกรรมในรอบเวลาที่ผ่านมา (วันที่ 1 ธันวาคม 2565 ถึงวันที่ 31 พฤษภาคม 2566)

ชื่อกองทุน	รายชื่อบุคคลที่เกี่ยวข้อง
กองทุนเปิดกรุงศรี ไซน่าเอแชรส์อควิตี้เพื่อการเลี้ยงชีพ	ธนาคารกรุงศรีอยุธยา จำกัด (มหาชน)

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

(2) รายชื่อผู้จัดการกองทุน ณ วันที่ 31 พฤษภาคม 2566

1. นายชาติ โสภทิต์พัฒนา
2. นายสาธิต บัวชู
3. นางสาวสาวินี สุขศรีวงศ์
4. นายปิติ ประดิพัทธ์พงษ์
5. นายกวิพ เจริญเสาวภาคย์
6. นายจตุรันต์ สอนไว
7. นายชูศักดิ์ อวยพรชัยสกุล
8. นายพงศ์สัมพันธ์ อนุรัตน์
9. นางสาววรรดา ตันตีสุนทร
10. นายวัชรินทร์ คิ้วสังข์

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

ไม่มีกรถือหน่วยลงทุนเกิน 1 ใน 3 ของบุคคลใดบุคคลหนึ่ง

ผู้ถือหน่วยลงทุนสามารถตรวจสอบข้อมูลสัดส่วนการถือหน่วยลงทุน โดยตรงได้ที่ www.krungsriasset.com

(4) อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุนของกองทุน (portfolio turnover ratio) ในรอบระยะเวลาที่ผ่านมา เท่ากับ 1.27%

(5) ผลการดำเนินงานและข้อมูลการลงทุนของกองทุนหลัก (ข้อมูล ณ วันที่ 31/05/2023)

Rolling periods performance ¹	Annualized							
	Last Month	Last Three Months	Year to Date	One Year	Three Years	Five Years	Ten Years	Since Inception ²
Composite Performance								
Composite (Net of Fees³)	-8.71	-11.27	-7.61	-14.56	-6.69	-2.26	8.93	7.99
Composite (Gross of Fees)	-8.55	-10.81	-6.82	-12.82	-4.81	-0.29	11.24	10.48
MSCI China A Onshore	-7.34	-9.18	-3.75	-11.04	2.26	0.51	3.03	3.53
Value added⁴ (Net of Fees³)	-1.38	-2.09	-3.86	-3.52	-8.95	-2.77	5.90	4.46
Value added (Gross of Fees)	-1.21	-1.63	-3.07	-1.78	-7.07	-0.80	8.21	6.95
Standard Deviation								
Composite				32.16	25.50	24.44	23.24	25.02
Primary Benchmark				25.70	22.52	22.16	24.35	29.10
Tracking Error				11.69	11.47	11.10	11.91	11.76
Information Ratio				-0.15	-0.62	-0.07	0.69	0.59

Monthly composite stock attribution: ^{1,5,6} (gross of fees)

Top 5 contributors	Return (%)	Contribution ⁷ (%)	Over/underweight ⁸
LONGi Green Energy Technology	--	0.09	UW
Zijin Mining Group	--	0.09	UW
NetEase	-4.19	0.08	OW
Inner Mongolia Yili Indl	-4.95	0.08	OW
China Merchants Bank	-6.25	0.07	OW
Top 5 detractors			
Gree Electric Appliances	-18.25	-0.43	OW
Midea Group	-11.84	-0.18	OW
Hangzhou Tigermed	-13.37	-0.17	OW
Ping An Bank	-9.86	-0.16	OW
Kweichow Moutai	-9.77	-0.15	OW

Monthly composite sector attribution: ^{1,5,6} (gross of fees)

	Active weight ⁸ (%)	Allocation Effect ⁹ (%)	Selection + Interaction ⁹ (%)	Total Effect
Cash	10.12	0.65	--	0.65
Energy	-2.19	0.10	--	0.10
Materials	-8.68	0.19	-0.09	0.10
Consumer Staples	12.53	-0.45	0.52	0.07
Communication Services	2.31	0.02	0.04	0.06
Industrials	-16.80	-0.01	0.00	-0.01
Real Estate	-0.91	0.02	-0.03	-0.02
Utilities	-2.51	-0.20	--	-0.20
Health Care	13.40	0.10	-0.42	-0.32
Financials	3.14	0.05	-0.48	-0.42
Information Technology	-16.40	-0.50	0.00	-0.51
Consumer Discretionary	6.00	-0.11	-0.58	-0.69
Total		-0.13	-1.05	-1.18

Current top active stock positions: ¹ (gross of fees)

Positive/overweights	Active weight (%)	Negative/underweights	Active weight (%)
Yunnan Baiyao Group	8.28	Contemp Amperex	-2.23
China Merchants Bank	7.07	Industrial Bank	-1.10
Ping An Bank	6.18	BYD	-0.95
Kweichow Moutai	6.01	CITIC Securities	-0.84
Midea Group	3.79	China Yangtze Power	-0.82

Current top active sector positions (all active sectors)

Positive/overweights	Active weight (%)	Negative/underweights	Active weight (%)
Health Care	13.05	Information Technology	-17.20
Consumer Staples	12.90	Industrials	-16.87
Cash	10.95	Materials	-8.55
Consumer Discretionary	5.74	Utilities	-2.63
Financials	3.14	Energy	-2.08
Communication Services	2.46	Real Estate	-0.92