



krungsri

Asset
Management

Make Life
Simple

A member of  MUGF
a global financial group

รายงานประจำปีแรก 2566

รอบระยะเวลาตั้งแต่วันที่ 1 เมษายน 2566 – 30 กันยายน 2566

กองทุนรวม

KFINNO

กองทุนเปิดกรุงศรี Disruptive Innovation

Krungsri Disruptive Innovation Fund

กองทุนนี้มีการแบ่งชนิดหน่วยลงทุนเป็น 3 ชนิด ได้แก่

1. หน่วยลงทุนชนิดสะสมมูลค่า :

กองทุนเปิดกรุงศรี Disruptive Innovation-สะสมมูลค่า (KFINNO-A)

2. หน่วยลงทุนชนิดผู้ลงทุนสถาบัน :

กองทุนเปิดกรุงศรี Disruptive Innovation-ผู้ลงทุนสถาบัน (KFINNO-I)

3. หน่วยลงทุนชนิดจ่ายเงินปันผล :

กองทุนเปิดกรุงศรี Disruptive Innovation-ปันผล (KFINNO-D)

(บริษัทจัดการยังไม่เปิดขายหน่วยลงทุนชนิดนี้)

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

รายงานประจำปีครั้งที่ 1 ประจำปี 2566

กองทุนเปิดกรุงศรี Disruptive Innovation

- สารบัญผู้จัดการ 3
- รายงานผู้ดูแลผลประโยชน์ 4
- งบแสดงฐานะการเงิน งบกำไรขาดทุนเบ็ดเสร็จ และงบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน 5
- รายละเอียดเงินลงทุน การกู้ยืมเงิน และการก่อภาระผูกพันของกองทุนรวม 8
- ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม 11
- ผลการดำเนินงาน 12
- ข้อมูลอื่นๆ ที่ผู้ถือหน่วยลงทุนควรทราบ 14
 - รายงานบุคคลที่เกี่ยวข้องที่มีการทำธุรกรรมในรอบเวลาที่ผ่านมา
 - รายชื่อผู้จัดการกองทุน
 - การเปิดเผยข้อมูลการถือหน่วยลงทุนเกิน 1 ใน 3
 - อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุนของกองทุน
 - ข้อมูลการลงทุน และผลการดำเนินงานของกองทุนหลัก

สารบริษัทจัดการ

เรียน ผู้ถือหน่วยลงทุน

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด (บริษัทฯ) ขอส่งรายงานสำหรับรอบระยะเวลา 6 เดือน ของกองทุนเปิดกรุงศรี Disruptive Innovation (KFINNO) ตั้งแต่วันที่ 1 เมษายน 2566 ถึงวันที่ 30 กันยายน 2566 มายังผู้ถือหน่วยลงทุน โดยมีรายละเอียด ดังนี้

ผลการดำเนินงาน

กองทุนเปิดกรุงศรี Disruptive Innovation มีมูลค่าทรัพย์สินสุทธิ ณ วันที่ 30 กันยายน 2566 ซึ่งแบ่งตามชนิดหน่วยลงทุน ดังนี้

- KFINNO-A จำนวน 208.02 ล้านบาท คิดเป็นมูลค่าทรัพย์สินสุทธิต่อหน่วยลงทุน 3.0616 บาท
- KFINNO-I จำนวน 1.57 พันบาท คิดเป็นมูลค่าทรัพย์สินสุทธิต่อหน่วยลงทุน 3.0627 บาท

และมีผลการดำเนินงานย้อนหลัง 6 เดือน โดยแบ่งตามชนิดหน่วยลงทุน ได้แก่

- KFINNO-A ลดลงร้อยละ 2.95 ลดลงมากกว่าเกณฑ์มาตรฐานการวัดผลการดำเนินงาน ที่ลดลงร้อยละ 1.07
- KFINNO-I ลดลงร้อยละ 2.93 ลดลงมากกว่าเกณฑ์มาตรฐานการวัดผลการดำเนินงาน ที่ลดลงร้อยละ 1.07

ภาวะการลงทุนในช่วงที่ผ่านมา

ในรอบครึ่งปีบัญชีที่ผ่านมา Nikko AM ARK Disruptive Innovation Fund (กองทุนหลัก) ปรับตัวลง 1.1% โดยหุ้นนวัตกรรมที่มีการเติบโตสูงได้รับอานิสงค์จากการฟื้นตัวของตลาดหุ้นโลกในไตรมาสที่ 2 หลังจากเงินเฟ้อในสหรัฐฯและยุโรป ชะลอตัวลงต่อเนื่อง และมีปัจจัยสนับสนุนเพิ่มเติมจากความสนใจของนักลงทุนเกี่ยวกับปัญญาประดิษฐ์ (AI) อันเนื่องมาจากความน่าสนใจของ ChatGPT อีกทั้งรายได้ที่เติบโตขึ้นอย่างมากของธุรกิจซอฟต์แวร์ สะท้อนให้เห็นถึงความต้องการฮาร์ดแวร์ที่เกี่ยวข้องกับ AI เพิ่มขึ้น โดยกองทุนหลักได้ประเมินว่าธุรกิจซอฟต์แวร์อาจสร้างรายได้สูงถึง 8 ดอลลาร์สหรัฐต่อทุกๆ จำนวนเงินที่ใช้จ่ายไปกับด้านฮาร์ดแวร์ภายในปี 2573 นอกจากนี้ กองทุนหลักมีมุมมองว่ารถยนต์ไฟฟ้าที่มีระบบขับเคลื่อนแบบอัตโนมัติ และกระเป๋าเงินดิจิทัล รวมไปถึงเทคโนโลยี blockchain และการให้บริการการเงินแบบกระจายศูนย์ (DeFi) จะสร้างการเปลี่ยนแปลงที่อาจทำให้ธุรกิจพลังงาน และธุรกิจการให้บริการด้านการเงินต้องหยุดชะงัก อย่างไรก็ตาม ในไตรมาสที่ 3 กองทุนเผชิญปัจจัยลบจากการปรับตัวเพิ่มขึ้นของ Bond yield โดยมีปัจจัยกดดันมาจากข้อมูลเศรษฐกิจที่ฟื้นตัวขึ้น และอัตราเงินเฟ้อในสหรัฐฯ ซึ่งอาจทำให้อาณาการกลางสหรัฐฯ (Fed) มีโอกาสที่จะปรับขึ้นอัตราดอกเบี้ยต่อไปในช่วงปลายปี ส่งผลให้หุ้นนวัตกรรมที่มีการเติบโตสูงปรับตัวลดลง อย่างไรก็ตาม ผู้จัดการกองทุนมองว่าทิศทางการเติบโตทางเศรษฐกิจและอัตราเงินเฟ้อมีแนวโน้มชะลอตัวลง ในภาวะแบบนี้ บริษัทที่มีการเติบโตสูงจะได้รับความสนใจจากนักลงทุนมากขึ้น นอกจากนี้ การนำเอาเทคโนโลยีใหม่มาประยุกต์ใช้จะเร่งตัวขึ้น และหุ้นที่มีความเกี่ยวข้องกับนวัตกรรมจะปรับตัวได้ดีขึ้น โดยยังได้รับแรงสนับสนุนจากพัฒนาการในด้านต่างๆ เช่น ธุรกิจ AI การแพทย์แบบ Genomics รถยนต์ไฟฟ้าขับเคลื่อนโดยอัตโนมัติ และกระเป๋าเงินดิจิทัล เป็นต้น

ณ สิ้นเดือนสิงหาคม 2566 กองทุนหลักมีการลงทุนในหมวด Cloud computing 16.1% หมวด Digital Media 15.5% และหมวด E-commerce 8.5% เป็นต้น โดยแบ่งเป็นการลงทุนในสหรัฐฯ เป็นหลักประมาณ 91.4%

แนวโน้มการลงทุน

สำหรับแนวโน้มการลงทุน กองทุนหลักยังคงมีมุมมองที่ดีต่อการลงทุนในหุ้นนวัตกรรม ซึ่งได้รับอานิสงค์จากแนวโน้มการเติบโตของการเงินแบบผ่อนคลายเป็นพิเศษมากขึ้น หลังจากเงินเฟ้อส่งสัญญาณชะลอตัวต่อเนื่อง นอกจากนี้ บริษัทที่เน้นลงทุนในเทคโนโลยีที่สร้างนวัตกรรมที่น่าสนใจ อย่างเช่น ธุรกิจปัญญาประดิษฐ์ (AI) การแพทย์แบบ Genomics รถยนต์ไฟฟ้าขับเคลื่อนโดยอัตโนมัติ การลงทุนใน Blockchain และกระเป๋าเงินดิจิทัล มีโอกาสของการเติบโตระดับสูงสำหรับการลงทุนในระยะยาว โดยธุรกิจในกลุ่มดังกล่าวจะเข้ามามีบทบาทในชีวิตประจำวันมากขึ้น

บริษัทฯ ใคร่ขอขอบพระคุณท่านผู้ถือหน่วยลงทุนที่ได้มอบความไว้วางใจให้บริษัทฯ เป็นผู้บริหารเงินลงทุนของท่าน ทั้งนี้ บริษัทฯ จะพิจารณาดำเนินนโยบายการลงทุนที่เหมาะสมกับสถานการณ์ด้วยความระมัดระวัง และคำนึงถึงผลประโยชน์สูงสุดของผู้ถือหน่วยลงทุนเป็นสำคัญ

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด

รายงานผู้ดูแลผลประโยชน์

เสนอ ผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุนกองทุนเปิดกรุงศรี Disruptive Innovation

ธนาคารซีทีแบงก์ เอ็น เอ สาขากรุงเทพฯ ในฐานะผู้ดูแลผลประโยชน์ กองทุนเปิดกรุงศรี Disruptive Innovation อันมีบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด เป็นผู้จัดตั้งและจัดการกองทุน ได้ปฏิบัติหน้าที่ดูแลผลประโยชน์กองทุนรวมดังกล่าว สำหรับรอบระยะเวลาตั้งแต่วันที่ 1 เมษายน 2566 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 Disruptive Innovation

งบแสดงฐานะการเงิน

ณ 30 กันยายน 2566

| | Unaudited (บาท) |
|-------------------------------------------------------------------|-----------------------|
| สินทรัพย์ | |
| เงินลงทุนตามราคายุติธรรม (ราคาทุน 296,297,424.90 บาท) | 217,112,125.95 |
| เงินฝากธนาคาร | 2,316,998.53 |
| ลูกหนี้จากสัญญาอนุพันธ์ | 823,072.13 |
| ลูกหนี้ | |
| จากดอกเบี้ย | 8,045.35 |
| จากการขายหน่วยลงทุน | 6,404.02 |
| รวมสินทรัพย์ | <u>220,266,645.98</u> |
| หนี้สิน | |
| เจ้าหนี้จากสัญญาอนุพันธ์ | 11,263,317.46 |
| เจ้าหนี้ | |
| จากการรับซื้อคืนหน่วยลงทุน | 108,013.31 |
| ค่าธรรมเนียมสับเปลี่ยนหน่วยลงทุน | 589,503.64 |
| ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย | 278,670.86 |
| ภาษีเงินได้ค้างจ่าย | 1,206.80 |
| หนี้สินอื่น | 7,007.96 |
| รวมหนี้สิน | <u>12,247,720.03</u> |
| สินทรัพย์สุทธิ | <u>208,018,925.95</u> |
| สินทรัพย์สุทธิ: | |
| หน่วยลงทุนจดทะเบียน 5,000 ล้านหน่วย มูลค่าที่ตราไว้หน่วยละ 10 บาท | |
| ทุนที่ได้รับจากผู้ถือหน่วยลงทุน | 679,441,873.76 |
| กำไรสะสม | (268,510,809.27) |
| บัญชีปรับสมดุล | (202,912,138.54) |
| สินทรัพย์สุทธิ | <u>208,018,925.95</u> |
| ชนิดสะสมมูลค่า | |
| สินทรัพย์สุทธิ | 208,017,356.12 |
| หน่วยลงทุนที่ออกจำหน่ายแล้ว ณ วันสิ้นปี (หน่วย) | 67,943,674.8188 |
| สินทรัพย์สุทธิต่อหน่วย | 3.0616 |
| ชนิดผู้ลงทุนสถาบัน | |
| สินทรัพย์สุทธิ | 1,569.83 |
| หน่วยลงทุนที่ออกจำหน่ายแล้ว ณ วันสิ้นปี (หน่วย) | 512.5576 |
| สินทรัพย์สุทธิต่อหน่วย | 3.0627 |

กองทุนเปิดกรุงศรี Disruptive Innovation
งบกำไรขาดทุนเบ็ดเสร็จ
สำหรับงวดบัญชีสิ้นสุดวันที่ 30 กันยายน 2566

| | Unaudited (บาท) |
|--------------------------------------------------------------------------|--------------------|
| รายได้จากการลงทุน | |
| รายได้ดอกเบี้ย | 14,066.93 |
| รวมรายได้ | 14,066.93 |
| ค่าใช้จ่าย | |
| ค่าธรรมเนียมการจัดการ | 1,173,561.69 |
| ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ | 28,165.20 |
| ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน | 140,827.54 |
| ค่าธรรมเนียมวิชาชีพ | 25,669.09 |
| รวมค่าใช้จ่าย | 1,368,223.52 |
| รายได้จากการลงทุนสุทธิ | (1,354,156.59) |
| รายการกำไร (ขาดทุน) สุทธิจากเงินลงทุน | |
| รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิที่เกิดขึ้นจากเงินลงทุน | (38,896,857.17) |
| รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิที่ยังไม่เกิดขึ้นจากเงินลงทุน | 26,234,345.56 |
| รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิที่ยังไม่เกิดขึ้นจากสัญญาอนุพันธ์ | (9,290,875.85) |
| รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิจากอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ | 11,731,951.58 |
| รวมรายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิจากเงินลงทุนที่เกิดขึ้นและยังไม่มีเกิดขึ้น | (10,221,435.88) |
| หัก ภาษีเงินได้ | (2,110.03) |
| การเพิ่มขึ้นในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงานหลังหักภาษีเงินได้ | (11,577,702.50) |
| การเพิ่มขึ้นในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงานแยกตามชนิดหน่วยลงทุน มีดังนี้ | |
| ชนิดสะสมมูลค่า | (11,577,655.08) |
| ชนิดผู้ลงทุนสถาบัน | (47.42) |
| รวม | (11,577,702.50) |

กองทุนเปิดกรุงศรี Disruptive Innovation

งบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน

ณ 30 กันยายน 2566

การแสดงรายละเอียดเงินลงทุนใช้การจัดกลุ่มตามประเภทของเงินลงทุนและประเภทของอุตสาหกรรม

| ประเภทเงินลงทุน/ผู้ออกตราสาร/ผู้ออกหลักทรัพย์ | หมายเลขตราสาร | อัตรา ดอกเบี้ย (%) | วันครบอายุ | เงินต้น (บาท) / จำนวนหุ้น | มูลค่ายุติธรรม (บาท) | Unaudited ร้อยละของ มูลค่าเงิน ลงทุน |
|-----------------------------------------------|---------------|--------------------------|-------------|------------------------------|-------------------------|-----------------------------------------------|
| หลักทรัพย์ในประเทศ | | | | | | |
| เงินฝากออมทรัพย์ | | | | | | |
| | | | | | | 2.23 |
| บมจ.ธ.ทิสโก้ | | 0.500000 | เมื่อทวงถาม | 1,082.00 | 1,082.00 | 0.00 |
| บมจ.ธ.ยูโอบี | | 1.050000 | เมื่อทวงถาม | 4,830,949.56 | 4,830,949.56 | 2.23 |
| หลักทรัพย์ต่างประเทศ | | | | | | |
| เงินฝากออมทรัพย์ | | | | | | |
| ธ.ซีทีแบงก์ สาขากรุงเทพฯ | | | เมื่อทวงถาม | 88.61 | 88.61 | 0.00 |
| จำนวนเงิน 2.43 USD | | | | | | |
| หน่วยลงทุน | | | | | | |
| Nikko AM ARK Disruptive Innovation Fund | LU1861556378 | | | 291,465,304.73 | 212,280,005.78 | 97.77 |
| จำนวน 697,980.040000 หน่วย | | | | | | |
| มูลค่าหน่วยละ 8.3400 USD | | | | | | |
| รวมเป็นเงิน 5,821,153.53 USD | | | | | | |
| | | | | | 217,112,125.95 | 100.00 |

กองทุนเปิดกรุงศรี Disruptive Innovation

รายละเอียดการลงทุน ณ 30 กันยายน 2566

| | มูลค่าตามราคาตลาด | % NAV |
|--------------------------------------------------------------------|------------------------|---------------|
| หลักทรัพย์หรือทรัพย์สินในประเทศ | 7,157,075.44 | 3.44 |
| เงินฝากธนาคาร | | |
| TRIS | | |
| Rate A | 1,987.13 | 0.00 |
| S&P | | |
| Rate A- | 2,318,546.06 | 1.11 |
| FITCH_TH-LONG | | |
| Rate AAA | 4,836,542.25 | 2.33 |
| หลักทรัพย์หรือทรัพย์สินต่างประเทศ | 212,280,094.39 | 102.05 |
| หน่วยลงทุน | | |
| ไม่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ | 212,280,005.78 | 102.05 |
| เงินฝากธนาคาร | | |
| S&P | | |
| Rate A- | 88.61 | 0.00 |
| สัญญาซื้อขายล่วงหน้า | (10,440,245.33) | (5.02) |
| สัญญาที่อ้างอิงกับอัตราแลกเปลี่ยน-สัญญาแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ | | |
| TRIS | | |
| Rate A+ | (2,362,970.50) | (1.14) |
| FITCH-LONG | | |
| Rate AA | (7,369,481.15) | (3.54) |
| Rate AA- | (707,793.68) | (0.34) |
| อื่นๆ | (977,998.55) | (0.47) |
| ลูกหนี้ | 6,404.02 | 0.00 |
| เจ้าหนี้ | (705,731.71) | (0.34) |
| ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย | (278,670.86) | (0.13) |
| มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ | 208,018,925.95 | 100.00 |

กองทุนเปิดกรุงศรี Disruptive Innovation

รายละเอียดการลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ณ 30 กันยายน 2566

| ประเภทสัญญา | คู่สัญญา | วัตถุประสงค์ | มูลค่าสัญญา (Notional Amount) | % NAV | วันครบกำหนด | กำไร/ขาดทุน (net gain/loss) |
|-----------------------------------|----------------------|-------------------|----------------------------------|----------|--------------|--------------------------------|
| สัญญาที่อ้างอิงกับอัตราแลกเปลี่ยน | | | | | | |
| สัญญาฟอว์เวิร์ด | บมจ.ธ.กรุงศรีอยุธยา | ป้องกันความเสี่ยง | 8,480,334.00 | 0.0540 | 8 ธ.ค. 2566 | 112,373.31 |
| สัญญาฟอว์เวิร์ด | บมจ.ธ.กรุงศรีอยุธยา | ป้องกันความเสี่ยง | 17,061,660.00 | (0.3943) | 12 ม.ค. 2567 | (820,166.99) |
| สัญญาฟอว์เวิร์ด | บมจ.ธ.กสิกรไทย | ป้องกันความเสี่ยง | 18,616,500.00 | (0.5106) | 6 ต.ค. 2566 | (1,062,234.00) |
| สัญญาฟอว์เวิร์ด | บมจ.ธ.กสิกรไทย | ป้องกันความเสี่ยง | 7,112,970.00 | (0.1544) | 6 ต.ค. 2566 | (321,261.44) |
| สัญญาฟอว์เวิร์ด | บมจ.ธ.กสิกรไทย | ป้องกันความเสี่ยง | 31,098,837.30 | (0.7694) | 27 ต.ค. 2566 | (1,600,443.85) |
| สัญญาฟอว์เวิร์ด | บมจ.ธ.กสิกรไทย | ป้องกันความเสี่ยง | 12,786,647.00 | (0.2580) | 17 พ.ย. 2566 | (536,784.84) |
| สัญญาฟอว์เวิร์ด | บมจ.ธ.กสิกรไทย | ป้องกันความเสี่ยง | 13,027,766.00 | 0.1425 | 17 พ.ย. 2566 | 296,408.28 |
| สัญญาฟอว์เวิร์ด | บมจ.ธ.กสิกรไทย | ป้องกันความเสี่ยง | 46,302,473.00 | (1.4800) | 8 ธ.ค. 2566 | (3,078,726.68) |
| สัญญาฟอว์เวิร์ด | บมจ.ธ.กสิกรไทย | ป้องกันความเสี่ยง | 22,067,752.00 | (0.2366) | 2 ก.พ. 2567 | (492,107.99) |
| สัญญาฟอว์เวิร์ด | บมจ.ธนาคารไทยพาณิชย์ | ป้องกันความเสี่ยง | 8,066,176.50 | (0.2761) | 6 ต.ค. 2566 | (574,330.63) |
| สัญญาฟอว์เวิร์ด | บมจ.ธ.ทหารไทยธนชาติ | ป้องกันความเสี่ยง | 5,828,960.00 | (0.1773) | 6 ต.ค. 2566 | (368,872.12) |
| สัญญาฟอว์เวิร์ด | บมจ.ธ.ทหารไทยธนชาติ | ป้องกันความเสี่ยง | 7,023,108.00 | 0.1992 | 6 ต.ค. 2566 | 414,290.54 |
| สัญญาฟอว์เวิร์ด | บมจ.ธ.ทหารไทยธนชาติ | ป้องกันความเสี่ยง | 7,733,985.00 | (0.1203) | 6 ต.ค. 2566 | (250,281.08) |
| สัญญาฟอว์เวิร์ด | บมจ.ธ.ทหารไทยธนชาติ | ป้องกันความเสี่ยง | 8,359,336.00 | (0.3124) | 17 พ.ย. 2566 | (649,768.43) |
| สัญญาฟอว์เวิร์ด | บมจ.ธ.ทหารไทยธนชาติ | ป้องกันความเสี่ยง | 17,761,481.00 | (0.6648) | 17 พ.ย. 2566 | (1,382,865.92) |
| สัญญาฟอว์เวิร์ด | บมจ.ธ.ทหารไทยธนชาติ | ป้องกันความเสี่ยง | 11,833,581.00 | (0.0603) | 12 ม.ค. 2567 | (125,473.49) |

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 | ผู้ออกตราสารหนี้มีสถานะทั้งด้านการตลาดและการเงินที่แข็งแกร่งในระดับดี และมีความสามารถในการชำระหนี้ระยะสั้นในระดับที่น่าพอใจ |
| P-3 | A-3 | T3 | F3 | ผู้ออกตราสารหนี้มีความสามารถในการชำระหนี้ระยะสั้นในระดับที่ยอมรับได้ |
| | B | T4 | B | มีความสามารถในการชำระหนี้ระยะสั้นที่ค่อนข้างอ่อนแอ ผู้ออกแสดงถึงความไม่แน่นอนอย่างสูงของความสามารถในการชำระหนี้ได้ตรงตามกำหนดเวลาที่ระบุไว้ |
| | C | | C | |
| | D | D | D | เป็นระดับที่อยู่ในสภาวะผิดนัดชำระหนี้ โดยผู้ออกตราสารหนี้ไม่สามารถชำระดอกเบี้ยและคืนเงินต้นได้ตามกำหนด |

หมายเหตุ

- เครื่องหมายบวก (+) หรือ ลบ (-) หรือเลข 1 ถึง 3 ต่อท้ายนั้น เพื่อจำแนกความแตกต่างของคุณภาพของอันดับเครดิตภายในระดับเดียวกัน
- คำเสริมท้าย (tha) จะระบุไว้ต่อจากอันดับเครดิตเพื่อบอกถึงอันดับเครดิตภายในประเทศสำหรับประเทศไทย

ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (Fund's Direct Expenses)

กองทุนเปิดกรุงศรี Disruptive Innovation

ตั้งแต่วันที่ 1 เมษายน 2566 ถึงวันที่ 30 กันยายน 2566

| ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (Fund's Direct Expenses) | จำนวนเงิน (หน่วย: พันบาท) | ร้อยละของมูลค่า ทรัพย์สิน* (ต่อปี) 1/ |
|----------------------------------------------------------------|------------------------------|------------------------------------------|
| ค่าธรรมเนียมการจัดการ (Management Fee) | 1,173.56 | 1.3375 |
| ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ (Trustee Fee) | 28.17 | 0.0321 |
| ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน (Registrar Fee) | 140.83 | 0.1605 |
| ค่าที่ปรึกษาการลงทุน (Advisory Fee) | - | - |
| ค่าธรรมเนียมสอบบัญชี (Auditing Fee) | 25.67 | 0.0292 |
| ค่าใช้จ่ายอื่น ๆ (Others) | - | - |
| รวมค่าใช้จ่ายทั้งหมด 2/ | 1,368.23 | 1.5593 |

หมายเหตุ

1/ ค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวมข้างต้น เป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่มหรือภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว

2/ ไม่รวมค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ และค่าธรรมเนียมต่าง ๆ ที่เกิดขึ้นจากการซื้อขายหลักทรัพย์

* มูลค่าทรัพย์สิน ในที่นี้ หมายถึง มูลค่าทรัพย์สินทั้งหมด หักด้วย มูลค่าหนี้สินทั้งหมด

เว้นแต่ค่าธรรมเนียมการจัดการ ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ และค่าธรรมเนียมนายทะเบียนหน่วยลงทุน ณ วันที่คำนวณ

ผลการดำเนินงานของกองทุนเปิดกรุงศรี Disruptive Innovation-สะสมมูลค่า

| ผลการดำเนินงาน สิ้นสุด ณ วันที่ 29 กันยายน 2566 | % ตามช่วงเวลา | | | % ต่อปี | | | | นับจากวันเริ่ม โครงการ (1 เมษายน 2564) |
|-------------------------------------------------------|-----------------|---------------------|---------------------|------------------|------------------|------------------|-------------------|----------------------------------------------|
| | Year to Date | ย้อนหลัง 3 เดือน | ย้อนหลัง 6 เดือน | ย้อนหลัง 1 ปี | ย้อนหลัง 3 ปี | ย้อนหลัง 5 ปี | ย้อนหลัง 10 ปี | |
| KFINNO-A | +19.86% | -11.27% | -2.95% | +0.21% | N/A | N/A | N/A | -37.76% |
| ดัชนีชี้วัด (Benchmark)* | +28.51% | -10.42% | -1.07% | +8.34% | N/A | N/A | N/A | -34.03% |
| ความผันผวนของผลการดำเนินงาน | +38.82% | +37.35% | +35.25% | +43.91% | N/A | N/A | N/A | +50.44% |
| ความผันผวนของดัชนีชี้วัด | +39.21% | +35.71% | +33.78% | +45.17% | N/A | N/A | N/A | +51.51% |

หมายเหตุ : * ดัชนีชี้วัด (Benchmark) คือ

ผลการดำเนินงานของกองทุนหลัก สัดส่วน 100.00% ปรับด้วยต้นทุนการป้องกันความเสี่ยงด้านอัตราแลกเปลี่ยน เพื่อเทียบกับค่าสกุลเงินบาท ณ วันที่คำนวณผลตอบแทน

** ผลตอบแทนที่มีอายุเกินหนึ่งปีจะแสดงผลตอบแทนต่อปี

เอกสารการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวมฉบับนี้ ได้จัดทำตามมาตรฐานการวัดผลดำเนินงานของ
กองทุนรวมของสมาคมบริษัทจัดการลงทุน

ผลการดำเนินงานของกองทุนเปิดกรุงศรี Disruptive Innovation-ผู้ลงทุนสถาบัน

| ผลการดำเนินงาน สิ้นสุด ณ วันที่ 29 กันยายน 2566 | % ตามช่วงเวลา | | | % ต่อปี | | | | นับจากวันเริ่ม โครงการ (2 พฤศจิกายน 2564) |
|-------------------------------------------------------|-----------------|---------------------|---------------------|------------------|------------------|------------------|-------------------|----------------------------------------------------|
| | Year to Date | ย้อนหลัง 3 เดือน | ย้อนหลัง 6 เดือน | ย้อนหลัง 1 ปี | ย้อนหลัง 3 ปี | ย้อนหลัง 5 ปี | ย้อนหลัง 10 ปี | |
| KFINNO-I | +19.89% | -11.26% | -2.93% | N/A | N/A | N/A | N/A | +4.66% |
| ดัชนีชี้วัด (Benchmark)* | +28.51% | -10.42% | -1.07% | N/A | N/A | N/A | N/A | +11.20% |
| ความผันผวนของผลการดำเนินงาน | +38.82% | +37.20% | +35.17% | N/A | N/A | N/A | N/A | +40.21% |
| ความผันผวนของดัชนีชี้วัด | +39.21% | +35.71% | +33.78% | N/A | N/A | N/A | N/A | +40.37% |

หมายเหตุ : * ดัชนีชี้วัด (Benchmark) คือ

ผลการดำเนินงานของกองทุนหลัก สัดส่วน 100.00% ปรับด้วยต้นทุนการป้องกันความเสี่ยงด้านอัตราแลกเปลี่ยน เพื่อเทียบกับค่าสกุลเงินบาท ณ วันที่คำนวณผลตอบแทน

** ผลตอบแทนที่มีอายุเกินหนึ่งปีจะแสดงเป็นผลตอบแทนต่อปี

เอกสารการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวมฉบับนี้ ได้จัดทำตามมาตรฐานการวัดผลดำเนินงานของ
กองทุนรวมของสมาคมบริษัทจัดการลงทุน

ข้อมูลอื่นๆ ที่ผู้ถือหน่วยลงทุนควรทราบ

(1) รายงานบุคคลที่เกี่ยวข้องที่มีการทำธุรกรรมในรอบเวลาที่ผ่านมา (วันที่ 1 เมษายน 2566 ถึงวันที่ 30 กันยายน 2566)

| ชื่อกองทุน | รายชื่อบุคคลที่เกี่ยวข้อง |
|-----------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------|
| กองทุนเปิดกรุงศรี Disruptive Innovation | 1. ธนาคารกรุงศรีอยุธยา จำกัด (มหาชน) 2. บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด |

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

(2) รายชื่อผู้จัดการกองทุน ณ วันที่ 30 กันยายน 2566

1. นายทลิต โชคติพย์พัฒนา
2. นายสาธิต บัวชู
3. นางสาวสาวินี สุขศรีวงศ์
4. นายปีติ ประดิพัทธ์พงษ์
5. นายกวิพ เจริญเสาวภาคย์
6. นายจาตุรันต์ สอนไ
7. นายชูศักดิ์ อวยพรชัยสกุล
8. นายพงศ์ศักดิ์ อนุรัตน์
9. นางสาววรรดา ตันติสุนทร
10. นายวัชรินทร์ ค้วงสังข์

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

ไม่มีการถือหน่วยลงทุนเกิน 1 ใน 3 ของบุคคลใดบุคคลหนึ่ง

ผู้ถือหน่วยลงทุนสามารถตรวจสอบข้อมูลสัดส่วนการถือหน่วยลงทุน โดยตรงได้ที่ www.krungsriasset.com

(4) อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุนของกองทุน (portfolio turnover ratio) ในรอบระยะเวลาที่ผ่านมา

- KFINNO-A (portfolio turnover ratio) เท่ากับ 48.17%
- KFINNO-I (portfolio turnover ratio) เท่ากับ 48.17%

(5) ผลการดำเนินงานของกองทุนหลัก และ ข้อมูลการลงทุน (ข้อมูล ณ วันที่ 30/09/2023)

Net Performance Returns

A USD inception date is 29 August 2018.

| | | 1Mth | 3Mth | 6Mth | 1Yr | 3Yr | 5Yr | SI |
|-------------|-----------|--------|---------|--------|--------|---------|--------|--------|
| Class A USD | Fund | -9.89% | -10.50% | -1.08% | 8.31% | -23.57% | -2.97% | -3.51% |
| | Benchmark | -4.31% | -3.46% | 3.13% | 21.95% | 8.08% | 7.26% | 7.10% |

12 Month Performance Periods

| | | From: 30 Sep 2022 To: 29 Sep 2023 | 30 Sep 2021 | 30 Sep 2020 | 30 Sep 2019 | 28 Sep 2018 |
|-------------|-----------|--------------------------------------|-------------|-------------|-------------|-------------|
| Class A USD | Fund | 8.31% | -66.26% | 22.17% | 107.91% | -7.33% |
| | Benchmark | 21.95% | -19.63% | 28.82% | 10.41% | 1.83% |

Fund Holdings

| Top 10 Holdings | Weight |
|-------------------------------|--------|
| Tesla Motors, Inc. | 8.58% |
| Roku Inc | 8.17% |
| Zoom Video Communications Inc | 7.96% |
| Coinbase Global Inc | 6.70% |
| Uipath Inc | 4.64% |
| Block, Inc | 4.56% |
| Draftkings Inc | 4.52% |
| Twilio, Inc. Class A | 3.93% |
| Unity Software Inc | 3.62% |
| Roblox Corp | 3.51% |

Sector Allocation

