



krungsri

Asset  
Management

Make Life  
Simple

A member of  MUFG  
a global financial group

# รายงานประจำปีครั้งแรก 2567

รอบระยะเวลาตั้งแต่วันที่ 1 มีนาคม 2567 – 31 สิงหาคม 2567

กองทุนรวม

KFJPINDX

กองทุนเปิดกรุงศรีเจแปนเอควิตี้อินเด็กซ์เฮดจ์เอฟเอ็กซ์

Krungsri Japan Equity Index Hedged FX Fund

กองทุนนี้มีการแบ่งชนิดหน่วยลงทุนเป็น 2 ชนิด ได้แก่

1. หน่วยลงทุนชนิดสะสมมูลค่า :

กองทุนเปิดกรุงศรีเจแปนเอควิตี้อินเด็กซ์เฮดจ์เอฟเอ็กซ์-สะสมมูลค่า (ชื่อย่อ : KFJPINDX-A)

2. หน่วยลงทุนชนิดผู้ลงทุนสถาบัน :

กองทุนเปิดกรุงศรีเจแปนเอควิตี้อินเด็กซ์เฮดจ์เอฟเอ็กซ์-ผู้ลงทุนสถาบัน (ชื่อย่อ : KFJPINDX-I)

**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  
อาคารเพลลิจิตทาวเวอร์ 898 ถนนเพลลิจิต แขวงลุมพินี  
เขตปทุมวัน กรุงเทพฯ 10330  
โทรศัพท์ +66 (0) 2657 5757 โทรสาร +66 (0) 2657 5777  
www.krungsriasset.com

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด

## รายงานประจำปีครั้งแรก 2567

### กองทุนเปิดกรุงศรีเจแปนอิควิตี้อินเด็กซ์เฮดจ์เอฟเอ็กซ์

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

## สารบริษัทจัดการ

เรียน ผู้ถือหน่วยลงทุน

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด (บริษัทฯ) ขอนำเสนอรายงานสำหรับรอบระยะเวลา 6 เดือน ของกองทุนเปิดกรุงศรี เจแปนอิควิตี้อินเด็กซ์เฮดจ์เอฟเอ็กซ์ (KFJPIDX) ตั้งแต่วันที่ 1 มีนาคม 2567 ถึงวันที่ 31 สิงหาคม 2567 มายังผู้ถือหน่วยลงทุน โดยมีรายละเอียดดังนี้

### ผลการดำเนินงาน

กองทุนเปิดกรุงศรีเจแปนอิควิตี้อินเด็กซ์เฮดจ์เอฟเอ็กซ์ มีมูลค่าทรัพย์สินสุทธิ ณ วันที่ 31 สิงหาคม 2567 ซึ่งแบ่งตามชนิดหน่วยลงทุน ดังนี้

- KFJPIDX-A จำนวน 359.85 ล้านบาท คิดเป็นมูลค่าทรัพย์สินสุทธิต่อหน่วยลงทุน 20.4019 บาท

- KFJPIDX-I จำนวน 869.54 บาท คิดเป็นมูลค่าทรัพย์สินสุทธิต่อหน่วยลงทุน 25.5989 บาท

และมีผลการดำเนินงานย้อนหลัง 6 เดือน โดยแบ่งตามชนิดหน่วยลงทุน ได้แก่

- KFJPIDX-A ลดลงร้อยละ 0.05 ลดลงน้อยกว่าเกณฑ์มาตรฐานการวัดผลการดำเนินงาน ที่ลดลงร้อยละ 0.75

- KFJPIDX-I เพิ่มขึ้นร้อยละ 5.62 เพิ่มขึ้นมากกว่าเกณฑ์มาตรฐานการวัดผลการดำเนินงาน ที่ลดลงร้อยละ 0.75

### ภาวะการลงทุนในช่วงที่ผ่านมา

ในรอบครึ่งปีบัญชีที่ผ่านมา NEXT FUNDS Nikkei 225 Exchange Traded Fund (กองทุนหลัก) ปรับตัวลดลง 4% โดยตลาดญี่ปุ่นมีความผันผวนมากขึ้น ทั้งนี้ ในช่วงต้นปี 2567 ตลาดญี่ปุ่นยังคงสามารถปรับตัวขึ้นได้ต่อเนื่องหลังตลาดหลักทรัพย์โตเกียว (Tokyo Stock Exchange) มีการประกาศมาตรการใหม่เกี่ยวกับบรรษัทภิบาล (Corporate Governance) ส่งผลให้บริษัทจดทะเบียนญี่ปุ่นหันมาเพิ่มอัตราปันผลคืนให้นักลงทุนและมีการเพิ่มการทำ Shares Buyback อย่างไรก็ดี ตลาดญี่ปุ่นปรับตัวลงรุนแรงในช่วงเดือนสิงหาคม 2567 หลังเงินเยนปรับแข็งค่าขึ้นอย่างรวดเร็วและมีการ Unwind Carry Trade ของนักลงทุน โดยในช่วงที่ผ่านมา ทางธนาคารกลางญี่ปุ่น (BOJ) ได้เปลี่ยนการดำเนินนโยบายการเงินให้เข้มงวดขึ้น ผ่านการขึ้นอัตราดอกเบี้ยนโยบาย หลังจากภาพเงินเฟ้อและค่าจ้างแรงงานสามารถปรับตัวขึ้นมาได้ตามเป้าหมาย โดยการดำเนินนโยบายการเงินที่เข้มงวดขึ้นของ BOJ ส่งผลให้ตลาดญี่ปุ่นและทิศทางค่าเงินเยนมีความผันผวนมากขึ้น ซึ่งเงินเยนที่แข็งค่าขึ้นมาอาจกดดันตลาดญี่ปุ่นได้ต่อเนื่อง

ณ สิ้นเดือนกรกฎาคม 2567 กองทุนหลักมีการลงทุนในหมวดเครื่องใช้ไฟฟ้า 26.3% หมวด Retail Trade 12.7% หมวด Information and Communication 10.3% และหมวดเคมีภัณฑ์ 6.7% เป็นต้น

### แนวโน้มการลงทุน

การลงทุนในตลาดญี่ปุ่นมีทิศทางดีขึ้น โดยการฟื้นตัวของค่าจ้างแรงงานและการบริโภคที่ขยายตัวต่อเนื่อง ส่งผลให้เศรษฐกิจญี่ปุ่นสามารถหลุดจากภาวะเงินฝืดได้ นอกจากนี้ ยังเห็นเม็ดเงินลงทุนจากนักลงทุนต่างชาติเข้ามาในญี่ปุ่นอย่างต่อเนื่อง โดยเศรษฐกิจญี่ปุ่นสามารถฟื้นตัวได้ต่อเนื่องโดยเฉพาะในฝั่งภาคบริการและการบริโภค ด้านรายได้บริษัทจดทะเบียนที่ญี่ปุ่นยังคงมีแนวโน้มขยายตัว อย่างไรก็ตาม ความผันผวนในตลาดญี่ปุ่นจะยังคงอยู่จากความเสี่ยงเรื่องการปรับการดำเนินนโยบายการเงินของ BOJ ให้เข้มงวดขึ้นในปี 2567

บริษัทฯ ใคร่ขอขอบพระคุณท่านผู้ถือหน่วยลงทุนที่ได้มอบความไว้วางใจให้บริษัทฯ เป็นผู้บริหารเงินลงทุนของท่าน ทั้งนี้ บริษัทฯ จะพิจารณาดำเนินนโยบายการลงทุนที่เหมาะสมกับสถานการณ์ด้วยความระมัดระวัง และคำนึงถึงผลประโยชน์สูงสุดของผู้ถือหน่วยลงทุนเป็นสำคัญ

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด



## รายงานของผู้ดูแลผลประโยชน์

เรียน ผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุน  
กองทุนเปิดกรุงศรีเจแปนอควิตี้อินเด็กซ์เฮดจ์เอฟเอ็กซ์

ตามที่ธนาคารสแตนดาร์ดชาร์เตอร์ด (ไทย) จำกัด (มหาชน) (“ธนาคาร”) ในฐานะผู้ดูแลผลประโยชน์ กองทุนเปิดกรุงศรีเจแปนอควิตี้อินเด็กซ์เฮดจ์เอฟเอ็กซ์ (“กองทุน”) ได้ปฏิบัติหน้าที่เป็นผู้ดูแลผลประโยชน์ของกองทุน ซึ่งบริหารและจัดการโดยบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด สำหรับรอบระยะเวลาตั้งแต่วันที่ 1 มีนาคม 2567 ถึง วันที่ 31 สิงหาคม 2567

ธนาคาร เห็นว่าสำหรับรอบระยะเวลาดังกล่าว บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด ได้บริหารจัดการกองทุนโดยในสาระสำคัญเป็นไปตามโครงการจัดการกองทุน ซึ่งได้รับอนุมัติจากสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ตลอดจนข้อผูกพันที่ทำไว้กับผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุนภายใต้พระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535

ธนาคารสแตนดาร์ดชาร์เตอร์ด (ไทย) จำกัด (มหาชน)

(นางสาวกัลยวีร์ สัจจะสุวรรณ)

ผู้ช่วยผู้อำนวยการบริการกองทุน

ฝ่ายปฏิบัติการบริการหลักทรัพย์สายงานพัฒนาและปฏิรูป เทคโนโลยี และปฏิบัติการ

ธนาคารสแตนดาร์ดชาร์เตอร์ด (ไทย) จำกัด (มหาชน)

10 กันยายน 2567

โทรศัพท์ 02-106-1468

กรุณาติดต่อ คุณอัญชลี บางพันธ์ *at*

ธนาคารสแตนดาร์ดชาร์เตอร์ด (ไทย) จำกัด (มหาชน)  
140 ถนนวิทญู แขวงลุมพินี เขตปทุมวัน กรุงเทพมหานคร 10330  
ทะเบียนเลขที่ 0107536000498

sc.com/th

Standard Chartered Bank (Thai) Public Company Limited  
140 Wireless Road, Lumpini, Patumwan, Bangkok 10330  
Registration No. 0107536000498

sc.com/th

กองทุนเปิดกรุงศรีเจแปนอิควิตี้อินเด็กซ์เสดจ์เอฟเอ็กซ์

งบแสดงฐานะการเงิน

ณ 31 สิงหาคม 2567

	Unaudited (บาท)
สินทรัพย์	
เงินลงทุนตามราคายุติธรรม (ราคาทุน 347,484,614.90 บาท)	358,530,184.30
เงินฝากธนาคาร	3,629,809.80
ลูกหนี้จากสัญญาอนุพันธ์	4,196,153.88
ลูกหนี้	
จากดอกเบี้ย	21,368.57
จากการขายหน่วยลงทุน	826,508.48
รวมสินทรัพย์	<u>367,204,025.03</u>
หนี้สิน	
เจ้าหนี้จากสัญญาอนุพันธ์	4,899,096.05
เจ้าหนี้	
จากการรับซื้อคืนหน่วยลงทุน	2,032,602.47
ค่าธรรมเนียมสับเปลี่ยนหน่วยลงทุน	80,797.62
ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย	332,249.49
ภาษีเงินได้ค้างจ่าย	3,205.29
หนี้สินอื่น	10,089.34
รวมหนี้สิน	<u>7,358,040.26</u>
สินทรัพย์สุทธิ	<u>359,845,984.77</u>
สินทรัพย์สุทธิ:	
หน่วยลงทุนจดทะเบียน 300 ล้านหน่วย มูลค่าที่ตราไว้หน่วยละ 10 บาท	
ทุนที่ได้รับจากผู้ถือหน่วยลงทุน	176,378,579.49
กำไรสะสม	122,803,587.19
บัญชีปรับสมดุล	60,663,818.09
สินทรัพย์สุทธิ	<u>359,845,984.77</u>
ชนิดสะสมมูลค่า (KFJPINDEX-A)	
สินทรัพย์สุทธิ	359,845,115.23
หน่วยลงทุนที่ออกจำหน่ายแล้ว ณ วันสิ้นปี (หน่วย)	17,637,823.9809
สินทรัพย์สุทธิต่อหน่วย	20.4019
ชนิดผู้ลงทุนสถาบัน (KFJPINDEX-I)	
สินทรัพย์สุทธิ	869.54
หน่วยลงทุนที่ออกจำหน่ายแล้ว ณ วันสิ้นปี (หน่วย)	33.9678
สินทรัพย์สุทธิต่อหน่วย	25.5989

กองทุนเปิดกรุงศรีเจแปนอควิตี้อินเต็กซ์เฮดจ์เอฟเอ็กซ์  
งบกำไรขาดทุนเบ็ดเสร็จ  
สำหรับงวดบัญชีสิ้นสุดวันที่ 31 สิงหาคม 2567

	Unaudited (บาท)
รายได้จากการลงทุน	
รายได้ดอกเบี้ย	58,100.30
รายได้เงินปันผล	4,836,063.88
รวมรายได้	4,894,164.18
ค่าใช้จ่าย	
ค่าธรรมเนียมการจัดการ	1,402,104.31
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์	56,084.26
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน	280,420.78
ค่าธรรมเนียมวิชาชีพ	35,287.52
ค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์	225,768.46
รวมค่าใช้จ่าย	1,999,665.33
รายได้จากการลงทุนสุทธิ	2,894,498.85
รายการกำไร (ขาดทุน) สุทธิจากเงินลงทุน	
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิที่เกิดขึ้นจากเงินลงทุน	12,524,544.96
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิที่ยังไม่เกิดขึ้นจากเงินลงทุน	(17,077,885.17)
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิที่ยังไม่เกิดขึ้นจากสัญญาอนุพันธ์	(1,565,818.36)
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิจากอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ	4,748,497.62
รวมรายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิจากเงินลงทุนที่เกิดขึ้นและยัง ไม่เกิดขึ้น	(1,370,660.95)
หัก ภาษีเงินได้	(8,715.04)
การเพิ่มขึ้นในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงานหลังหักภาษีเงินได้	1,515,122.86
การเพิ่มขึ้นในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงานแยกตามชนิดหน่วยลงทุน มีดังนี้	
ชนิดสะสมมูลค่า (KFJPINDEX-A)	2,115,961.91
ชนิดผู้ลงทุนสถาบัน (KFJPINDEX-I)	(600,839.05)
รวม	1,515,122.86

กองทุนเปิดกรุงศรีเจแปนอิควิตีอินเด็กซ์เฮดจ์เอฟเอ็กซ์

งบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน

ณ 31 สิงหาคม 2567

การแสดงรายละเอียดเงินลงทุนใช้การจัดกลุ่มตามประเภทของเงินลงทุนและประเภทของอุตสาหกรรม

ประเภทเงินลงทุน/ผู้ออกตราสาร/ผู้ออกหลักทรัพย์	หมายเลขตราสาร	อัตรา ดอกเบี้ย (%)	วันครบอายุ	เงินต้น (บาท) / จำนวนหุ้น	มูลค่ายุติธรรม (บาท)	Unaudited ร้อยละของ มูลค่าเงิน ลงทุน
หลักทรัพย์ในประเทศ						
เงินฝากออมทรัพย์						1.71
บมจ.ธ.ทิสโก้		0.600000	เมื่อทวงถาม	26,317.42	26,317.42	0.01
บมจ.ธ.ยูโอบี		1.150000	เมื่อทวงถาม	6,082,887.96	6,082,887.96	1.70
หลักทรัพย์ต่างประเทศ						
หน่วยลงทุน						98.30
NEXT FUNDS Nikkei 225 Exchange						
Traded Fund	JP3027650005			341,375,409.52	352,420,978.92	98.30
จำนวน 37,890.000000 หน่วย						
มูลค่าหน่วยละ 39,780.0000 JPY						
รวมเป็นเงิน 1,507,264,200.00 JPY						
					358,530,184.30	100.00

# กองทุนเปิดกรุงศรีเจแปนอควิตี้อินเตอร์เนชั่นแนลเฮดจ์เอฟเอ็กซ์

รายละเอียดการลงทุน ณ 31 สิงหาคม 2567

	มูลค่าตามราคาตลาด	% NAV
<b>หลักทรัพย์หรือทรัพย์สินในประเทศ</b>	<b>9,760,383.75</b>	<b>2.72</b>
เงินฝากธนาคาร		
TRIS		
Rate A	26,346.66	0.01
FITCH-LONG		
Rate A-	3,630,161.21	1.01
FITCH_TH-LONG		
Rate AAA	6,103,875.88	1.70
<b>หลักทรัพย์หรือทรัพย์สินต่างประเทศ</b>	<b>352,420,978.92</b>	<b>97.94</b>
หน่วยลงทุน		
จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์	352,420,978.92	97.94
<b>สัญญาซื้อขายล่วงหน้า</b>	<b>(702,942.17)</b>	<b>(0.20)</b>
สัญญาที่อ้างอิงกับอัตราแลกเปลี่ยน-สัญญาแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ		
TRIS		
Rate A	(970,082.00)	(0.27)
FITCH-LONG		
Rate AA	928,139.83	0.26
Rate AA-	(888,790.90)	(0.25)
FITCH_TH-LONG		
Rate AA-	227,790.90	0.06
<b>อื่นๆ</b>	<b>(1,632,435.73)</b>	<b>(0.46)</b>
ลูกหนี้	826,508.48	0.23
เจ้าหนี้	(2,126,694.72)	(0.60)
ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย	(332,249.49)	(0.09)
<b>มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ</b>	<b>359,845,984.77</b>	<b>100.00</b>



# กองทุนเปิดกรุงศรีเจแปนอิกวิตีอินเด็กซ์เฮดจ์เอฟเอ็กซ์

รายละเอียดการลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ณ 31 สิงหาคม 2567

ประเภทสัญญา	คู่สัญญา	วัตถุประสงค์	มูลค่าสัญญา (Notional Amount)	% NAV	วันครบ กำหนด	กำไร/ขาดทุน (net gain/loss)
สัญญาที่อ้างอิงกับอัตราแลกเปลี่ยน						
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ท.กรุงศรีอยุธยา	ป้องกันความเสี่ยง	22,585,922.25	(0.2470)	17 ก.ย. 2567	(888,790.90)
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ท.ซีไอเอ็มบี ไทย	ป้องกันความเสี่ยง	20,131,062.97	0.0633	17 ม.ค. 2568	227,790.90
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ท.กสิกรไทย	ป้องกันความเสี่ยง	77,615,954.25	(0.0474)	3 ก.ย. 2567	(170,580.88)
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ท.กสิกรไทย	ป้องกันความเสี่ยง	7,774,730.82	0.0547	3 ก.ย. 2567	196,971.44
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ท.กสิกรไทย	ป้องกันความเสี่ยง	85,171,793.35	(0.0747)	3 ก.ย. 2567	(268,867.42)
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ท.กสิกรไทย	ป้องกันความเสี่ยง	39,107,005.26	(0.2907)	17 ก.ย. 2567	(1,046,032.63)
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ท.กสิกรไทย	ป้องกันความเสี่ยง	22,208,139.98	(0.3332)	17 ก.ย. 2567	(1,198,890.10)
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ท.กสิกรไทย	ป้องกันความเสี่ยง	9,068,064.00	(0.0204)	17 ก.ย. 2567	(73,466.69)
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ท.กสิกรไทย	ป้องกันความเสี่ยง	95,986,479.24	0.3816	24 ก.ย. 2567	1,373,168.81
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ท.กสิกรไทย	ป้องกันความเสี่ยง	86,712,006.47	0.4416	30 ก.ย. 2567	1,589,166.05
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ท.กสิกรไทย	ป้องกันความเสี่ยง	82,996,695.11	0.0502	17 ม.ค. 2568	180,801.57
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ท.เกียรตินาคินภัทร	ป้องกันความเสี่ยง	70,756,217.55	(0.2696)	17 ก.ย. 2567	(970,082.00)
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ธนาคารไทยพาณิชย์	ป้องกันความเสี่ยง	29,163,258.48	0.1746	17 ก.ย. 2567	628,255.11
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ธนาคารไทยพาณิชย์	ป้องกันความเสี่ยง	15,169,076.16	(0.0785)	24 ก.ย. 2567	(282,385.43)

คำอธิบายการจัดอันดับตราสารของสถาบันจัดอันดับความน่าเชื่อถือ

• ตราสารหนี้ระยะกลางและระยะยาว

Moody's	S&P	TRIS	Fitch	คำอธิบาย	
Aaa	AAA	AAA	AAA	ความน่าเชื่อถือสูงสุด และมีความเสี่ยงต่ำที่สุด	ระดับการลงทุน (investment grade)
Aa1	AA+	AA+	AA+	ความน่าเชื่อถือสูงมาก และมีความเสี่ยงต่ำมาก	
Aa2	AA	AA	AA		
Aa3	AA-	AA-	AA-		
A1	A+	A+	A+	ความน่าเชื่อถือสูง และมีความเสี่ยงต่ำ	
A2	A	A	A		
A3	A-	A-	A-		
Baa1	BBB+	BBB+	BBB+	ความน่าเชื่อถืออยู่ในเกณฑ์พอใช้	
Baa2	BBB	BBB	BBB		
Baa3	BBB-	BBB-	BBB-		
Ba1	BB+	BB+	BB+	ความน่าเชื่อถือต่ำกว่าระดับปานกลาง	ระดับเก็งกำไร (speculative grade)
Ba2	BB	BB	BB		
Ba3	BB-	BB-	BB-		
B1	B+	B+	B+	ความน่าเชื่อถืออยู่ในเกณฑ์ต่ำมาก	
B2	B	B	B		
B3	B-	B-	B-		
Caa1	CCC+	C+	CCC	มีความเสี่ยงในการผิดนัดชำระหนี้สูงที่สุด	
Caa2	CCC				
Caa3	CCC-				
Ca	CC	C	CC		
	C	C-	C		
C	SD	RD	RD	อยู่ในสภาวะผิดนัดชำระหนี้ โดยผู้ออกตราสารหนี้ไม่สามารถชำระดอกเบี้ยและคืนเงินต้นได้ตามกำหนด	
	D	D	D		

• ตราสารหนี้ระยะสั้น

Moody's	S&P	TRIS	Fitch	คำอธิบาย
P-1	A-1	T1	F1	ผู้ออกตราสารหนี้มีสถานะทั้งทางด้านการตลาดและการเงินที่แข็งแกร่งในระดับดีมาก มีสภาพคล่องที่ดีมาก และนักลงทุนจะได้รับความคุ้มครองจากการผิดนัดชำระหนี้ที่ต่ำกว่าอันดับเครดิตในระดับอื่น
P-2	A-2	T2	F2	ผู้ออกตราสารหนี้มีสถานะทั้งทางด้านการตลาดและการเงินที่แข็งแกร่งในระดับดี และมีความสามารถในการชำระหนี้ระยะสั้นในระดับที่น่าพอใจ
P-3	A-3	T3	F3	ผู้ออกตราสารหนี้มีความสามารถในการชำระหนี้ระยะสั้นในระดับที่ยอมรับได้
	B	T4	B	มีความสามารถในการชำระหนี้ระยะสั้นที่ค่อนข้างอ่อนแอ ผู้ออกแสดงถึงความไม่แน่นอนอย่างสูงของความสามารถในการชำระหนี้ได้ตรงตามกำหนดเวลาที่ระบุไว้
	C		C	
	D	D	D	เป็นระดับที่อยู่ในสภาวะผิดนัดชำระหนี้ โดยผู้ออกตราสารหนี้ไม่สามารถชำระดอกเบี้ยและคืนเงินต้นได้ตามกำหนด

หมายเหตุ

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

ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (Fund's Direct Expenses)

กองทุนเปิดกรุงศรีเจแปนอควิตี้อินเด็กซ์เฮดจ์เอฟเอ็กซ์

ตั้งแต่วันที่ 1 มีนาคม 2567 ถึงวันที่ 31 สิงหาคม 2567

ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (Fund's Direct Expenses)	จำนวนเงิน (หน่วย: พันบาท)	ร้อยละของมูลค่า ทรัพย์สิน* (ต่อปี) 1/
ค่าธรรมเนียมการจัดการ (Management Fee)	1,402.10	0.8025
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ (Trustee Fee)	56.08	0.0321
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน (Registrar Fee)	280.42	0.1605
ค่าที่ปรึกษาการลงทุน (Advisory Fee)	-	-
ค่าธรรมเนียมสอบบัญชี (Auditing Fee)	35.29	0.0202
ค่าใช้จ่ายอื่น ๆ (Others)	-	-
<b>รวมค่าใช้จ่ายทั้งหมด 2/</b>	<b>1,773.89</b>	<b>1.0153</b>

หมายเหตุ

1/ ค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวมข้างต้น เป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่มหรือภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว

2/ ไม่รวมค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ และค่าธรรมเนียมต่าง ๆ ที่เกิดขึ้นจากการซื้อขายหลักทรัพย์

\* มูลค่าทรัพย์สิน ในที่นี้ หมายถึง มูลค่าทรัพย์สินทั้งหมด หักด้วย มูลค่าหนี้สินทั้งหมด

เว้นแต่ค่าธรรมเนียมการจัดการ ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ ค่าธรรมเนียมนายทะเบียนหน่วยลงทุน

และค่าใช้จ่ายที่เกี่ยวข้องกับการปฏิบัติการกองทุน ณ วันที่คำนวณ

ค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์

กองทุนเปิดกรุงศรีเจแปนอิควิตี้อินเด็กซ์เฮดจ์เอฟเอ็กซ์ / Krungsri Japan Equity Index Hedged FX Fund

ตั้งแต่วันที่ 1 มีนาคม 2567 ถึงวันที่ 31 สิงหาคม 2567

บริษัท	จำนวนเงิน	อัตราส่วน
	(เยน)	(%)
Maybank Securities Pte. Ltd	936,009.00	65.04
Citigroup Global Markets Limited	503,229.00	34.96
<b>รวม / Total</b>	<b>1,439,238.00</b>	<b>100.00</b>

ผลการดำเนินงานของกองทุนเปิดกรุงศรีเจแปนอิควิตีอินเด็กซ์เฮดจ์เอฟเอ็กซ์-สะสมมูลค่า

ผลการดำเนินงาน สิ้นสุด ณ วันที่ 30 สิงหาคม 2567	% ตามช่วงเวลา			% ต่อปี				นับจากวันเริ่ม โครงการ (31 มีนาคม 2560)
	Year to Date	ย้อนหลัง 3 เดือน	ย้อนหลัง 6 เดือน	ย้อนหลัง 1 ปี	ย้อนหลัง 3 ปี	ย้อนหลัง 5 ปี	ย้อนหลัง 10 ปี	
KFJPINDEX-A	+16.48%	+0.56%	-0.05%	+20.87%	+12.23%	+12.98%	N/A	+10.08%
ดัชนีชี้วัด (Benchmark)*	+15.99%	+0.41%	-0.75%	+20.38%	+13.24%	+15.23%	N/A	+11.84%
ความผันผวนของผลการดำเนินงาน	+25.62%	+35.71%	+28.38%	+23.11%	+19.51%	+19.87%	N/A	+18.33%
ความผันผวนของดัชนีชี้วัด	+26.48%	+36.91%	+28.92%	+23.93%	+20.41%	+20.89%	N/A	+19.37%

หมายเหตุ : \* ดัชนีชี้วัด (Benchmark) คือ

ผลการดำเนินงานของกองทุนหลัก สัดส่วน 100.00% ปรับด้วยต้นทุนการป้องกันความเสี่ยงด้านอัตราแลกเปลี่ยน เพื่อเทียบกับค่าสกุลเงินบาท ณ วันที่คำนวณผลตอบแทน

\*\* ผลตอบแทนที่มีอายุเกินหนึ่งปีจะแสดงเป็นผลตอบแทนต่อปี

เอกสารการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวมฉบับนี้ ได้จัดทำตามมาตรฐานการวัดผลดำเนินงานของ  
กองทุนรวมของสมาคมบริษัทจัดการลงทุน

ผลการดำเนินงานของกองทุนเปิดกรุงศรีเจแปนอควิตี้อินเด็กซ์เฮดจ์เอฟเอ็กซ์-ผู้ลงทุนสถาบัน

ผลการดำเนินงาน สิ้นสุด ณ วันที่ 30 สิงหาคม 2567	% ตามช่วงเวลา			% ต่อปี				นับจากวันเริ่ม โครงการ (2 ธันวาคม 2564)
	Year to Date	ย้อนหลัง 3 เดือน	ย้อนหลัง 6 เดือน	ย้อนหลัง 1 ปี	ย้อนหลัง 3 ปี	ย้อนหลัง 5 ปี	ย้อนหลัง 10 ปี	
KFJPINDX-I	+27.91%	+6.25%	+5.62%	+51.47%	N/A	N/A	N/A	+36.77%
ดัชนีชี้วัด (Benchmark)*	+15.99%	+0.41%	-0.75%	+20.38%	N/A	N/A	N/A	+21.53%
ความผันผวนของผลการดำเนินงาน	+31.28%	+43.51%	+33.35%	+34.41%	N/A	N/A	N/A	+27.54%
ความผันผวนของดัชนีชี้วัด	+26.48%	+36.91%	+28.92%	+23.93%	N/A	N/A	N/A	+20.54%

หมายเหตุ : \* ดัชนีชี้วัด (Benchmark) คือ

ผลการดำเนินงานของกองทุนหลัก สัดส่วน 100.00% ปรับด้วยต้นทุนการป้องกันความเสี่ยงด้านอัตราแลกเปลี่ยน เพื่อเทียบกับค่าสกุลเงินบาท ณ วันที่คำนวณผลตอบแทน

\*\* ผลตอบแทนที่มีอายุเกินหนึ่งปีจะแสดงผลตอบแทนต่อปี

เอกสารการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวมฉบับนี้ ได้จัดทำตามมาตรฐานการวัดผลดำเนินงานของ  
กองทุนรวมของสมาคมบริษัทจัดการลงทุน

## ข้อมูลอื่นๆ ที่ผู้ถือหน่วยลงทุนควรทราบ

### (1) รายงานบุคคลที่เกี่ยวข้องที่มีการทำธุรกรรมในรอบเวลาที่ผ่านมา (วันที่ 1 มีนาคม 2567 ถึงวันที่ 31 สิงหาคม 2567)

ชื่อกองทุน	รายชื่อบุคคลที่เกี่ยวข้อง
กองทุนเปิดกรุงศรีเจแปนอภิวิตีอินเด็กซ์เสดจ์เอฟเอ็กซ์	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.ต. (<http://www.sec.or.th>)

### (2) รายชื่อผู้จัดการกองทุน ณ วันที่ 31 สิงหาคม 2567

- นายทลิต โชคทิพย์พัฒนา
- นายสาธิต บัวชู
- นางสาวสาวิณี สุขศรีวงศ์
- นายปิติ ประดิพัทธ์พงษ์
- นายกวิฬ เจริญเสาวภาคย์
- นายเอกชัย บุญยะพงศ์ไชย
- นายจาตุรันต์ สอนไฉ
- นายชูศักดิ์ อวยพรชัยสกุล
- นายพงศ์สันต์ อนุรัตน์
- นางสาววรรดา ตันติสุนทร
- นายวัชรินทร์ คิ้วสังข์

### (3) การเปิดเผยข้อมูลการถือหน่วยลงทุนเกิน 1 ใน 3 ณ วันที่ 31 สิงหาคม 2567

ไม่มีการถือหน่วยลงทุนเกิน 1 ใน 3 ของบุคคลใดบุคคลหนึ่ง

ผู้ถือหน่วยลงทุนสามารถตรวจสอบข้อมูลสัดส่วนการถือหน่วยลงทุนโดยตรงได้ที่ [www.krungsriasset.com](http://www.krungsriasset.com)

### (4) อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุนของกองทุน (portfolio turnover ratio) ในรอบระยะเวลาที่ผ่านมา

- KFJPINDX-A (portfolio turnover ratio) 0.60 เท่า
- KFJPINDX-I (portfolio turnover ratio) 0.60 เท่า

(5) ผลการดำเนินงานและข้อมูลการลงทุนของกองทุนหลัก (ข้อมูล ณ วันที่ 31/08/2024)

Return	1 month	3 months	6 months	1 year	3 years	Since Incep.
<b>NAV</b> (dividend re-invested)	-1.1%	0.6%	-0.5%	20.5%	45.4%	339.0%

(Since Inception 7/9/2001)

- NAV in the above chart refers to NAV Per Unit for the purpose of comparison with the benchmark index.
- Benchmark Index return is calculated without dividends.
- The price movement and return rate of the NAV (dividend re-invested) is calculated based on the Fund value after deduction of the management fee, and based on the assumption that the dividends before taxes are re-invested. Therefore, the actual performance of the Fund will vary depending upon the tax status of the investor. Also, expenses and taxes when liquidating the Fund are not considered.
- For each calculation period of the return rate, last business day of the month is used.

Top 10 Holdings		Sector	(% of NAV)	Number of Holdings : 225
9983	FAST RETAILING CO.,LTD.	RETAIL TRADE	11.6%	
8035	TOKYO ELECTRON LIMITED	ELECTRIC APPLIANCES	6.4%	
6857	ADVANTEST CORPORATION	ELECTRIC APPLIANCES	4.4%	
9984	SOFTBANK GROUP CORP.	INFORMATION & COMMUNICATION	4.2%	
4063	SHIN-ETSU CHEMICAL CO.,LTD.	CHEMICALS	2.7%	
6762	TDK CORPORATION	ELECTRIC APPLIANCES	2.5%	
9433	KDDI CORPORATION	INFORMATION & COMMUNICATION	2.4%	
6098	RECRUIT HOLDINGS CO.,LTD.	SERVICES	2.3%	
4519	CHUGAI PHARMACEUTICAL CO.,LTD.	PHARMACEUTICAL	1.8%	
4543	TERUMO CORPORATION	PRECISION INSTRUMENTS	1.8%	
Total			40.1%	

•Sector references are based on the TSE 33 Sector Classification.

### ■ Fund Composition

Sector Allocation	(% of NAV)	Asset Allocation	Portfolio Characteristics
ELECTRIC APPLIANCES	25.2%	Stocks	98.1%
RETAIL TRADE	14.3%	Call Loan, Others	1.9%
INFORMATION & COMMUNICATION	10.4%	(Index Futures)	1.8%
PHARMACEUTICAL	6.6%		
CHEMICALS	6.5%		
Others	35.1%		
Total	98.1%		

•The Fund's dividend yield is calculated based on the weighted average of individual dividend yields of the constituent stocks (before taxation, actual dividend basis).