



krungsri

Asset
Management

Make Life
Simple

A member of  MUFG
a global financial group

รายงานประจำครึ่งปีแรก 2566

รอบระยะเวลาตั้งแต่วันที่ 1 มีนาคม 2566 – 31 สิงหาคม 2566

กองทุนรวม

KFUSINDEX

กองทุนเปิดกรุงศรียูเอสอีควิตี้อินเด็กซ์เฮดจ์เอฟเอ็กซ์

Krungsri US Equity Index Hedged FX Fund

กองทุนนี้มีการแบ่งชนิดหน่วยลงทุนเป็น 2 ชนิด ได้แก่

1. หน่วยลงทุนชนิดสะสมมูลค่า :

กองทุนเปิดกรุงศรียูเอสอีควิตี้อินเด็กซ์เฮดจ์เอฟเอ็กซ์-สะสมมูลค่า (ชื่อย่อ : KFUSINDEX-A)

2. หน่วยลงทุนชนิดผู้ลงทุนสถาบัน :

กองทุนเปิดกรุงศรียูเอสอีควิตี้อินเด็กซ์เฮดจ์เอฟเอ็กซ์-ผู้ลงทุนสถาบัน (ชื่อย่อ : KFUSINDEX-I)

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

รายงานประจำปีแรก 2566

กองทุนเปิดกรุงศรียูเอเอสอิควิตีอินเด็กซ์เสดจ์เอฟเอ็กซ์

- สารบัญผู้จัดการ 3
- รายงานผู้ดูแลผลประโยชน์ 4
- งบแสดงฐานะการเงิน งบกำไรขาดทุนเบ็ดเสร็จ และงบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน 5
- รายละเอียดเงินลงทุน การกู้ยืมเงิน และการก่อภาระผูกพันของกองทุนรวม 8
- ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม 11
- คำนายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ 12
- ผลการดำเนินงาน 13
- ข้อมูลอื่นๆ ที่ผู้ถือหน่วยลงทุนควรทราบ 14
 - รายงานบุคคลที่เกี่ยวข้องที่มีการทำธุรกรรมในรอบเวลาที่ผ่านมา
 - รายชื่อผู้จัดการกองทุน
 - การเปิดเผยข้อมูลการถือหน่วยลงทุนเกิน 1 ใน 3
 - อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุนของกองทุน
 - ข้อมูลการลงทุน และผลการดำเนินงานของกองทุนหลัก

สารบริษัทจัดการ

เรียน ผู้ถือหน่วยลงทุน

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด (บริษัทฯ) ขอจัดส่งรายงานสำหรับรอบระยะเวลา 6 เดือน ของกองทุนเปิดกรุงศรียูเอสอีควิตี้ อินเด็กซ์เฮดจ์เอฟเอ็กซ์ (KFUSINDX) ตั้งแต่วันที่ 1 มีนาคม 2566 ถึงวันที่ 31 สิงหาคม 2566 มายังผู้ถือหน่วยลงทุน โดยมีรายละเอียด ดังนี้

ผลการดำเนินงาน

กองทุนเปิดกรุงศรียูเอสอีควิตี้ อินเด็กซ์เฮดจ์เอฟเอ็กซ์ มีมูลค่าทรัพย์สินสุทธิ ณ วันที่ 31 สิงหาคม 2566 ซึ่งแบ่งตามชนิดหน่วยลงทุน ดังนี้

- KFUSINDX-A จำนวน 859.29 ล้านบาท คิดเป็นมูลค่าทรัพย์สินสุทธิต่อหน่วยลงทุน 17.6886 บาท

- KFUSINDX-I จำนวน 27.83 ล้านบาท คิดเป็นมูลค่าทรัพย์สินสุทธิต่อหน่วยลงทุน 17.6897 บาท

และมีผลการดำเนินงานย้อนหลัง 6 เดือน โดยแบ่งตามชนิดหน่วยลงทุน ได้แก่

- KFUSINDX-A เพิ่มขึ้นร้อยละ 11.62 น้อยกว่าเกณฑ์มาตรฐานการวัดผลการดำเนินงาน ที่เพิ่มขึ้นร้อยละ 13.06

- KFUSINDX-I เพิ่มขึ้นร้อยละ 11.61 น้อยกว่าเกณฑ์มาตรฐานการวัดผลการดำเนินงาน ที่เพิ่มขึ้นร้อยละ 13.06

ภาวะการลงทุนในช่วงที่ผ่านมา

ในรอบครึ่งปีบัญชีที่ผ่านมา iShares Core S&P 500 ETF (กองทุนหลัก) ปรับตัวเพิ่มขึ้นประมาณ 14.2% โดยในช่วงต้นปี 2566 ตลาดสหรัฐฯ กลับมาฟื้นตัวได้ดีหลังจากตลาดคาดว่าธนาคารกลางสหรัฐฯ (Fed) จะมีการชะลอการขึ้นอัตราดอกเบี้ยนโยบายในปีนี เนื่องจากอัตราเงินเฟ้อมีทิศทางชะลอลงลง อีกทั้งตลาดสหรัฐฯ ยังได้แรงส่งจากราคาหุ้นของกลุ่ม Big Tech ที่ปรับเพิ่มขึ้นมาต่อเนื่องและแรงส่งจากหุ้นในกลุ่ม AI อย่างไรก็ตาม ตลาดสหรัฐฯ ยังคงมีความผันผวน โดยนักลงทุนกังวลว่าอัตราดอกเบี้ยนโยบายสหรัฐฯ จะยังคงอยู่ในระดับสูงนานกว่าที่เคียดคิดไว้ หลังจากภาพเศรษฐกิจของสหรัฐฯ ออกมาแข็งแกร่ง อีกทั้ง Fed ที่ยังคงให้มุมมองว่าอาจมีการขึ้นอัตราดอกเบี้ยนโยบายต่อไปปลายปี 2566 และลดโอกาสการลดอัตราดอกเบี้ยนโยบายในปีหน้าลง โดยประเด็นเรื่องอัตราดอกเบี้ยนโยบายที่ทรงตัวในระดับสูงอาจส่งผลกระทบต่อเศรษฐกิจสหรัฐฯ ในระยะยาว เนื่องจากบริษัทต้องเจอกับต้นทุนการกู้ยืมที่สูงขึ้น ซึ่งอาจทำให้เศรษฐกิจสหรัฐฯ เข้าสู่ภาวะถดถอยได้ในปีหน้า

ณ สิ้นเดือนมิถุนายน 2566 กองทุนหลักมีสัดส่วนการลงทุนหุ้นหมวดเทคโนโลยี 28.2% หมวด Healthcare 13.4% หมวดการเงิน 12.4% และหมวดสินค้าฟุ่มเฟือย 10.6% เป็นต้น

แนวโน้มการลงทุน

การลงทุนในตลาดสหรัฐฯ ยังคงมีความผันผวน จากแรงกดดันของอัตราดอกเบี้ยนโยบายที่มีแนวโน้มทรงตัวอยู่ในระดับสูงไปนานกว่าที่ตลาดคาด หลังจากตัวเลขเศรษฐกิจสหรัฐฯ ยังคงแข็งแกร่งและอัตราเงินเฟ้อปรับลดลงมาช้ากว่าที่หลายฝ่ายคาดการณ์ โดยอัตราดอกเบี้ยนโยบายที่ทรงตัวในระดับสูงอาจส่งผลกระทบต่อภาพเศรษฐกิจสหรัฐฯ ในระยะยาว เนื่องจากต้องเจอกับต้นทุนการกู้ยืมที่สูงขึ้น อย่างไรก็ตาม หาก Fed ส่งสัญญาณว่ามีโอกาสลดอัตราดอกเบี้ยนโยบายลงได้ในปีหน้าและเศรษฐกิจสหรัฐฯ ไม่ได้เข้าสู่ภาวะถดถอย อาจเป็นแรงส่งให้กับตลาดหุ้นสหรัฐฯ ต่อได้

บริษัทฯ ใคร่ขอขอบพระคุณท่านผู้ถือหน่วยลงทุนที่ได้มอบความไว้วางใจให้บริษัทฯ เป็นผู้บริหารเงินลงทุนของท่าน ทั้งนี้ บริษัทฯ จะพิจารณาดำเนินนโยบายการลงทุนที่เหมาะสมกับสถานการณ์ด้วยความระมัดระวัง และคำนึงถึงผลประโยชน์สูงสุดของผู้ถือหน่วยลงทุนเป็นสำคัญ

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด



รายงานของผู้ดูแลผลประโยชน์

เรียน ผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุน

กองทุนเปิดกรุงศรียูเอเอสไอควิตีอินเด็กซ์เฮดจ์เอฟเอ็กซ์

ตามที่ธนาคารสแตนดาร์ดชาร์เตอร์ด (ไทย) จำกัด (มหาชน) (“ธนาคารฯ”) ในฐานะผู้ดูแลผลประโยชน์ กองทุนเปิดกรุงศรียูเอเอสไอควิตีอินเด็กซ์เฮดจ์เอฟเอ็กซ์ (“กองทุน”) ได้ปฏิบัติหน้าที่เป็นผู้ดูแลผลประโยชน์ของกองทุน ซึ่งบริหารและจัดการโดยบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด สำหรับรอบระยะเวลาตั้งแต่ วันที่ 1 มีนาคม 2566 ถึง วันที่ 31 สิงหาคม 2566

ธนาคารฯ เห็นว่าสำหรับรอบระยะเวลาดังกล่าว บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด ได้บริหารจัดการกองทุนโดยในสาระสำคัญเป็นไปตามโครงการจัดการกองทุน ซึ่งได้รับอนุมัติจากสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ตลอดจนข้อมูลผูกพันที่ทำไว้กับผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุนภายใต้พระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535

ธนาคารสแตนดาร์ดชาร์เตอร์ด (ไทย) จำกัด (มหาชน)

(นางสาวนุชจรินทร์ เพชรปานีวงศ์)

ผู้อำนวยการ

ธนาคารสแตนดาร์ดชาร์เตอร์ด (ไทย) จำกัด (มหาชน)

8 กันยายน 2566

โทรศัพท์ 02-106-1160

กรุณาติดต่อ คุณสุทธานิชฐ์ ภาณุภณ *Sutthanit*

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

กองทุนเปิดกรุงศรียูเอสอิกวิตีอินเต็กซ์เฮดจ์เอฟเอ็กซ์

งบแสดงฐานะการเงิน

ณ 31 สิงหาคม 2566

	Unaudited (บาท)
สินทรัพย์	
เงินลงทุนตามราคายุติธรรม (ราคาทุน 810,541,129.79 บาท)	879,018,487.74
เงินฝากธนาคาร	13,662,130.89
ลูกหนี้จากสัญญาอนุพันธ์	3,853,704.19
ลูกหนี้	
จากดอกเบี้ย	23,291.85
จากการขายหน่วยลงทุน	7,616,321.74
รวมสินทรัพย์	<u>904,173,936.41</u>
หนี้สิน	
เจ้าหนี้จากสัญญาอนุพันธ์	13,014,346.83
เจ้าหนี้	
จากการรับซื้อคืนหน่วยลงทุน	3,170,686.27
ค่าธรรมเนียมสับเปลี่ยนหน่วยลงทุน	91,245.14
ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย	760,531.76
ภาษีเงินได้ค้างจ่าย	3,493.77
หนี้สินอื่น	21,675.00
รวมหนี้สิน	<u>17,061,978.77</u>
สินทรัพย์สุทธิ	<u>887,111,957.64</u>
สินทรัพย์สุทธิ:	
หน่วยลงทุนจดทะเบียน 300 ล้านหน่วย มูลค่าที่ตราไว้หน่วยละ 10 บาท	
ทุนที่ได้รับจากผู้ถือหน่วยลงทุน	501,515,021.54
กำไรสะสม	118,850,825.21
บัญชีปรับสมดุล	266,746,110.89
สินทรัพย์สุทธิ	<u>887,111,957.64</u>
ชนิดสะสมมูลค่า	
สินทรัพย์สุทธิ	859,285,936.70
หน่วยลงทุนที่ออกจำหน่ายแล้ว ณ วันสิ้นปี (หน่วย)	48,578,502.5855
สินทรัพย์สุทธิต่อหน่วย	17.6886
ชนิดผู้ลงทุนสถาบัน	
สินทรัพย์สุทธิ	27,826,020.94
หน่วยลงทุนที่ออกจำหน่ายแล้ว ณ วันสิ้นปี (หน่วย)	1,572,999.5684
สินทรัพย์สุทธิต่อหน่วย	17.6897

กองทุนเปิดกรุงศรียูเอสอิควิตี้อินเด็คส์เฮดจ์เอฟเอ็กซ์
งบกำไรขาดทุนเบ็ดเสร็จ
สำหรับงวดบัญชีสิ้นสุดวันที่ 31 สิงหาคม 2566

	Unaudited (บาท)
รายได้จากการลงทุน	
รายได้ดอกเบี้ย	59,162.80
รายได้เงินปันผล	5,196,334.31
รวมรายได้	5,255,497.11
ค่าใช้จ่าย	
ค่าธรรมเนียมการจัดการ	3,511,330.56
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์	140,453.20
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน	702,266.15
ค่าธรรมเนียมวิชาชีพ	35,191.54
ค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์	3,068.08
รวมค่าใช้จ่าย	4,392,309.53
รายได้จากการลงทุนสุทธิ	863,187.58
รายการกำไร (ขาดทุน) สุทธิจากเงินลงทุน	
รายการกำไร (ขาดทุน) สุทธิที่เกิดขึ้นจากเงินลงทุน	7,880,320.76
รายการกำไร (ขาดทุน) สุทธิที่ยังไม่เกิดขึ้นจากเงินลงทุน	104,989,728.42
รายการกำไร (ขาดทุน) สุทธิที่เกิดขึ้นจากสัญญาอนุพันธ์	(37,711,860.20)
รายการกำไร (ขาดทุน) สุทธิที่ยังไม่เกิดขึ้นจากสัญญาอนุพันธ์	30,640,228.69
รายการกำไร (ขาดทุน) สุทธิจากอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ	(10,494,553.92)
รวมรายการกำไร (ขาดทุน) สุทธิจากเงินลงทุนที่เกิดขึ้นและยังไม่มีเกิดขึ้น	95,303,863.75
หัก ภาษีเงินได้	(8,874.41)
การเพิ่มขึ้นในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงานหลังหักภาษีเงินได้	96,158,176.92
การเพิ่มขึ้นในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงานแยกตามชนิดหน่วยลงทุน มีดังนี้	
ชนิดสะสมมูลค่า	92,281,476.82
ชนิดผู้ลงทุนสถาบัน	3,876,700.10
รวม	96,158,176.92

กองทุนเปิดกรุงศรียูเอสอิกวิตีอินเค็ทซ์เฮดจ์เอฟเอ็ทซ์

งประกอบรายละเอียดเงินลงทุน

ณ 31 สิงหาคม 2566

การแสดงรายละเอียดเงินลงทุนใช้การจัดกลุ่มตามประเภทของเงินลงทุนและประเภทของอุตสาหกรรม

ประเภทเงินลงทุน/ผู้ออกตราสาร/ผู้ออกหลักทรัพย์	หมายเลขตราสาร	อัตรา ดอกเบี้ย (%)	วันครบอายุ	เงินต้น (บาท) / จำนวนหุ้น	มูลค่ายุติธรรม (บาท)	Unaudited ร้อยละของ มูลค่าเงิน ลงทุน
หลักทรัพย์ในประเทศ						
เงินฝากออมทรัพย์						
						1.84
บมจ.ธ.ทิสโก้		0.500000	เมื่อทวงถาม	190.31	190.31	0.00
บมจ.ธ.ยูโอบี		0.800000	เมื่อทวงถาม	16,149,618.60	16,149,618.60	1.84
หลักทรัพย์ต่างประเทศ						
หน่วยลงทุน						
iShares Core S&P 500 ETF	US4642872000			794,391,320.88	862,868,678.83	98.16
จำนวน 54,480.000000 หน่วย						
มูลค่าหน่วยละ 452.6900 USD						
รวมเป็นเงิน 24,662,551.20 USD						
					879,018,487.74	100.00

กองทุนเปิดกรุงศรียูเอสอิกวิตีอินเด็กซ์เฮดจ์เอฟเอ็กซ์

รายละเอียดการลงทุน ณ 31 สิงหาคม 2566

	มูลค่าตามราคาตลาด	% NAV
หลักทรัพย์หรือทรัพย์สินในประเทศ	29,835,231.65	3.36
เงินฝากธนาคาร		
TRIS		
Rate A	190.32	0.00
FITCH-LONG		
Rate A-	13,662,578.32	1.54
FITCH_TH-LONG		
Rate AAA	16,172,463.01	1.82
หลักทรัพย์หรือทรัพย์สินต่างประเทศ	862,868,678.83	97.27
หน่วยลงทุน		
จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์	862,868,678.83	97.27
สัญญาซื้อขายล่วงหน้า	(9,160,642.64)	(1.03)
สัญญาที่อ้างอิงกับอัตราแลกเปลี่ยน-สัญญาแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ		
TRIS		
Rate A+	108,496.58	0.01
FITCH-LONG		
Rate AA	(9,073,860.64)	(1.02)
Rate AA-	(195,278.58)	(0.02)
อื่นๆ	3,568,689.80	0.40
ลูกหนี้	20,616,321.74	2.32
เจ้าหนี้	(16,287,100.18)	(1.83)
ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย	(760,531.76)	(0.09)
มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ	887,111,957.64	100.00

กองทุนเปิดกรุงศรียูเอสเอคิวิตีอินเต็กซ์เฮดจ์เอฟเอ็กซ์

รายละเอียดการลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ณ 31 สิงหาคม 2566

ประเภทสัญญา	คู่สัญญา	วัตถุประสงค์	มูลค่าสัญญา (Notional Amount)	% NAV	วันครบกำหนด	กำไร/ขาดทุน (net gain/loss)
สัญญาที่อ้างอิงกับอัตราแลกเปลี่ยน						
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ท.กรุงศรีอยุธยา	ป้องกันความเสี่ยง	234,999,330.00	(0.0740)	1 ก.ย. 2566	(656,404.00)
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ท.กรุงศรีอยุธยา	ป้องกันความเสี่ยง	261,028,620.00	0.0520	19 ม.ค. 2567	461,125.42
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ท.กสิกรไทย	ป้องกันความเสี่ยง	240,626,175.00	0.2805	12 ต.ค. 2566	2,488,397.95
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ธนาคารไทยพาณิชย์	ป้องกันความเสี่ยง	18,514,471.00	0.0001	1 ก.ย. 2566	1,322.50
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ธนาคารไทยพาณิชย์	ป้องกันความเสี่ยง	249,280,911.00	(0.4143)	1 ก.ย. 2566	(3,674,929.50)
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ธนาคารไทยพาณิชย์	ป้องกันความเสี่ยง	222,659,676.00	(0.8032)	22 ก.ย. 2566	(7,125,524.11)
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ธนาคารไทยพาณิชย์	ป้องกันความเสี่ยง	119,525,770.00	(0.0602)	24 พ.ย. 2566	(534,164.18)
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ธนาคารไทยพาณิชย์	ป้องกันความเสี่ยง	16,720,712.50	(0.0258)	24 พ.ย. 2566	(228,963.30)
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ท.ทหารไทยชนชาติ	ป้องกันความเสี่ยง	26,697,582.00	0.0379	22 ก.ย. 2566	335,979.47
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ท.ทหารไทยชนชาติ	ป้องกันความเสี่ยง	30,423,358.00	0.0639	12 ต.ค. 2566	566,878.85
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ท.ทหารไทยชนชาติ	ป้องกันความเสี่ยง	54,201,312.00	(0.0895)	24 พ.ย. 2566	(794,361.74)

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)

กองทุนเปิดกรุงศรียูเอสบีซีอสังหาริมทรัพย์เฮดจ์เอฟเอ็กซ์

ตั้งแต่วันที่ 1 มีนาคม 2566 ถึงวันที่ 31 สิงหาคม 2566

ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (Fund's Direct Expenses)	จำนวนเงิน (หน่วย: พันบาท)	ร้อยละของมูลค่า ทรัพย์สิน* (ต่อปี) 1/
ค่าธรรมเนียมการจัดการ (Management Fee)	3,511.33	0.8025
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ (Trustee Fee)	140.45	0.0321
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน (Registrar Fee)	702.27	0.1605
ค่าที่ปรึกษาการลงทุน (Advisory Fee)	-	-
ค่าธรรมเนียมสอบบัญชี (Auditing Fee)	35.19	0.0080
ค่าใช้จ่ายอื่น ๆ (Others)	-	-
รวมค่าใช้จ่ายทั้งหมด 2/	4,389.24	1.0031

หมายเหตุ

1/ ค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวมข้างต้น เป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่มหรือภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว

2/ ไม่รวมค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ และค่าธรรมเนียมต่าง ๆ ที่เกิดขึ้นจากการซื้อขายหลักทรัพย์

* มูลค่าทรัพย์สิน ในที่นี้ หมายถึง มูลค่าทรัพย์สินทั้งหมด หักด้วย มูลค่าหนี้สินทั้งหมด

เว้นแต่ค่าธรรมเนียมการจัดการ ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ ค่าธรรมเนียมนายทะเบียนหน่วยลงทุน

และค่าใช้จ่ายที่เกี่ยวข้องกับการปฏิบัติการกองทุน ณ วันที่คำนวณ

ค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์
กองทุนเปิดกรุงศรียูเอเอสไอควิตี้อินเดกซ์เฮดจ์เอฟเอ็กซ์ / Krungsri US Equity Index Hedged FX Fund
ตั้งแต่วันที่ 1 มีนาคม 2566 ถึงวันที่ 31 สิงหาคม 2566

บริษัท	จำนวนเงิน (ดอลลาร์สหรัฐ)	อัตราส่วน (%)
UOB Kay Hian Pte Ltd	386.00	100.00
รวม / Total	386.00	100.00

ผลการดำเนินงานของกองทุนเปิดกรุงศรียูเอเอสอีควิตีอินเด็กซ์เฮดจ์เอฟเอ็กซ์

ผลการดำเนินงาน สิ้นสุด ณ วันที่ 31 สิงหาคม 2566	% 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	
KFUSIDX-A	14.03%	6.86%	11.62%	9.43%	7.32%	7.89%	N/A	9.29%
ดัชนีชี้วัด (Benchmark)*	16.85%	7.88%	13.06%	11.93%	9.35%	10.52%	N/A	11.95%
ความผันผวนของผลการดำเนินงาน	13.23%	10.65%	12.76%	17.99%	18.00%	21.47%	N/A	19.58%
ความผันผวนของดัชนีชี้วัด	13.72%	10.86%	12.92%	18.30%	18.42%	22.58%	N/A	20.71%

ผลการดำเนินงาน สิ้นสุด ณ วันที่ 31 สิงหาคม 2566	% 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	
KFUSIDX-I	14.03%	6.85%	11.61%	9.43%	N/A	N/A	N/A	0.84%
ดัชนีชี้วัด (Benchmark)*	16.85%	7.88%	13.06%	11.93%	N/A	N/A	N/A	5.04%
ความผันผวนของผลการดำเนินงาน	13.23%	10.50%	12.73%	17.98%	N/A	N/A	N/A	18.18%
ความผันผวนของดัชนีชี้วัด	13.72%	10.86%	12.92%	18.30%	N/A	N/A	N/A	18.57%

หมายเหตุ : * ดัชนีชี้วัด (Benchmark) คือ ดัชนี S&P 500 Index ในสกุลเงินเหรียญสหรัฐ ปรับด้วยต้นทุนการป้องกันความเสี่ยงด้านอัตราแลกเปลี่ยน เพื่อเทียบเท่ากับค่าสกุลเงินบาท ณ วันที่คำนวณผลตอบแทน

** ผลตอบแทนที่มีอายุเกินหนึ่งปีจะแสดงเป็นผลตอบแทนต่อปี

เอกสารการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวมฉบับนี้ ได้จัดทำตามมาตรฐานการวัดผลการดำเนินงานของ
กองทุนรวมของสมาคมบริษัทจัดการลงทุน

ข้อมูลอื่นๆ ที่ผู้ถือหน่วยลงทุนควรทราบ

(1) รายงานบุคคลที่เกี่ยวข้องที่มีการทำธุรกรรมในรอบเวลาที่ผ่านมา (1 มีนาคม 2566 ถึงวันที่ 31 สิงหาคม 2566)

ชื่อกองทุน	รายชื่อบุคคลที่เกี่ยวข้อง
กองทุนเปิดกรุงศรียูเอเอสอควิตี้อินเคอร์เนชันแนลเอฟเอ็กซ์	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 31 สิงหาคม 2566

- นายชวลิต โสภคพิชญพัฒนา
- นายสาธิต บัวชู
- นางสาวสาวิณี สุขศรีวงศ์
- นายปิติ ประดิพัทธ์พงษ์
- นายกวิฬ เจริญเสาวภาคย์
- นายจตุรันต์ สอนไ
- นายชูศักดิ์ อวยพรชัยสกุล
- นายพงศ์สันต์ อนุรัตน์
- นางสาววรรดา ตันติสุนทร
- นายวัชรินทร์ ค้วงสังข์

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

ไม่มีการถือหน่วยลงทุนเกิน 1 ใน 3 ของบุคคลใดบุคคลหนึ่ง

ผู้ถือหน่วยลงทุนสามารถตรวจสอบข้อมูลสัดส่วนการถือหน่วยลงทุนโดยตรงได้ที่ www.krungsriasset.com

(4) อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุนของกองทุน (portfolio turnover ratio) ในรอบระยะเวลาที่ผ่านมา

- KFUSINDX-A (portfolio turnover ratio) เท่ากับ 7.85%
- KFUSINDX-I (portfolio turnover ratio) เท่ากับ 7.85%

(5) ผลการดำเนินงานและข้อมูลการลงทุนของกองทุนหลัก (ข้อมูล ณ วันที่ 30/06/2023)

PERFORMANCE

	1 Year	3 Year	5 Year	10 Year	Since Inception
NAV	19.57%	14.56%	12.27%	12.82%	6.92%
Market Price	19.54%	14.62%	12.26%	12.83%	6.92%
Benchmark	19.59%	14.60%	12.31%	12.86%	6.98%

The performance quoted represents past performance and does not guarantee future results. Investment return and principal value of an investment will fluctuate so that an investor's shares, when sold or redeemed, may be worth more or less than the original cost. Current performance may be lower or higher than the performance quoted. Performance data current to the most recent month end may be obtained by visiting www.iShares.com or www.blackrock.com.

Beginning 8/10/20, the market price returns are calculated using the closing price.

Prior to 8/10/20, the market price returns were calculated using the midpoint of the bid/ask spread at 4:00 PM ET. The returns shown do not represent the returns you would receive if you traded shares at other times.

TOP HOLDINGS (%)

APPLE INC	7.70
MICROSOFT CORP	6.79
AMAZON COM INC	3.12
NVIDIA CORP	2.81
ALPHABET INC CLASS A	1.91
TESLA INC	1.89
META PLATFORMS INC CLASS A	1.70
ALPHABET INC CLASS C	1.66
BERKSHIRE HATHAWAY INC CLASS B	1.63
UNITEDHEALTH GROUP INC	1.20
	<hr/>
	30.41

Holdings are subject to change.

TOP SECTORS (%)

Information Technology	28.19%
Health Care	13.38%
Financials	12.38%
Consumer Discretionary	10.63%
Industrials	8.47%
Communication	8.37%
Consumer Staples	6.65%
Energy	4.10%
Utilities	2.57%
Real Estate	2.49%
Materials	2.49%
Cash and/or Derivatives	0.27%