



krungsri

Asset
Management

Make Life
Simple

A member of  MUFG
a global financial group

รายงานประจำปีแรก 2564

รอบระยะเวลาตั้งแต่วันที่ 29 ตุลาคม 2563 - 31 มีนาคม 2564

กองทุนรวม

KFCORE

กองทุนเปิดกรุงศรีโกลบอลคอร์วอลเคชั่น

Krungsri Global Core Allocation Fund

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 ประจำปีแรก 2564

กองทุนเปิดกรุงศรีโกลบอลคอร์ปอเรชัน

● สารบัญจัดการ	3
● รายงานผู้ดูแลผลประโยชน์	4
● งบแสดงฐานะการเงิน งบกำไรขาดทุนเบ็ดเสร็จ และงบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน	5
● รายละเอียดเงินลงทุน การกู้ยืมเงิน และการก่อภาระผูกพันของกองทุนรวม	10
● ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม	15
● คำนายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์	16
● ผลการดำเนินงาน	19
● ข้อมูลอื่นๆ ที่ผู้ถือหน่วยลงทุนควรทราบ	20
- รายงานบุคคลที่เกี่ยวข้องที่มีการทำธุรกรรมในรอบเวลาที่ผ่านมา	
- รายชื่อผู้จัดการกองทุน	
- การเปิดเผยข้อมูลการถือหน่วยลงทุนเกิน 1 ใน 3	
- อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุนของกองทุน	

เรียน ผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุน

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด (บริษัทฯ) ขอส่งรายงานสำหรับรอบระยะเวลา 6 เดือน ของกองทุนเปิดกรุงศรี โกลบอลคอร์ปอเรชัน (KFCORE) ตั้งแต่วันที่ 29 ตุลาคม 2563 ถึงวันที่ 31 มีนาคม 2564 มายังผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุน โดยมีรายละเอียด ดังนี้

ผลการดำเนินงาน

กองทุนเปิดกรุงศรีโกลบอลคอร์ปอเรชัน มีมูลค่าทรัพย์สินสุทธิ ณ วันที่ 31 มีนาคม 2564 เท่ากับ 3,446.28 ล้านบาท คิดเป็นมูลค่าทรัพย์สินสุทธิต่อหน่วยลงทุนเท่ากับ 10.0453 บาท โดยมีผลการดำเนินงานตั้งแต่จัดตั้งกองทุน เพิ่มขึ้นร้อยละ 0.45 น้อยกว่าเกณฑ์มาตรฐานการวัดผลการดำเนินงาน ที่เพิ่มขึ้นร้อยละ 5.32

ภาวะการลงทุนในช่วงที่ผ่านมา

กองทุนเปิดกรุงศรีโกลบอลคอร์ปอเรชัน ปรับตัวเพิ่มขึ้นเล็กน้อย ตั้งแต่จัดตั้งกองทุน ถึง สิ้นเดือนมีนาคม 2564 โดยในไตรมาส 4 ปี 2563 กองทุนหลักได้รับผลบวกจากการปรับตัวลดลงของ Bond Yield ทั่วโลก เนื่องจากมาตรการกระตุ้นเศรษฐกิจของธนาคารกลางในสหรัฐฯ และยุโรป เพื่อช่วยให้เศรษฐกิจโลกฟื้นตัวจากผลกระทบต่อการแพร่ระบาดของโรค Covid-19 ส่งผลให้การลงทุนในพันธบัตรรัฐบาลในสหรัฐฯ และยุโรป ปรับตัวสูงขึ้นตามลำดับ นอกจากนี้ การดำเนินนโยบายกระตุ้นเศรษฐกิจผ่านการใช้จ่ายของภาครัฐบาล เช่น การให้เงินช่วยเหลือแก่ประชาชน สวัสดิการแก่ผู้ว่างงาน และการให้สินเชื่อดอกเบี้ยต่ำแก่ภาคธุรกิจ ส่งผลบวกต่อตลาดหุ้นทั่วโลก กองทุนหลักได้รับอานิสงค์จากการลงทุนในกลุ่มประเทศพัฒนาแล้วเช่น สหรัฐฯ ยุโรป และญี่ปุ่น ขณะที่การลงทุนในกลุ่มประเทศเกิดใหม่ช่วยเพิ่มผลตอบแทนให้กับกองทุนหลัก หลังจากเงินทุนทยอยไหลกลับมายังกลุ่มประเทศและอุตสาหกรรมที่ได้รับผลกระทบจากภาวะเศรษฐกิจหดตัว อย่างไรก็ดี กองทุนหลักได้เผชิญแรงกดดันจากการปรับตัวขึ้นอย่างรวดเร็วของ Bond yield สหรัฐฯ และ ยุโรป เนื่องจากราคาน้ำมันดิบตัวขึ้นเพราะซาอุดีอาระเบียทยอยลดกำลังการผลิตและความต้องการใช้น้ำมันมีทิศทางสูงขึ้น นอกจากนี้ มาตรการกระตุ้นเศรษฐกิจครั้งใหญ่ของรัฐบาลทั่วโลก ส่งผลให้เงินเฟ้อมีทิศทางเร่งตัวขึ้น การที่ Bond yield ปรับตัวสูงขึ้น ส่งผลกดดันผลการดำเนินงานของกองทุน ซึ่งมีการลงทุนในพันธบัตรรัฐบาลสหรัฐฯ และยุโรป ที่มีอายุตราสารยาว ทีมผู้จัดการกองทุนได้ทำการลดความเสี่ยงของกองทุนลง โดยปรับลดสัดส่วนการถือครองพันธบัตรรัฐบาลยุโรป และเพิ่มการถือเงินสดมากขึ้น ในภาวะ Bond yield ขาขึ้น

แนวโน้มการลงทุน

กองทุนหลัก มีกลยุทธ์การลงทุนที่ยืดหยุ่น ปรับพอร์ตรวดเร็ว และกระจายการลงทุนในหลายสินทรัพย์ทั่วโลก โดยมีเป้าหมายเพื่อสร้างผลตอบแทนที่ดี และสม่ำเสมอในทุกภาวะตลาด โดยกองทุนหลักมีแนวโน้มฟื้นตัว จากปัจจัยกดดันระยะสั้นที่เกิดจากการปรับตัวขึ้นของ Bond yield เนื่องจากความกังวลเรื่องเงินเฟ้อ โดยกองทุนได้รับปัจจัยสนับสนุนจากการฟื้นตัวของเศรษฐกิจโลก หลังการแจกจ่ายวัคซีน Covid-19 ทั่วโลกในปี 2564 นอกจากนี้ มาตรการผ่อนคลายทางการเงินและการคลัง จะช่วยส่งเสริมความแข็งแกร่งของการฟื้นตัวทางเศรษฐกิจ ขณะที่เงินเฟ้อมีทิศทางชะลอตัวลงในช่วงครึ่งหลังของปี จะช่วยลดความกดดันจากการปรับตัวขึ้นของ Bond yield

บริษัทฯ ใคร่ขอขอบพระคุณท่านผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุนที่ได้มอบความไว้วางใจให้บริษัทฯ เป็นผู้บริหารเงินลงทุนของท่าน ทั้งนี้ บริษัทฯ จะพิจารณาดำเนินนโยบายการลงทุนที่เหมาะสมกับสถานการณ์ด้วยความระมัดระวัง และคำนึงถึงผลประโยชน์สูงสุดของผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุนเป็นสำคัญ

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด

รายงานผู้ดูแลผลประโยชน์

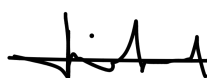
เสนอ ผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุนกองทุนเปิดกรุงศรีโกลบอลคอร์ปอเรชั่น

ธนาคารซีทีบีแบงก์ เอ็น เอ สาขากรุงเทพฯ ในฐานะผู้ดูแลผลประโยชน์กองทุนเปิดกรุงศรีโกลบอลคอร์ปอเรชั่น อันมีบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด เป็นผู้จัดตั้งและจัดการกองทุนได้ปฏิบัติหน้าที่ดูแลผลประโยชน์กองทุนรวมถึงกล่าว สำหรับรอบระยะเวลาตั้งแต่วันที่ 29 ตุลาคม 2563 ถึงวันที่ 31 มีนาคม 2564 แล้วนั้น

ธนาคารฯ ได้จัดทำรายงานฉบับนี้ขึ้นบนพื้นฐานของแหล่งข้อมูลที่ได้รับ ณ วันที่ในจดหมายนี้โดยเชื่อว่าเชื่อถือได้ แต่ธนาคารไม่รับรองความถูกต้องหรือความสมบูรณ์ของข้อมูลดังกล่าว และขอสงวนสิทธิในความรับผิดชอบต่อความผิดพลาด ความละเอียด (รวมถึงไปถึงความรับผิดชอบต่อบุคคลที่สาม) อย่างชัดเจน ไม่มีการรับประกันว่าเหตุการณ์หรือผลลัพธ์ในอนาคตจะตรงกันกับรายงานดังกล่าว ธนาคารฯ กรรมการ พนักงาน หรือตัวแทนของธนาคารไม่รับประกันใดๆ ต่อการจ่ายเงินลงทุน การกระทำการ หรือการแจกจ่ายกองทุน และไม่รับผิดชอบต่อความเสียหายที่เป็นผลมาจากการกระทำ หรือการละเลยที่เกิดขึ้นอันเกี่ยวข้องกับรายงานฉบับนี้

ธนาคารฯ เห็นว่า บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด ได้ปฏิบัติหน้าที่ในการจัดการโดยถูกต้องตามที่ควร ตามวัตถุประสงค์ที่ได้กำหนดไว้ในโครงการจัดการที่ได้รับอนุมัติจากสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ และภายใต้พระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535

ขอแสดงความนับถืออย่างสูง



(Thierry Tassenoy คุณเจดจันทร์ สุนันทพงศ์ศักดิ์)

Citibank N.A.

ผู้ดูแลผลประโยชน์กองทุนรวม

ธนาคารซีทีบีแบงก์ เอ็น เอ สาขากรุงเทพฯ

18 พฤษภาคม 2564 CN NS.

กองทุนเปิดกรุงศรี โกลบอลคอร์โวลเคชั่น
งบแสดงฐานะการเงิน
ณ 31 มีนาคม 2564

	Unaudited (บาท)
สินทรัพย์	
เงินลงทุนตามราคายุติธรรม (ราคาทุน 3,656,653,038.57 บาท)	3,711,252,000.44
เงินฝากธนาคาร	7,943,450.06
ลูกหนี้จากสัญญาอนุพันธ์	61,212,665.38
ลูกหนี้	
จากดอกเบี้ย	88,862.07
จากการขายเงินลงทุน	198,170,592.23
จากการขายหน่วยลงทุน	266,009.20
จากการรับเงินค่าตอบแทนจากเงินลงทุนในต่างประเทศ	1,065,934.96
รวมสินทรัพย์	<u>3,979,999,514.34</u>
หนี้สิน	
เจ้าหนี้จากสัญญาอนุพันธ์	150,018,150.83
เจ้าหนี้	
จากการรับซื้อคืนหน่วยลงทุน	6,130,118.58
จากการซื้อเงินลงทุน	372,237,227.97
ค่าธรรมเนียมสับเปลี่ยนหน่วยลงทุน	140,129.05
ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย	5,046,768.03
ภาษีเงินได้ค้างจ่าย	13,329.31
หนี้สินอื่น	129,036.91
รวมหนี้สิน	<u>533,714,760.68</u>
สินทรัพย์สุทธิ	<u>3,446,284,753.66</u>
สินทรัพย์สุทธิ:	
หน่วยลงทุนจดทะเบียน 5,000 ล้านหน่วย มูลค่าที่ตราไว้หน่วยละ 10 บาท	
ทุนที่ได้รับจากผู้ถือหน่วยลงทุน	3,430,731,241.35
กำไรสะสม(ขาดทุนสะสม)	2,054,885.31
บัญชีปรับสมดุล	13,498,627.00
สินทรัพย์สุทธิ	<u>3,446,284,753.66</u>
สินทรัพย์สุทธิต่อหน่วย	10.0453
จำนวนหน่วยลงทุนที่จำหน่ายได้แล้วทั้งหมด ณ วันสิ้นงวด (หน่วย)	343,073,124.1494

กองทุนเปิดกรุงศรี โกลบอลคอร์ปอเรชั่น
งบกำไรขาดทุนเบ็ดเสร็จ
สำหรับงวดบัญชีสิ้นสุดวันที่ 31 มีนาคม 2564

	Unaudited (บาท)
รายได้จากการลงทุน	
รายได้ดอกเบี้ย	233,859.29
รายได้เงินปันผล	6,156,811.49
รายได้จากการรับเงินค่าตอบแทนจากเงินลงทุนในต่างประเทศ	1,799,080.26
รายได้อื่น	6,885.40
รวมรายได้	<u>8,196,636.44</u>
ค่าใช้จ่าย	
ค่าธรรมเนียมการจัดการ	21,198,830.75
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์	678,362.63
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน	2,543,859.63
ค่าธรรมเนียมวิชาชีพ	27,966.62
ค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์	778,791.04
รวมค่าใช้จ่าย	<u>25,227,810.67</u>
รายได้จากการลงทุนสุทธิ	<u>(17,031,174.23)</u>
รายการกำไร (ขาดทุน) สุทธิจากเงินลงทุน	
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิที่เกิดขึ้นจากเงินลงทุน	(44,289,009.25)
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิที่ยังไม่เกิดขึ้นจากเงินลงทุน	54,598,961.87
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิที่ยังไม่เกิดขึ้นจากสัญญาอนุพันธ์	(88,805,485.45)
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิจากอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ	97,616,671.27
รวมรายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิจากเงินลงทุนที่เกิดขึ้นและยังไม่มีเกิดขึ้น	<u>19,121,138.44</u>
การเพิ่มขึ้นในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงานก่อนภาษีเงินได้	2,089,964.21
หัก ภาษีเงินได้	(35,078.90)
การเพิ่มขึ้นในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงานหลังหักภาษีเงินได้	<u>2,054,885.31</u>

กองทุนเปิดกรุงศรี โกลบอลคอร์ร้อโลเคชั่น

งบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน

ณ 31 มีนาคม 2564

การแสดงรายละเอียดเงินลงทุนใช้การจัดกลุ่มตามประเภทของเงินลงทุนและประเภทของอุตสาหกรรม

					Unaudited
ประเภทเงินลงทุน/ผู้ออกตราสาร/ผู้ออกหลักทรัพย์	หมายเลขตราสาร	อัตราดอกเบี้ย (%)	เงินต้น (บาท) / จำนวนหุ้น	มูลค่ายุติธรรม (บาท)	ร้อยละของ มูลค่า เงินลงทุน
หลักทรัพย์ในประเทศ					
เงินฝากออมทรัพย์					0.89
บมจ.ร.ทิสโก้		0.150000	เมื่อทวงถาม 2,891.16	2,891.16	0.00
บมจ.ร.ยูโอบี		0.250000	เมื่อทวงถาม 33,071,791.23	33,071,791.23	0.89
หลักทรัพย์ต่างประเทศ					
เงินฝากออมทรัพย์					19.40
ธนาคารซีทีบีแบงก์ สาขาทรงเทพฯ		เมื่อทวงถาม	719,821,555.92	719,821,555.92	19.40
จำนวนเงิน 22,992,351.74 USD					0.35
ธนาคารซีทีบีแบงก์ สาขาทรงเทพฯ		เมื่อทวงถาม	13,150,777.45	13,150,777.45	0.35
จำนวนเงิน 357,589.35 EUR					0.09
ธนาคารซีทีบีแบงก์ สาขาทรงเทพฯ		เมื่อทวงถาม	3,499,508.52	3,499,508.52	0.09
จำนวนเงิน 81,103.64 GBP					
หน่วยลงทุน					79.27
iShares plc - iShares Core FTSE 100 UCITS ETF	IE0005042456		46,813,622.27	53,269,270.62	1.44
จำนวน 186,846.000000 หน่วย					
มูลค่าหน่วยละ 9.1065 USD					
รวมเป็นเงิน 1,701,513.10 USD					
iShares Core S&P 500 UCITS ETF USD Dist	IE0031442068		254,235,000.35	289,225,851.83	7.79
จำนวน 233,204.000000 หน่วย					
มูลค่าหน่วยละ 39.6150 USD					
รวมเป็นเงิน 9,238,376.46 USD					
iShares MSCI Brazil UCITS ETF	IE00B0M63516		10,181,769.30	10,250,042.66	0.28
จำนวน 12,813.000000 หน่วย					
มูลค่าหน่วยละ 25.5525 USD					
รวมเป็นเงิน 327,404.18 USD					
iShares MSCI Taiwan UCITS ETF	IE00B0M63623		10,135,858.83	10,140,965.01	0.27
จำนวน 4,129.000000 หน่วย					
มูลค่าหน่วยละ 78.4500 USD					
รวมเป็นเงิน 323,920.05 USD					
iShares Core UK Gilts UCITS ETF	IE00B1FZSB30		94,497,446.02	89,758,856.84	2.42
จำนวน 151,620.000000 หน่วย					
มูลค่าหน่วยละ 13.7200 GBP					
รวมเป็นเงิน 2,080,226.40 GBP					
iShares USD TIPS UCITS ETF	IE00B1FZSC47		25,193,964.50	25,100,919.47	0.68

กองทุนเปิดกรุงศรี โกลบอลคอรัโอโลเคชั่น

งบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน

ณ 31 มีนาคม 2564

การแสดงรายละเอียดเงินลงทุนใช้การจัดกลุ่มตามประเภทของเงินลงทุนและประเภทของอุตสาหกรรม

ประเภทเงินลงทุน/ผู้ออกตราสาร/ผู้ออกหลักทรัพย์	หมายเลขตราสาร	อัตราดอกเบี้ย (%)	วันครบอายุ	เงินต้น (บาท) / จำนวนหุ้น	มูลค่ายุติธรรม (บาท)	Unaudited
						ร้อยละของ
						มูลค่าเงินลงทุน
จำนวน 3,340.000000 หน่วย						
มูลค่าหน่วยละ 240.0500 USD						
รวมเป็นเงิน 801,767.00 USD						
iShares USD Treasury Bond 7-10yr						
UCITS ETF USD Acc	IE00B3VWN518			503,433,506.79	478,705,573.60	12.90
จำนวน 96,292.000000 หน่วย						
มูลค่าหน่วยละ 158.7950 USD						
รวมเป็นเงิน 15,290,688.14 USD						
iShares Core MSCI Japan IMI UCITS ETF	IE00B4L5YX21			20,317,245.25	21,820,321.55	0.59
จำนวน 13,450.000000 หน่วย						
มูลค่าหน่วยละ 51.8200 USD						
รวมเป็นเงิน 696,979.00 USD						
iShares MSCI Poland UCITS ETF	IE00B4M7GH52			12,388,717.44	11,665,148.80	0.31
จำนวน 23,282.000000 หน่วย						
มูลค่าหน่วยละ 16.0040 USD						
รวมเป็นเงิน 372,605.13 USD						
iShares USD High Yield Corp Bond UCITS ETF	IE00B4PY7Y77			30,013,408.22	30,660,604.37	0.83
จำนวน 9,435.000000 หน่วย						
มูลค่าหน่วยละ 103.8000 USD						
รวมเป็นเงิน 979,353.00 USD						
iShares MSCI South Africa UCITS ETF	IE00B52XQP83			16,471,278.91	19,888,692.80	0.54
จำนวน 18,017.000000 หน่วย						
มูลค่าหน่วยละ 35.2600 USD						
รวมเป็นเงิน 635,279.42 USD						
iShares Germany Govt Bond UCITS ETF	IE00B5V94313			304,004,723.15	300,971,627.39	8.11
จำนวน 56,233.000000 หน่วย						
มูลค่าหน่วยละ 145.5350 EUR						
รวมเป็นเงิน 8,183,869.66 EUR						
iShares USD Ultrashort Bond UCITS ETF	IE00BCRY6227			176,028,870.21	175,893,452.72	4.74
จำนวน 56,175.000000 หน่วย						
มูลค่าหน่วยละ 100.0150 USD						
รวมเป็นเงิน 5,618,342.63 USD						
iShares USD Floating Rate Bond UCITS ETF	IE00BDFGJ627			213,415,376.54	213,438,548.41	5.75
จำนวน 1,281,383.000000 หน่วย						

กองทุนเปิดกรุงศรี โกลบอลคอรัโอโลเคชั่น

งบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน

ณ 31 มีนาคม 2564

การแสดงรายละเอียดเงินลงทุนใช้การจัดกลุ่มตามประเภทของเงินลงทุนและประเภทของอุตสาหกรรม

ประเภทเงินลงทุน/ผู้ออกตราสาร/ผู้ออกหลักทรัพย์	หมายเลขตราสาร	อัตราดอกเบี้ย (%)	วันครบอายุ	เงินต้น (บาท) / จำนวนหุ้น	มูลค่ายุติธรรม (บาท)	ร้อยละของมูลค่าเงินลงทุน	Unaudited
มูลค่าหน่วยละ 5.3205 USD							
รวมเป็นเงิน 6,817,598.25 USD							
iShares USD Treasury Bond 20+yr UCITS ETF	IE00BFM6TC58			524,320,485.90	453,894,139.00	12.23	
จำนวน 2,365,889.000000 หน่วย							
มูลค่าหน่วยละ 6.1280 USD							
รวมเป็นเงิน 14,498,167.79 USD							
BlackRock Advantage US Equity Fund	IE00BFZP7Y79			163,820,177.72	199,809,867.46	5.38	
จำนวน 42,494.670000 หน่วย							
มูลค่าหน่วยละ 150.1900 USD							
รวมเป็นเงิน 6,382,274.49 USD							
BlackRock Advantage World Equity Fund	IE00BFZP8221			326,420,165.74	398,002,128.21	10.72	
จำนวน 89,729.530000 หน่วย							
มูลค่าหน่วยละ 141.6800 USD							
รวมเป็นเงิน 12,712,879.81 USD							
iShares EUR Govt Bond 20yr							
Target Duration UCITS ETF	IE00BSKRJX20			87,623,799.75	81,053,229.25	2.18	
จำนวน 362,923.000000 หน่วย							
มูลค่าหน่วยละ 6.0728 EUR							
รวมเป็นเงิน 2,203,958.79 EUR							
iShares MSCI India UCITS ETF	IE00BZCQB185			67,791,097.40	78,156,236.17	2.11	
จำนวน 378,651.000000 หน่วย							
มูลค่าหน่วยละ 6.5930 USD							
รวมเป็นเงิน 2,496,446.04 USD							
					3,711,252,000.44	100.00	

กองทุนเปิดกรุงศรีโกลบอลคอร์ปอเรชั่น

รายละเอียดการลงทุน ณ 31 มีนาคม 2564

	มูลค่าตามราคาตลาด	% NAV
หลักทรัพย์หรือทรัพย์สินในประเทศ	41,106,994.52	1.19
เงินฝากธนาคาร		
TRIS		
Rate A	4,326.54	0.00
S&P		
Rate A-	7,947,271.15	0.23
FITCH_TH-LONG		
Rate AAA	33,155,396.83	0.96
หลักทรัพย์หรือทรัพย์สินต่างประเทศ	3,678,177,318.05	106.73
หน่วยลงทุน		
จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์	2,559,680,619.52	74.27
หน่วยลงทุน		
ไม่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์	382,024,856.64	11.09
เงินฝากธนาคาร		
S&P		
Rate A-	736,471,841.89	21.37
สัญญาซื้อขายล่วงหน้า	(88,805,485.45)	(2.58)
สัญญาที่อ้างอิงกับอัตราแลกเปลี่ยน-สัญญาแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ		
TRIS		
Rate A+	(43,315,399.60)	(1.26)
Rate A	(25,491.10)	0.00
FITCH-LONG		
Rate AA	(77,891,263.19)	(2.26)
Rate AA-	10,259,872.00	0.30
ALL NON RATED SECURITY (NRG)		
Non Rated	22,166,796.44	0.64

กองทุนเปิดกรุงศรีโกลบอลคอร์ปอเรชั่น

รายละเอียดการลงทุน ณ 31 มีนาคม 2564

	มูลค่าตามราคาตลาด	% NAV
อื่นๆ	(184,194,073.46)	(5.34)
ลูกหนี้	199,502,536.39	5.79
เจ้าหนี้	(378,649,841.82)	(10.98)
ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย	(5,046,768.03)	(0.15)
มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ	3,446,284,753.66	100.00

กองทุนเปิดกรุงศรีโกลบอลคอร์ปอเรชั่น

รายละเอียดการลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ณ 31 มีนาคม 2564

ประเภทสัญญา	คู่สัญญา	วัตถุประสงค์	มูลค่าสัญญา (Notional Amount)	% NAV	วันครบกำหนด	กำไร/ขาดทุน (net gain/loss)
สัญญาที่อ้างอิงกับอัตราแลกเปลี่ยน						
สัญญาฟอว์เวิร์ด	บมจ.ธ.กรุงศรีอยุธยา	ป้องกันความเสี่ยง	240,193,600.00	0.2977	1 เม.ย. 2564	10,259,872.00
สัญญาฟอว์เวิร์ด	BNP Paribas	ป้องกันความเสี่ยง	150,161.78	0.0000	7 เม.ย. 2564	0.00
สัญญาฟอว์เวิร์ด	BNP Paribas	ป้องกันความเสี่ยง	3,068,310.43	(0.0674)	30 เม.ย. 2564	(2,323,242.07)
สัญญาฟอว์เวิร์ด	BNP Paribas	ป้องกันความเสี่ยง	29,826.40	0.0003	30 เม.ย. 2564	10,094.94
สัญญาฟอว์เวิร์ด	BNP Paribas	ป้องกันความเสี่ยง	23,994,478.88	0.7112	30 เม.ย. 2564	24,510,187.06
สัญญาฟอว์เวิร์ด	BNP Paribas	ป้องกันความเสี่ยง	1,246,111.35	(0.0099)	30 เม.ย. 2564	(341,144.55)
สัญญาฟอว์เวิร์ด	BNP Paribas	ป้องกันความเสี่ยง	2,824,905.15	(0.0244)	30 เม.ย. 2564	(839,514.74)
สัญญาฟอว์เวิร์ด	BNP Paribas	ป้องกันความเสี่ยง	14,084,798.93	(0.4007)	30 เม.ย. 2564	(13,810,170.14)
สัญญาฟอว์เวิร์ด	BNP Paribas	ป้องกันความเสี่ยง	340,928.84	(0.0017)	30 เม.ย. 2564	(58,523.11)
สัญญาฟอว์เวิร์ด	BNP Paribas	ป้องกันความเสี่ยง	6,442,092.76	(0.2005)	30 เม.ย. 2564	(6,908,234.55)
สัญญาฟอว์เวิร์ด	BNP Paribas	ป้องกันความเสี่ยง	615,614.64	0.0024	30 เม.ย. 2564	83,343.30
สัญญาฟอว์เวิร์ด	BNP Paribas	ป้องกันความเสี่ยง	667,031.18	(0.0147)	30 เม.ย. 2564	(505,531.66)
สัญญาฟอว์เวิร์ด	BNP Paribas	ป้องกันความเสี่ยง	1,404,247.14	0.0304	30 เม.ย. 2564	1,048,336.18
สัญญาฟอว์เวิร์ด	BNP Paribas	ป้องกันความเสี่ยง	3,400,000.62	(0.0708)	30 เม.ย. 2564	(2,439,056.36)
สัญญาฟอว์เวิร์ด	BNP Paribas	ป้องกันความเสี่ยง	308,688.85	(0.0064)	30 เม.ย. 2564	(221,538.04)
สัญญาฟอว์เวิร์ด	BNP Paribas	ป้องกันความเสี่ยง	212,152.29	(0.0057)	30 เม.ย. 2564	(195,515.03)
สัญญาฟอว์เวิร์ด	BNP Paribas	ป้องกันความเสี่ยง	107,771.75	(0.0029)	30 เม.ย. 2564	(99,417.57)
สัญญาฟอว์เวิร์ด	BNP Paribas	ป้องกันความเสี่ยง	100,081.93	(0.0031)	30 เม.ย. 2564	(107,413.06)
สัญญาฟอว์เวิร์ด	BNP Paribas	ป้องกันความเสี่ยง	569,682.18	0.0056	30 เม.ย. 2564	192,995.76
สัญญาฟอว์เวิร์ด	Citigroup	ป้องกันความเสี่ยง	5,451,132.65	0.0000	7 เม.ย. 2564	0.00
สัญญาฟอว์เวิร์ด	Citigroup	ป้องกันความเสี่ยง	5,453,728.07	0.0000	30 เม.ย. 2564	216.02
สัญญาฟอว์เวิร์ด	บมจ.ธ.กสิกรไทย	ป้องกันความเสี่ยง	249,998,400.00	(0.0134)	1 เม.ย. 2564	(462,800.00)
สัญญาฟอว์เวิร์ด	บมจ.ธ.กสิกรไทย	ป้องกันความเสี่ยง	392,108,484.95	(0.3978)	23 เม.ย. 2564	(13,708,227.57)
สัญญาฟอว์เวิร์ด	บมจ.ธ.กสิกรไทย	ป้องกันความเสี่ยง	109,342,852.50	(0.1335)	14 พ.ค. 2564	(4,601,162.52)
สัญญาฟอว์เวิร์ด	บมจ.ธ.กสิกรไทย	ป้องกันความเสี่ยง	61,666,440.00	(0.0701)	6 ส.ค. 2564	(2,416,250.30)
สัญญาฟอว์เวิร์ด	บมจ.ธ.กสิกรไทย	ป้องกันความเสี่ยง	305,813,726.00	(0.3934)	27 ส.ค. 2564	(13,559,395.30)
สัญญาฟอว์เวิร์ด	บมจ.ธ.เกียรตินาคิน	ป้องกันความเสี่ยง	72,438,410.00	0.0065	1 เม.ย. 2564	225,137.00
สัญญาฟอว์เวิร์ด	บมจ.ธ.เกียรตินาคิน	ป้องกันความเสี่ยง	119,190,990.00	0.0107	1 เม.ย. 2564	370,443.00
สัญญาฟอว์เวิร์ด	บมจ.ธ.เกียรตินาคิน	ป้องกันความเสี่ยง	197,612,668.50	(0.0180)	14 พ.ค. 2564	(621,071.10)
สัญญาฟอว์เวิร์ด	บมจ.ธ.ไทยพาณิชย์	ป้องกันความเสี่ยง	283,954,440.00	(0.3751)	25 มิ.ย. 2564	(12,925,932.60)
สัญญาฟอว์เวิร์ด	บมจ.ธ.ไทยพาณิชย์	ป้องกันความเสี่ยง	85,117,659.90	(0.1083)	16 ก.ค. 2564	(3,733,892.02)
สัญญาฟอว์เวิร์ด	บมจ.ธ.ไทยพาณิชย์	ป้องกันความเสี่ยง	462,699,948.80	(0.5921)	6 ส.ค. 2564	(20,406,306.75)
สัญญาฟอว์เวิร์ด	บมจ.ธ.ไทยพาณิชย์	ป้องกันความเสี่ยง	344,293,848.00	(0.1763)	17 ก.ย. 2564	(6,077,296.13)

กองทุนเปิดกรุงศรีโกลบอลคอร์ปอเรชั่น

รายละเอียดการลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ณ 31 มีนาคม 2564

ประเภทสัญญา	คู่สัญญา	วัตถุประสงค์	มูลค่าสัญญา (Notional Amount)	% NAV	วันครบกำหนด	กำไร/ขาดทุน (net gain/loss)
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ธ.ทหารไทย	ป้องกันความเสี่ยง	115,359,769.20	(0.1220)	1 เม.ย. 2564	(4,202,809.50)
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ธ.ทหารไทย	ป้องกันความเสี่ยง	71,231,490.00	(0.0416)	1 เม.ย. 2564	(1,432,753.30)
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ธ.ทหารไทย	ป้องกันความเสี่ยง	110,213,200.00	(0.1046)	14 พ.ค. 2564	(3,604,887.66)
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ธ.ทหารไทย	ป้องกันความเสี่ยง	432,238,365.50	(0.5324)	4 มิ.ย. 2564	(18,348,766.47)
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ธ.ทหารไทย	ป้องกันความเสี่ยง	144,063,981.60	(0.1979)	25 มิ.ย. 2564	(6,818,891.31)
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ธ.ทหารไทย	ป้องกันความเสี่ยง	90,938,439.00	(0.1176)	16 ก.ค. 2564	(4,051,323.68)
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ธ.ทหารไทย	ป้องกันความเสี่ยง	129,344,867.50	(0.1409)	16 ก.ค. 2564	(4,855,967.68)
สัญญาฟอร์เวิร์ด	Westpac Banking Corp	ป้องกันความเสี่ยง	1,246,112.26	(0.0099)	30 เม.ย. 2564	(341,116.06)
สัญญาฟอร์เวิร์ด	Westpac Banking Corp	ป้องกันความเสี่ยง	23,994,537.05	0.7113	30 เม.ย. 2564	24,512,040.12

คำอธิบายการจัดอันดับตราสารของสถาบันจัดอันดับความน่าเชื่อถือ

• ตราสารหนี้ระยะกลางและระยะยาว

Moody's	S&P	TRIS	Fitch	คำอธิบาย	
Aaa	AAA	AAA	AAA	ความน่าเชื่อถือสูงที่สุด 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

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

ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (Fund's Direct Expenses)

กองทุนเปิดกรุงศรีโกลบอลคอร์ปอเรชั่น

ตั้งแต่วันที่ 29 ตุลาคม 2563 ถึงวันที่ 31 มีนาคม 2564

ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (Fund's Direct Expenses)	จำนวนเงิน (หน่วย: พันบาท)	ร้อยละของมูลค่า ทรัพย์สิน* (ต่อปี) 1/
ค่าธรรมเนียมการจัดการ (Management Fee)	21,198.83	1.3375
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ (Trustee Fee)	678.36	0.0428
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน (Registrar Fee)	2,543.86	0.1605
ค่าที่ปรึกษาการลงทุน (Advisory Fee)	-	-
ค่าธรรมเนียมสอบบัญชี (Auditing Fee)	27.97	0.0017
ค่าใช้จ่ายอื่น ๆ (Others)	-	-
รวมค่าใช้จ่ายทั้งหมด 2/	24,449.02	1.5425

หมายเหตุ

1/ ค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวมข้างต้น เป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่มหรือภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว

2/ ไม่รวมค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ และค่าธรรมเนียมต่าง ๆ ที่เกิดขึ้นจากการซื้อขายหลักทรัพย์

* มูลค่าทรัพย์สิน ในที่นี้ หมายถึง มูลค่าทรัพย์สินทั้งหมด หักด้วย มูลค่าหนี้สินทั้งหมด

เว้นแต่ค่าธรรมเนียมการจัดการ ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ ค่าธรรมเนียมนายทะเบียนหน่วยลงทุน

และค่าใช้จ่ายที่เกี่ยวข้องกับการปฏิบัติการกองทุน ณ วันที่คำนวณ

ค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์
กองทุนเปิดกรุงศรีโกลบอลคอร์โวลเคชั่น / Krungsri Global Core Allocation Fund
ตั้งแต่วันที่ 29 ตุลาคม 2563 ถึงวันที่ 31 มีนาคม 2564

บริษัท	จำนวนเงิน (ดอลลาร์สหรัฐ)	อัตราส่วน (%)
Citigroup	4,210.09	32.23
Credit Suisse	374.36	2.87
Hongkong and Shanghai	374.61	2.87
Morgan Stanley	87.44	0.67
Societe Generale Paris	8,017.12	61.36
รวม / Total	13,063.62	100.00

ค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์
กองทุนเปิดกรุงศรีโกลบอลคอร์โวลเคชั่น / Krungsri Global Core Allocation Fund
ตั้งแต่วันที่ 29 ตุลาคม 2563 ถึงวันที่ 31 มีนาคม 2564

บริษัท	จำนวนเงิน (ยูโร)	อัตราส่วน (%)
Societe Generale Paris	10,007.48	100.00
รวม / Total	10,007.48	100.00

ค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์

กองทุนเปิดกรุงศรีโกลบอลคอร์โวลเคชั่น / Krungsri Global Core Allocation Fund

ตั้งแต่วันที่ 29 ตุลาคม 2563 ถึงวันที่ 31 มีนาคม 2564

บริษัท	จำนวนเงิน	อัตราส่วน (%)
	(ปอนด์สเตอร์ลิง)	
Societe Generale Paris	679.36	100.00
รวม / Total	679.36	100.00

ผลการดำเนินงานของกองทุนเปิดกรุงศรีโกลบอลคอร์ปอเรชั่น

ผลการดำเนินงาน สิ้นสุด ณ วันที่ 31 มีนาคม 2564	% ตามช่วงเวลา			% ต่อปี				
	Year to Date	ย้อนหลัง 3 เดือน	ย้อนหลัง 6 เดือน	ย้อนหลัง 1 ปี	ย้อนหลัง 3 ปี	ย้อนหลัง 5 ปี	ย้อนหลัง 10 ปี	นับจากวันเริ่ม โครงการ (29 ตุลาคม 2563)
KFCORE	-3.47%	-3.47%	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	0.45%
ดัชนีชี้วัด (Benchmark)*	2.47%	2.47%	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	5.32%
ความผันผวนของผลการดำเนินงาน	5.10%	5.10%	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	5.62%
ความผันผวนของดัชนีชี้วัด	5.24%	5.24%	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	5.48%

หมายเหตุ : * ดัชนีชี้วัด (Benchmark) คือ

1. ดัชนี Bloomberg Barclays Global Aggregate Total Return Value Unhedged USD สัดส่วน 70%
2. ดัชนี MSCI ACWI Net Total Return USD สัดส่วน 30%

บริษัทจัดการจะใช้ตัวชี้วัดดังกล่าวในสกุลเงินเหรียญสหรัฐ ปรับด้วยอัตราแลกเปลี่ยนเพื่อเทียบกับค่าสกุลเงินบาท ณ วันที่คำนวณผลตอบแทน

** ผลตอบแทนที่มีอายุเกินหนึ่งปีจะแสดงเป็นผลตอบแทนต่อปี

เอกสารการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวมฉบับนี้ ได้จัดทำตามมาตรฐานการวัดผลดำเนินงานของ
กองทุนรวมของสมาคมบริษัทจัดการลงทุน

ข้อมูลอื่นๆ ที่ผู้ถือหน่วยลงทุนควรทราบ

(1) รายงานบุคคลที่เกี่ยวข้องที่มีการทำธุรกรรมในรอบเวลาที่ผ่านมา (วันที่ 29 ตุลาคม 2563 ถึงวันที่ 31 มีนาคม 2564)

ชื่อกองทุน	รายชื่อบุคคลที่เกี่ยวข้อง
กองทุนเปิดกรุงศรี โกลบอลคอร์ปอเรชัน	ธนาคารกรุงศรีอยุธยา จำกัด (มหาชน)

หมายเหตุ: ผู้ลงทุนสามารถตรวจสอบการทำธุรกรรมกับบุคคลที่เกี่ยวข้องกับกองทุนรวมได้ที่บริษัทจัดการโดยตรง 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 มีนาคม 2564

- | | |
|-----------------|----------------|
| 1. นายวิพุธ | เอื้ออนันท์ |
| 2. นายทลิต | โชคทิพย์พัฒนา |
| 3. นายสาริต | บัวชู |
| 4. นางสาวสาวณี | สุขศรีวงศ์ |
| 5. นายปิติ | ประติพัทธ์พงษ์ |
| 6. นายจตุรันต์ | สอนไว |
| 7. นายชูศักดิ์ | อวยพรชัยสกุล |
| 8. นายพลสิทธิ์ | อาหุณย์ |
| 9. นายพงศ์สันต์ | อนุรัตน์ |
| 10. นางสาวรรดา | คันติสุนทร |

(3) การเปิดเผยข้อมูลการถือหน่วยลงทุนเกิน 1 ใน 3 ณ วันที่ 31 มีนาคม 2564

ไม่มีการถือหน่วยลงทุนเกิน 1 ใน 3 ของบุคคลใดบุคคลหนึ่ง

ผู้ถือหน่วยลงทุนสามารถตรวจสอบข้อมูลสัดส่วนการถือหน่วยลงทุน โดยตรงได้ที่ www.krungsriasset.com

(4) อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุนของกองทุน (portfolio turnover ratio) ในรอบระยะเวลาที่ผ่านมา เท่ากับ 17.76%