



krungsri

Asset
Management

Make Life
Simple

A member of  MUFG
a global financial group

รายงานประจำปีแรก 2562

รอบระยะเวลาตั้งแต่วันที่ 1 มีนาคม 2562 – 31 สิงหาคม 2562

กองทุนรวม

KF-HJPINDEX

กองทุนเปิดกรุงศรีเจแปนเอควิตี้อินเด็กซ์เฮดจ์เอฟเอ็กซ์

Krungsri Japan Equity Index Hedged FX 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

รายงานประจำปีครั้งแรก 2562

กองทุนเปิดกรุงศรีเจแปนอควิตี้อินเด็กซ์เสดจ์เอฟเอ็กซ์

● สารบัญจัดการ	3
● รายงานผู้ดูแลผลประโยชน์	4
● งบดุล งบกำไรขาดทุน และงบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน	5
● รายละเอียดเงินลงทุน การกู้ยืมเงิน และการก่อภาระผูกพันของกองทุนรวม	8
● ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม	11
● คำนายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์	12
● ผลการดำเนินงาน	13
● ข้อมูลอื่นๆ ที่ผู้ถือหน่วยลงทุนควรทราบ	14
- รายงานบุคคลที่เกี่ยวข้องที่มีการทำธุรกรรมในรอบเวลาที่ผ่านมา	
- รายชื่อผู้จัดการกองทุน	
- การเปิดเผยข้อมูลการถือหน่วยลงทุนเกิน 1 ใน 3	
- อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุนของกองทุน	
- ข้อมูลการลงทุน และผลการดำเนินงานของกองทุนหลัก	

สารบัญชจัดการ

เรียน ผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุน

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด (บริษัท) ขอส่งรายงานสำหรับรอบระยะเวลา 6 เดือน ของกองทุนเปิดกรุงศรีเจแปนอควิตี้ อินเด็กซ์เฮดจ์เอฟเอ็กซ์ (KF-HJPINDEX) ตั้งแต่วันที่ 1 มีนาคม 2562 ถึงวันที่ 31 สิงหาคม 2562 มายังผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุน โดยมีรายละเอียด ดังนี้

ผลการดำเนินงาน

กองทุนเปิดกรุงศรีเจแปนอควิตี้อินเด็กซ์เฮดจ์เอฟเอ็กซ์ มีมูลค่าทรัพย์สินสุทธิ ณ วันที่ 31 สิงหาคม 2562 เท่ากับ 269.13 ล้านบาท คิดเป็น มูลค่าทรัพย์สินสุทธิต่อหน่วยลงทุนเท่ากับ 11.0759 บาท โดยมีผลการดำเนินงานย้อนหลัง 6 เดือน ลดลงร้อยละ 1.86 ลดลงมากกว่า เกณฑ์มาตรฐานการวัดผลการดำเนินงาน ที่ลดลงร้อยละ 1.66

ภาวะการลงทุนในช่วงที่ผ่านมา

ในรอบครึ่งปีที่ผ่านมา กองทุนหลัก Nikkei 225 ETF ปรับตัวลดลง 3.2% โดยในช่วงที่ผ่านมาตลาดหุ้นญี่ปุ่นถูกกดดันด้วยเงินเยนที่แข็งค่า จากความไม่แน่นอนที่เพิ่มขึ้นในตลาด ไม่ว่าจะเป็นเรื่องสงครามการค้าระหว่างจีนและสหรัฐฯ ที่ยังคงยืดเยื้อและมีการเปลี่ยนแปลงไป มา เศรษฐกิจโลกที่มีทิศทางชะลอตัวลง อีกทั้งความกังวลจากเรื่องความขัดแย้งด้านการค้าระหว่างญี่ปุ่นกับเกาหลีใต้ ด้านสภาพ เศรษฐกิจญี่ปุ่นส่งสัญญาณชะลอตัวลง และยังคงขาดนโยบายกระตุ้นเศรษฐกิจขนาดใหญ่ที่จะช่วยเป็นแรงส่งให้ตลาดญี่ปุ่น อย่างไรก็ตาม ธนาคารกลางญี่ปุ่นยังดำเนินนโยบายการเงินที่ผ่อนคลายต่อไปเพื่อกระตุ้นเศรษฐกิจ

ณ สิ้นเดือนกรกฎาคม 2562 กองทุนหลักมีการลงทุนในหุ้นหมวดเครื่องใช้ไฟฟ้า 18.6% หมวดค้าปลีก 14.3% หมวด Information and Communication 11.7% และหมวดเคมีภัณฑ์ 8.5% เป็นต้น

แนวโน้มการลงทุน

กองทุนหลักยังคงมีมุมมองบวกต่อการลงทุนในตลาดญี่ปุ่น เนื่องจากตลาดญี่ปุ่นยังถือว่าเป็นตลาดที่ Laggard และ valuation ยังอยู่ต่ำกว่า ค่าเฉลี่ย ด้านบริษัทญี่ปุ่นเองก็มีการปรับโครงสร้างเพื่อให้ทำกำไรได้มากขึ้น อย่างไรก็ตาม ตลาดญี่ปุ่นยังมีแนวโน้มได้รับแรงกดดันจาก เงินเยนที่แข็งค่าตามความไม่แน่นอนในตลาดที่มากขึ้น ทั้งจากความเสี่ยงเรื่องสงครามการค้า และเศรษฐกิจโลกที่ชะลอตัว อีกทั้งความ เสี่ยงที่รัฐบาลจะปรับ sales tax ขึ้นเป็น 10% ในตุลาคมนี้

บริษัท ขอขอบพระคุณท่านผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุนที่ได้มอบความไว้วางใจให้บริษัทฯ เป็นผู้บริหารเงินลงทุนของท่าน ทั้งนี้ บริษัทฯ จะ พิจารณาดำเนินนโยบายการลงทุนที่เหมาะสมกับสถานการณ์ด้วยความระมัดระวัง และคำนึงถึงผลประโยชน์สูงสุดของผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุน เป็นสำคัญ

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด

รายงานของผู้ดูแลผลประโยชน์

เรียน ผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุน
กองทุนเปิดกรุงศรีเจแปนอควิตีอินเด็กซ์เฮดจ์เอฟเอ็กซ์

ตามที่ธนาคารสแตนดาร์ดชาร์เตอร์ด (ไทย) จำกัด (มหาชน) (“ธนาคาร”) ในฐานะผู้ดูแลผลประโยชน์ กองทุนเปิดกรุงศรีเจแปนอควิตีอินเด็กซ์เฮดจ์เอฟเอ็กซ์ (“กองทุน”) ได้ปฏิบัติหน้าที่เป็นผู้ดูแลผลประโยชน์ของกองทุน ซึ่งบริหารและจัดการโดยบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด สำหรับรอบระยะเวลาตั้งแต่ วันที่ 1 มีนาคม 2562 ถึง วันที่ 31 สิงหาคม 2562

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

ธนาคารสแตนดาร์ดชาร์เตอร์ด (ไทย) จำกัด (มหาชน)



(นางสาวนุชจรินทร์ เพชรปานีวงศ์)
ผู้อำนวยการ

ธนาคารสแตนดาร์ดชาร์เตอร์ด (ไทย) จำกัด (มหาชน)
9 กันยายน 2562

โทรศัพท์ 02-724-5421
กรุณาติดต่อ คุณจิระประภา ชงไชย 

กองทุนเปิดกรุงศรีเจแปนอควิตี้อินเต็กซ์เสคจ์เอฟเอ็กซ์

งบดุล

ณ 31 สิงหาคม 2562

	Unaudited (บาท)
สินทรัพย์	
เงินลงทุนตามราคายุติธรรม (ราคาทุน 276,478,373.58 บาท)	266,641,059.12
เงินฝากธนาคาร	2,438,134.81
ลูกหนี้สัญญาแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ	658,932.98
ลูกหนี้	
จากดอกเบี้ย	2,819.30
จากการขายหน่วยลงทุน	4,257.28
รวมสินทรัพย์	269,745,203.49
หนี้สิน	
เจ้าหนี้	
จากการรับซื้อคืนหน่วยลงทุน	110,825.23
ค่าธรรมเนียมลับเปลี่ยนหน่วยลงทุน	246,049.86
ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย	255,907.33
หนี้สินอื่น	6,347.42
หนี้สินรวม	619,129.84
สินทรัพย์สุทธิ	269,126,073.65
สินทรัพย์สุทธิ:	
หน่วยลงทุนจดทะเบียน 300 ล้านหน่วย มูลค่าที่ตราไว้หน่วยละ 10 บาท	
ทุนที่ได้รับจากผู้ถือหน่วยลงทุน	242,982,316.28
กำไรสะสม	26,179,689.57
บัญชีปรับสมดุล	(35,932.20)
สินทรัพย์สุทธิ	269,126,073.65
สินทรัพย์สุทธิต่อหน่วย	11.0759
จำนวนหน่วยลงทุนที่จำหน่ายได้แล้วทั้งหมด ณ วันสิ้นสุด (หน่วย)	24,298,231.6280

กองทุนเปิดกรุงศรีเจแปนอควิตี้อินเด็คส์เฮดจ์เอฟเอ็กซ์
งบกำไรขาดทุน
สำหรับงวดบัญชีสิ้นสุดวันที่ 31 สิงหาคม 2562

	Unaudited (บาท)
รายได้จากการลงทุน	
รายได้ดอกเบี้ย	32,833.22
รายได้เงินปันผล	3,865,136.17
รายได้ทั้งสิ้น	<u>3,897,969.39</u>
ค่าใช้จ่าย	
ค่าธรรมเนียมการจัดการ	970,710.78
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์	51,771.31
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน	194,142.18
ค่าธรรมเนียมสอบบัญชี	35,191.55
ค่าใช้จ่ายอื่น	282.68
ค่าใช้จ่ายทั้งสิ้น	<u>1,252,098.50</u>
รายได้จากการลงทุนสุทธิ	<u>2,645,870.89</u>
รายการกำไร (ขาดทุน) สุทธิจากเงินลงทุน	
รายการกำไร (ขาดทุน) สุทธิที่เกิดขึ้นทั้งสิ้น	2,728,479.22
รายการกำไร (ขาดทุน) สุทธิที่ยังไม่เกิดขึ้นทั้งสิ้น	(6,343,679.65)
รวมรายการกำไร (ขาดทุน) ที่เกิดขึ้นและยังไม่เกิดขึ้น	<u>(3,615,200.43)</u>
การเพิ่มขึ้นในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงาน	<u><u>(969,329.54)</u></u>

กองทุนเปิดกรุงศรีเจแปนอควิตี้อินเด็กซ์เฮดจ์เอฟเอ็กซ์

งบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน

ณ 31 สิงหาคม 2562

การแสดงรายละเอียดเงินลงทุนใช้การจัดกลุ่มตามประเภทของเงินลงทุนและประเภทของอุตสาหกรรม

						Unaudited
ประเภทเงินลงทุน/ผู้ออกตราสาร/ผู้ออกหลักทรัพย์	หมายเลขตราสาร	อัตรา	วันครบอายุ	เงินต้น (บาท) /	มูลค่ายุติธรรม	ร้อยละของ
		ดอกเบี้ย		จำนวนหุ้น	(บาท)	มูลค่า
		(%)				เงินลงทุน
หลักทรัพย์ในประเทศ						
เงินฝากออมทรัพย์						
						2.64
บมจ.ธ.ทิสโก้		0.750000	เมื่อทวงถาม	5,014,644.75	5,014,644.75	1.88
บมจ.ธ.ยูโอบี		0.850000	เมื่อทวงถาม	2,014,530.70	2,014,530.70	0.76
หลักทรัพย์ต่างประเทศ						
หน่วยลงทุน						
						97.36
Nikkei 225 Exchange Traded Fund	JP3027650005			269,449,198.13	259,611,883.67	97.36
จำนวน 42,650.000000 หน่วย						
มูลค่าหน่วยละ 21,170.0000 JPY						
รวมเป็นเงิน 902,900,500.00 JPY						
					266,641,059.12	100.00

กองทุนเปิดกรุงศรีเจแปนอิควิตี้อินเต็กซ์เสดจ์เอฟเอ็กซ์

รายละเอียดการลงทุน ณ 31 สิงหาคม 2562

	มูลค่าตามราคาตลาด	% NAV
หลักทรัพย์หรือทรัพย์สินในประเทศ	9,470,129.56	3.52
เงินฝากธนาคาร		
TRIS		
Rate A	5,015,881.24	1.86
FITCH-LONG		
Rate AA+	2,439,154.66	0.91
FITCH_TH-LONG		
Rate AAA	2,015,093.66	0.75
หลักทรัพย์หรือทรัพย์สินต่างประเทศ	259,611,883.67	96.46
หน่วยลงทุน		
จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์	259,611,883.67	96.46
สัญญาซื้อขายล่วงหน้า	658,932.98	0.24
สัญญาที่อ้างอิงกับอัตราแลกเปลี่ยน-สัญญาแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ		
TRIS		
Rate A+	(126,427.04)	(0.05)
FITCH-LONG		
Rate AA+	99,340.78	0.04
Rate AA	1,133,792.64	0.42
Rate AA-	(447,773.40)	(0.17)
อื่นๆ	(614,872.56)	(0.22)
ลูกหนี้	4,257.28	0.00
เจ้าหนี้	(363,222.51)	(0.12)
ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย	(255,907.33)	(0.10)
มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ	269,126,073.65	100.00

กองทุนเปิดกรุงศรีเจแปนอภิวิตีอินเต็กซ์เฮดจ์เอฟเอ็กซ์

รายละเอียดการลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ณ 31 สิงหาคม 2562

ประเภทสัญญา	คู่สัญญา	วัตถุประสงค์	มูลค่าสัญญา (Notional Amount)	% NAV	วันครบกำหนด	กำไร/ขาดทุน (net gain/loss)
สัญญาที่อ้างอิงกับอัตราแลกเปลี่ยน						
สัญญาฟอว์เวิร์ด	บมจ.ธ.กรุงศรีอยุธยา	ป้องกันความเสี่ยง	18,381,370.93	(0.0269)	24 ก.ย. 2562	(72,458.99)
สัญญาฟอว์เวิร์ด	บมจ.ธ.กรุงศรีอยุธยา	ป้องกันความเสี่ยง	24,259,121.79	(0.1395)	30 ก.ย. 2562	(375,314.41)
สัญญาฟอว์เวิร์ด	บมจ.ธ.กสิกรไทย	ป้องกันความเสี่ยง	5,757,368.62	(0.0099)	17 ก.ย. 2562	(26,633.83)
สัญญาฟอว์เวิร์ด	บมจ.ธ.กสิกรไทย	ป้องกันความเสี่ยง	12,579,525.00	(0.0035)	17 ก.ย. 2562	(9,450.00)
สัญญาฟอว์เวิร์ด	บมจ.ธ.กสิกรไทย	ป้องกันความเสี่ยง	15,377,106.00	0.0711	7 ต.ค. 2562	191,426.32
สัญญาฟอว์เวิร์ด	บมจ.ธ.กสิกรไทย	ป้องกันความเสี่ยง	33,818,456.29	0.1478	28 ต.ค. 2562	397,745.54
สัญญาฟอว์เวิร์ด	บมจ.ธ.กสิกรไทย	ป้องกันความเสี่ยง	35,549,042.20	0.0396	5 พ.ย. 2562	106,558.64
สัญญาฟอว์เวิร์ด	บมจ.ธ.กรุงไทย	ป้องกันความเสี่ยง	12,859,623.83	0.0369	7 ต.ค. 2562	99,340.78
สัญญาฟอว์เวิร์ด	บมจ.ธ.ไทยพาณิชย์	ป้องกันความเสี่ยง	21,334,174.21	0.0228	3 ก.ย. 2562	61,480.70
สัญญาฟอว์เวิร์ด	บมจ.ธ.ไทยพาณิชย์	ป้องกันความเสี่ยง	29,060,000.00	0.0932	15 ต.ค. 2562	250,900.00
สัญญาฟอว์เวิร์ด	บมจ.ธ.ไทยพาณิชย์	ป้องกันความเสี่ยง	18,740,657.58	0.0601	21 ต.ค. 2562	161,765.27
สัญญาฟอว์เวิร์ด	บมจ.ธ.ทหารไทย	ป้องกันความเสี่ยง	21,292,595.20	(0.0074)	3 ก.ย. 2562	(19,901.70)
สัญญาฟอว์เวิร์ด	บมจ.ธ.ทหารไทย	ป้องกันความเสี่ยง	19,277,369.60	(0.0462)	9 ก.ย. 2562	(124,463.70)
สัญญาฟอว์เวิร์ด	บมจ.ธ.ทหารไทย	ป้องกันความเสี่ยง	21,939,906.45	0.0067	12 พ.ย. 2562	17,938.36

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)

กองทุนเปิดกรุงศรีเจแปนอควิตีอินเต็กซ์เฮดจ์เอฟเอ็กซ์

ตั้งแต่วันที่ 1 มีนาคม 2562 ถึงวันที่ 31 สิงหาคม 2562

ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (Fund's Direct Expenses)	จำนวนเงิน (หน่วย: พันบาท)	ร้อยละของมูลค่า ทรัพย์สิน* (ต่อปี) 1/
ค่าธรรมเนียมการจัดการ (Management Fee)	970.71	0.8025
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ (Trustee Fee)	51.77	0.0428
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน (Registrar Fee)	194.14	0.1605
ค่าที่ปรึกษาการลงทุน (Advisory Fee)	-	-
ค่าธรรมเนียมสอบบัญชี (Auditing Fee)	35.19	0.0291
ค่าใช้จ่ายอื่น ๆ (Others)	-	-
รวมค่าใช้จ่ายทั้งหมด 2/	1,251.81	1.0349

หมายเหตุ

1/ ค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวมข้างต้น เป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่มหรือภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว

2/ ไม่รวมค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ และค่าธรรมเนียมต่าง ๆ ที่เกิดขึ้นจากการซื้อขายหลักทรัพย์

* มูลค่าทรัพย์สิน ในที่นี้ หมายถึง มูลค่าทรัพย์สินทั้งหมด หักด้วย มูลค่าหนี้สินทั้งหมด

เว้นแต่ค่าธรรมเนียมการจัดการ ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ ค่าธรรมเนียมนายทะเบียนหน่วยลงทุน
และค่าใช้จ่ายที่เกี่ยวข้องกับการปฏิบัติการกองทุน ณ วันที่คำนวณ

ค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์
กองทุนเปิดกรุงศรีเจแปนอีควิตี้อินเดกซ์เฮดจ์เอฟเอ็กซ์ / Krungsri Japan Equity Index Hedged FX Fund
ตั้งแต่วันที่ 1 มีนาคม 2562 ถึงวันที่ 31 สิงหาคม 2562

บริษัท	จำนวนเงิน (เยน)	อัตราส่วน (%)
Maybank Kim Eng Securities Pte LTtd.	1,162,496.00	93.42
DBS Vickers Securities (Singapore) Co.,Ltd.	81,893.00	6.58
รวม / Total	1,244,389.00	100.00

ผลการดำเนินงานของกองทุนเปิดกรุงศรีเจแปนอควิตี้อินเด็กซ์เฮดจ์เอฟเอ็กซ์

ผลการดำเนินงาน สิ้นสุด ณ วันที่ 30 ส.ค. 2562	% 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 (31 มีนาคม 2560)
KF-HJPINDEX	4.41%	0.70%	-1.86%	-7.58%	N/A	N/A	N/A	4.32%
ดัชนีชี้วัด (Benchmark)*	5.37%	1.02%	-1.66%	-7.58%	N/A	N/A	N/A	5.09%
ความผันผวนของผลการดำเนินงาน	13.66%	13.33%	13.27%	16.61%	N/A	N/A	N/A	14.66%
ความผันผวนของตัวชี้วัด	14.03%	12.11%	12.35%	16.15%	N/A	N/A	N/A	15.41%

หมายเหตุ : * ดัชนีชี้วัด (Benchmark) คือ ดัชนี Nikkei 225 ในสกุลเงินเยน ปรับด้วยต้นทุนการป้องกันความเสี่ยงด้านอัตราแลกเปลี่ยน เพื่อ
เทียบค่าสกุลเงินบาท ณ วันที่คำนวณผลตอบแทน

** ผลตอบแทนที่มีอายุเกินหนึ่งปีจะแสดงเป็นผลตอบแทนต่อปี

เอกสารการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวมฉบับนี้ ได้จัดทำตามมาตรฐานการวัดผลดำเนินงาน
ของกองทุนรวมของสมาคมบริษัทจัดการลงทุน

ข้อมูลอื่นๆ ที่ผู้ถือหน่วยลงทุนควรทราบ

(1) รายงานบุคคลที่เกี่ยวข้องที่มีการทำธุรกรรมในรอบเวลาที่ผ่านมา (วันที่ 1 มีนาคม 2562 ถึงวันที่ 31 สิงหาคม 2562)

ชื่อกองทุน	รายชื่อบุคคลที่เกี่ยวข้อง
กองทุนเปิดกรุงศรีเจแปนอิควิตี้อินเต็กซ์เสดจ์เอฟเอ็กซ์	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 30 สิงหาคม 2562

1. นายวิฑูร เอื้ออาพันธ์
2. นายทลิต โชคทิพย์พัฒนา
3. นายสาริต บัวชู
4. นางสาวสาวณี สุขศรีวงศ์
5. นายปิติ ประดิพัทธ์พงษ์
6. นายจตุรนต์ สอนไว
7. นายชูศักดิ์ อวยพรชัยสกุล
8. นายพลสิทธิ์ อาหุณย์
9. นายพงศ์สัมพันธ์ อนุรัตน์
10. นางสาววรรดา ดันติสุนทร

(3) การเปิดเผยข้อมูลการถือหน่วยลงทุนเกิน 1 ใน 3 ณ วันที่ 30 สิงหาคม 2562

ไม่มีการถือหน่วยลงทุนเกิน 1 ใน 3 ของกลุ่มบุคคลใดบุคคลหนึ่ง

ผู้ถือหน่วยลงทุนสามารถตรวจสอบข้อมูลสัดส่วนการถือหน่วยลงทุนของบุคคลหรือกลุ่มบุคคลโดยตรงได้ที่ www.krungsriasset.com

(4) อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุนของกองทุน (portfolio turnover ratio) ในรอบระยะเวลาที่ผ่านมา เท่ากับ 89.05%

(5) ผลการดำเนินงานและข้อมูลการลงทุนของกองทุนหลัก (ข้อมูล ณ วันที่ 30/08/2019)

Cumulative Return	1 month	3 months	6 months	1 year	3 years	Since Incep.
NAV per unit	-3.7%	-1.2%	-4.0%	-9.4%	23.1%	72.9%
Benchmark Index	-3.8%	0.5%	-3.2%	-9.5%	22.6%	69.2%

(Since Inception 7/9/2001)

Sector Allocation	(% of NAV)
ELECTRIC APPLIANCES	18.7%
RETAIL TRADE	14.3%
INFORMATION & COMMUNICATION	11.3%
CHEMICALS	8.4%
PHARMACEUTICAL	7.9%
Others	39.0%
Total	99.7%

Asset Allocation	
Common Stocks	99.7%
Call Loan, Others	0.3%
(Index Futures)	0.3%

Top 10 Holdings	Sector	(% of NAV)
9983 FAST RETAILING CO.,LTD.	RETAIL TRADE	10.9%
9984 SOFTBANK GROUP CORP.	INFORMATION & COMMUNICATION	5.1%
8035 TOKYO ELECTRON LIMITED	ELECTRIC APPLIANCES	3.3%
6954 FANUC CORPORATION	ELECTRIC APPLIANCES	3.2%
9433 KDDI CORPORATION	INFORMATION & COMMUNICATION	3.0%
6367 DAIKIN INDUSTRIES,LTD.	MACHINERY	2.3%
6971 KYOCERA CORPORATION	ELECTRIC APPLIANCES	2.2%
4543 TERUMO CORPORATION	PRECISION INSTRUMENTS	2.2%
4063 SHIN-ETSU CHEMICAL CO.,LTD.	CHEMICALS	1.9%
8028 FAMILYMART UNY HOLDINGS CO.,LTD.	RETAIL TRADE	1.7%
Total		35.8%

Number of Holdings :
225