



krungsri

Asset
Management

Make Life
Simple

A member of MUFG
a global financial group

รายงานประจำปีแรก 2565

รอบระยะเวลาตั้งแต่วันที่ 1 มีนาคม 2565 – 31 สิงหาคม 2565

กองทุนรวม

KFJPINDEX

กองทุนเปิดกรุงศรีเจแปนเอควิตี้อินเด็กซ์เฮดจ์เอฟ/เอ็กซ์

Krungsri Japan Equity Index Hedged FX Fund

กองทุนนี้มีการแบ่งชนิดหน่วยลงทุนเป็น 2 ชนิด ได้แก่

1. หน่วยลงทุนชนิดสะสมมูลค่า :

กองทุนเปิดกรุงศรีเจแปนเอควิตี้อินเด็กซ์เฮดจ์เอฟ/เอ็กซ์-สะสมมูลค่า (ชื่อย่อ : KFJPINDEX-A)

2. หน่วยลงทุนชนิดผู้ลงทุนสถาบัน :

กองทุนเปิดกรุงศรีเจแปนเอควิตี้อินเด็กซ์เฮดจ์เอฟ/เอ็กซ์-ผู้ลงทุนสถาบัน (ชื่อย่อ : KFJPINDEX-I)
(เริ่มเปิดทำการขายหน่วยลงทุนชนิดผู้ลงทุนสถาบัน ตั้งแต่วันที่ 2 ธันวาคม 2564 เป็นต้นไป)

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 2565

กองทุนเปิดกรุงศรีเจแปนอิควิตี้อินเด็กซ์เฮดจ์เอฟเอ็กซ์

● สารบัญจัดการ	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) ขอส่งรายงานสำหรับรอบระยะเวลา 6 เดือน ของกองทุนเปิดกรุงศรี เจแปนอีควิตีอินเด็กซ์เฮดจ์เอฟเอ็กซ์ (KFJPINDEX) ตั้งแต่วันที่ 1 มีนาคม 2565 ถึงวันที่ 31 สิงหาคม 2565 มายังผู้ถือหน่วยลงทุน โดยมีรายละเอียดดังนี้

ผลการดำเนินงาน

กองทุนเปิดกรุงศรีเจแปนอีควิตีอินเด็กซ์เฮดจ์เอฟเอ็กซ์ มีมูลค่าทรัพย์สินสุทธิ ณ วันที่ 31 สิงหาคม 2565 เท่ากับ 213.28 ล้านบาท คิดเป็นมูลค่าทรัพย์สินสุทธิต่อหน่วยลงทุนเท่ากับ 14.5208 บาท โดยมีผลการดำเนินงานย้อนหลัง 6 เดือน เพิ่มขึ้นร้อยละ 5.90 น้อยกว่าเกณฑ์มาตรฐานการวัดผลการดำเนินงาน ที่เพิ่มขึ้นร้อยละ 6.62

ภาวะการลงทุนในช่วงที่ผ่านมา

ในรอบครึ่งปีที่ผ่านมากองทุน Next Funds Nikkei 225 ETF (กองทุนหลัก) ปรับตัวดีขึ้นราว 3.8% โดยตลาดญี่ปุ่นยังคงมีความผันผวน ถึงแม้จะทยอยฟื้นตัวขึ้นมาบ้างก็ตาม โดยในช่วงที่ผ่านมาทางรัฐบาลญี่ปุ่นเริ่มมีการผ่อนคลายมาตรการล็อกดาวน์ โดยเริ่มเปิดรับนักท่องเที่ยวต่างประเทศมากขึ้น ทั้งนี้ ตลาดญี่ปุ่นได้รับแรงส่งจากเงินเยนที่อ่อนค่าลงต่อเนื่อง โดยค่าเงินเยนอ่อนค่าลงไปแตะระดับ 140 USD/JPY หลังจากธนาคารกลางสหรัฐฯ (Fed) ดำเนินนโยบายการเงินที่เข้มงวดขึ้นโดย Fed มีการขึ้นดอกเบี้ยนโยบายต่อเนื่อง และเริ่มทำ Quantitative Tightening (QT) ขณะที่ทางธนาคารกลางญี่ปุ่นยังคงใช้นโยบายการเงินแบบผ่อนคลาย โดยยังคงอัตราดอกเบี้ยนโยบายในระดับต่ำและคงมาตรการ yield curve control ส่งผลให้ผลตอบแทนระหว่างพันธบัตรรัฐบาลญี่ปุ่นและอเมริกาปรับตัวกว้างมากขึ้น โดยเงินเยนที่อ่อนค่าจะส่งผลดีต่อกลุ่มธุรกิจส่งออกของญี่ปุ่น อย่างไรก็ตาม หากเงินเยนส่งสัญญาณอ่อนตัวลงต่อเนื่องอย่างรวดเร็วอาจเพิ่มความผันผวนให้กับตลาดญี่ปุ่นได้

ณ สิ้นเดือนกรกฎาคม 2565 กองทุนหลักมีการลงทุนในหมวดเครื่องใช้ไฟฟ้า 22.5% หมวด Information & Communication 11.8% หมวด Retail trade 11.6% และหมวดเกษตรกรรม 7.2% เป็นต้น

แนวโน้มการลงทุน

การลงทุนในตลาดญี่ปุ่นมีทิศทางดีขึ้น โดยเฉพาะหลังจากที่ญี่ปุ่นเริ่มคลายมาตรการล็อกดาวน์ โดยญี่ปุ่นทยอยเปิดรับนักท่องเที่ยวต่างชาติมากขึ้น นอกจากนี้ รายได้บริษัทจดทะเบียนที่ญี่ปุ่นยังคงมีแนวโน้มฟื้นตัวต่อเนื่อง ประกอบกับการดำเนินนโยบายการเงินที่ยังผ่อนคลายของธนาคารกลางญี่ปุ่นซึ่งจะช่วยสนับสนุนการฟื้นตัวของเศรษฐกิจในปีนี้อย่างยิ่ง นอกจากนี้ ตลาดญี่ปุ่นยังถือเป็นตลาด laggards หากเทียบกับกลุ่มตลาดประเทศพัฒนาแล้ว อย่างไรก็ตาม ความผันผวนในตลาดญี่ปุ่นจะมีมากขึ้นจากการดำเนินนโยบายการเงินที่เข้มงวดขึ้นของ Fed และอัตราเงินเฟ้อทั่วโลกที่เพิ่มสูงขึ้น อีกทั้ง ความเสี่ยงการเมืองระหว่างประเทศ โดยเฉพาะจีนและสหรัฐฯ อีกทั้ง สงครามระหว่างรัสเซียและยูเครนที่ยืดเยื้อ

บริษัทฯ ใคร่ขอขอบพระคุณท่านผู้ถือหน่วยลงทุนที่ได้มอบความไว้วางใจให้บริษัทฯ เป็นผู้บริหารเงินลงทุนของท่าน ทั้งนี้ บริษัทฯ จะพิจารณาดำเนินนโยบายการลงทุนที่เหมาะสมกับสถานการณ์ด้วยความระมัดระวัง และคำนึงถึงผลประโยชน์สูงสุดของผู้ถือหน่วยลงทุนเป็นสำคัญ

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด



รายงานของผู้ดูแลผลประโยชน์

เรียน ผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุน
กองทุนเปิดกรุงศรีเจแปนอควิตีอินเด็กซ์เฮดจ์เอฟเอ็กซ์

ตามที่ธนาคารสแตนดาร์ดชาร์เตอร์ด (ไทย) จำกัด (มหาชน) (“ธนาคารฯ”) ในฐานะผู้ดูแลผลประโยชน์ กองทุนเปิดกรุงศรีเจแปนอควิตีอินเด็กซ์เฮดจ์เอฟเอ็กซ์ (“กองทุน”) ได้ปฏิบัติหน้าที่เป็นผู้ดูแลผลประโยชน์ของกองทุน ซึ่งบริหารและจัดการโดยบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด สำหรับรอบระยะเวลาตั้งแต่ วันที่ 1 มีนาคม 2565 ถึง วันที่ 31 สิงหาคม 2565

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

ธนาคารสแตนดาร์ดชาร์เตอร์ด (ไทย) จำกัด (มหาชน)

(นางสาวนุชจรินทร์ เพชรปานีวงศ์)

ผู้อำนวยการ

ธนาคารสแตนดาร์ดชาร์เตอร์ด (ไทย) จำกัด (มหาชน)

7 กันยายน 2565

โทรศัพท์ 02-724-5421

กรุณาติดต่อ คุณจิระประภา ธงไชย N.

กองทุนเปิดกรุงศรีเจแปนอควิตี้อินเต็กซ์เสคจ์เอฟเอ็กซ์

งบแสดงฐานะการเงิน

ณ 31 สิงหาคม 2565

	Unaudited (บาท)
สินทรัพย์	
เงินลงทุนตามราคายุติธรรม (ราคาทุน 207,859,310.70 บาท)	206,826,329.05
เงินฝากธนาคาร	4,082,012.39
ลูกหนี้จากสัญญาอนุพันธ์	2,516,361.63
ลูกหนี้	
จากดอกเบี้ย	1,828.93
จากการขายหน่วยลงทุน	713,644.46
จากเงินปันผล	3,388,288.79
รวมสินทรัพย์	217,528,465.25
หนี้สิน	
เจ้าหนี้จากสัญญาอนุพันธ์	100,001.92
เจ้าหนี้	
จากการรับซื้อคืนหน่วยลงทุน	99,108.53
จากการซื้อเงินลงทุน	3,787,319.39
ค่าธรรมเนียมสับเปลี่ยนหน่วยลงทุน	3,009.85
ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย	256,397.60
ภาษีเงินได้ค้างจ่าย	274.33
หนี้สินอื่น	4,838.15
รวมหนี้สิน	4,250,949.77
สินทรัพย์สุทธิ	213,277,515.48
สินทรัพย์สุทธิ:	
หน่วยลงทุนจดทะเบียน 300 ล้านหน่วย มูลค่าที่ตราไว้หน่วยละ 10 บาท	
ทุนที่ได้รับจากผู้ถือหน่วยลงทุน	146,876,661.02
กำไรสะสม	57,881,088.07
บัญชีปรับสมดุล	8,519,766.39
สินทรัพย์สุทธิ	213,277,515.48
ชนิดสะสมมูลค่า	
สินทรัพย์สุทธิ	213,277,515.48
หน่วยลงทุนที่ออกจำหน่ายแล้ว ณ วันสิ้นปี (หน่วย)	14,687,666.1019
สินทรัพย์สุทธิต่อหน่วย	14.5208

กองทุนเปิดกรุงศรีเจแปนอควิตี้อินเตอร์เนชั่นแนลเอฟเอ็กซ์
งบกำไรขาดทุนเบ็ดเสร็จ
สำหรับงวดบัญชีสิ้นสุดวันที่ 31 สิงหาคม 2565

	Unaudited (บาท)
รายได้จากการลงทุน	
รายได้ดอกเบี้ย	5,487.61
รายได้เงินปันผล	3,422,368.54
รวมรายได้	<u>3,427,856.15</u>
ค่าใช้จ่าย	
ค่าธรรมเนียมการจัดการ	969,861.38
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์	38,794.45
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน	193,972.29
ค่าธรรมเนียมวิชาชีพ	35,287.52
ค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์	24,497.75
รวมค่าใช้จ่าย	<u>1,262,413.39</u>
รายได้จากการลงทุนสุทธิ	<u>2,165,442.76</u>
รายการกำไร (ขาดทุน) สุทธิจากเงินลงทุน	
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิที่เกิดขึ้นจากเงินลงทุน	(84,486.85)
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิที่ยังไม่เกิดขึ้นจากเงินลงทุน	14,335,960.38
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิที่ยังไม่เกิดขึ้นจากสัญญาอนุพันธ์	(2,248,161.61)
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิจากอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ	1,653,077.42
รวมรายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิจากเงินลงทุนที่เกิดขึ้นและยัง ไม่เกิดขึ้น	<u>13,656,389.34</u>
หัก ภาษีเงินได้	(823.12)
การเพิ่มขึ้นในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงานหลังหักภาษีเงินได้	<u>15,821,008.98</u>
การเพิ่มขึ้นในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงานแยกตามชนิดหน่วยลงทุน มีดังนี้	
ชนิดสะสมมูลค่า	15,821,008.98
รวม	<u>15,821,008.98</u>

กองทุนเปิดกรุงศรีเจแปนอควิตี้อินเด็คส์เฮดจ์เอฟเอ็กซ์

งบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน

ณ 31 สิงหาคม 2565

การแสดงรายละเอียดเงินลงทุนใช้การจัดกลุ่มตามประเภทของเงินลงทุนและประเภทของอุตสาหกรรม

ประเภทเงินลงทุน/ผู้ออกตราสาร/ผู้ออกหลักทรัพย์	หมายเลขตราสาร	อัตรา		เงินต้น (บาท) / จำนวนหุ้น	มูลค่ายุติธรรม (บาท)	Unaudited ร้อยละ ของมูลค่า เงินลงทุน
		ดอกเบี้ย	วันครบอายุ			
		(%)				
หลักทรัพย์ในประเทศ						
เงินฝากออมทรัพย์						1.48
บมจ.ธ.ทิสโก้		0.150000	เมื่อทวง	22,916.41	22,916.41	0.01
บมจ.ธ.ยูโอบี		0.250000	เมื่อทวง	3,030,752.11	3,030,752.11	1.47
หลักทรัพย์ต่างประเทศ						
หน่วยลงทุน						98.52
NEXT FUNDS Nikkei 225 Exchange Traded Fund	JP3027650005			204,805,642.18	203,772,660.53	98.52
จำนวน 26,890.000000 หน่วย						
มูลค่าหน่วยละ 28,795.0000 JPY						
รวมเป็นเงิน 774,297,550.00 JPY						
					206,826,329.05	100.00

กองทุนเปิดกรุงศรีเจแปนอภีวีทีอินเต็กซ์เฮดจ์เอฟเอ็กซ์

รายละเอียดการลงทุน ณ 31 สิงหาคม 2565

	มูลค่าตามราคาตลาด	% NAV
หลักทรัพย์หรือทรัพย์สินในประเทศ	7,137,509.84	3.34
เงินฝากธนาคาร		
TRIS		
Rate A	22,922.55	0.01
FITCH-LONG		
Rate A-	4,082,281.02	1.91
FITCH_TH-LONG		
Rate AAA	3,032,306.27	1.42
หลักทรัพย์หรือทรัพย์สินต่างประเทศ	203,772,660.53	95.54
หน่วยลงทุน		
จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์	203,772,660.53	95.54
สัญญาซื้อขายล่วงหน้า	2,416,359.71	1.13
สัญญาที่อ้างอิงกับอัตราแลกเปลี่ยน-สัญญาแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ		
TRIS		
Rate A+	(35,934.20)	(0.02)
Rate A	265,274.60	0.12
FITCH-LONG		
Rate AA	2,187,019.31	1.03
อื่นๆ	(49,014.60)	(0.01)
ลูกหนี้	4,101,933.25	1.92
เจ้าหนี้	(3,894,550.25)	(1.81)
ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย	(256,397.60)	(0.12)
มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ	213,277,515.48	100.00

กองทุนเปิดกรุงศรีเจแปนอิคิวตีอินเด็กซ์เสดจ์เอฟเอ็กซ์

รายละเอียดการลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ณ 31 สิงหาคม 2565

ประเภทสัญญา	คู่สัญญา	วัตถุประสงค์	มูลค่าสัญญา (Notional Amount)	% NAV	วันครบกำหนด	กำไร/ขาดทุน (net gain/loss)
สัญญาที่อ้างอิงกับอัตราแลกเปลี่ยน						
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ธ.เกียรตินาคิน	ป้องกันความเสี่ยง	20,831,348.93	0.1244	14 พ.ย. 2565	265,274.60
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ธนาคารไทยพาณิชย์	ป้องกันความเสี่ยง	53,698,171.26	0.5679	12 ก.ย. 2565	1,211,185.97
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ธนาคารไทยพาณิชย์	ป้องกันความเสี่ยง	33,321,353.88	(0.0120)	25 ต.ค. 2565	(25,689.24)
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ธนาคารไทยพาณิชย์	ป้องกันความเสี่ยง	12,401,016.20	(0.0180)	25 ต.ค. 2565	(38,378.48)
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ธนาคารไทยพาณิชย์	ป้องกันความเสี่ยง	7,434,146.55	0.0110	14 พ.ย. 2565	23,476.55
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ธนาคารไทยพาณิชย์	ป้องกันความเสี่ยง	10,663,840.18	0.0479	14 พ.ย. 2565	102,147.90
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ธนาคารไทยพาณิชย์	ป้องกันความเสี่ยง	45,828,898.95	0.4050	14 พ.ย. 2565	863,795.23
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ธนาคารไทยพาณิชย์	ป้องกันความเสี่ยง	37,889,714.60	0.0237	6 ธ.ค. 2565	50,481.38
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ธ.ทหารไทยธนชาติ	ป้องกันความเสี่ยง	3,794,788.37	(0.0035)	2 ก.ย. 2565	(7,468.98)
สัญญาฟอร์เวิร์ด	บมจ.ธ.ทหารไทยธนชาติ	ป้องกันความเสี่ยง	12,469,464.90	(0.0133)	25 ต.ค. 2565	(28,465.22)

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)

กองทุนเปิดกรุงศรีเจแปนอควิตีอินเด็กซ์เฮดจ์เอฟเอ็กซ์

ตั้งแต่วันที่ 1 มีนาคม 2565 ถึงวันที่ 31 สิงหาคม 2565

ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (Fund's Direct Expenses)	จำนวนเงิน (หน่วย: พันบาท)	ร้อยละของมูลค่า ทรัพย์สิน* (ต่อปี) 1/
ค่าธรรมเนียมการจัดการ (Management Fee)	969.86	0.8025
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ (Trustee Fee)	38.79	0.0321
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน (Registrar Fee)	193.97	0.1605
ค่าที่ปรึกษาการลงทุน (Advisory Fee)	-	-
ค่าธรรมเนียมสอบบัญชี (Auditing Fee)	35.29	0.0292
ค่าใช้จ่ายอื่น ๆ (Others)	-	-
รวมค่าใช้จ่ายทั้งหมด 2/	1,237.91	1.0243

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 2565 ถึงวันที่ 31 สิงหาคม 2565

บริษัท	จำนวนเงิน	อัตราส่วน
	(เยน)	(%)
Maybank Kim Eng Securities Pte LTtd.	247,628.00	100.00
รวม / Total	247,628.00	100.00

ผลการดำเนินงานของกองทุนเปิดกรุงศรีเจแปนอควิตีอินเต็กซ์เฮดจ์เอฟเอ็กซ์

ผลการดำเนินงาน สิ้นสุด ณ วันที่ 31 ส.ค. 2565	% 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)
KFJPINDEX-A	-2.51%	2.79%	5.90%	0.62%	9.43%	7.08%	N/A	7.12%
ดัชนีชี้วัด (Benchmark)*	-1.66%	3.44%	6.62%	1.21%	12.04%	8.91%	N/A	8.89%
ความผันผวนของผลการดำเนินงาน	20.17%	17.81%	20.18%	19.33%	20.05%	18.40%	N/A	17.83%
ความผันผวนของตัวชี้วัด	16.12%	14.55%	16.65%	17.29%	21.26%	19.43%	N/A	18.89%

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

** ผลตอบแทนที่มีอายุเกินหนึ่งปีจะแสดงเป็นผลตอบแทนต่อปี

เอกสารการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวมฉบับนี้ ได้จัดทำตามมาตรฐานการวัดผลดำเนินงาน
ของกองทุนรวมของสมาคมบริษัทจัดการลงทุน

ข้อมูลอื่นๆ ที่ผู้ถือหน่วยลงทุนควรทราบ

(1) รายงานบุคคลที่เกี่ยวข้องที่มีการทำธุรกรรมในรอบเวลาที่ผ่านมา (วันที่ 1 มีนาคม 2565 ถึงวันที่ 31 สิงหาคม 2565)

ชื่อกองทุน	รายชื่อบุคคลที่เกี่ยวข้อง
กองทุนเปิดกรุงศรีเจแปนอภิวัดอินเดียนเคสเคเอฟเอ็กซ์	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 2565

- | | |
|------------------|-----------------|
| 1. นายทลิต | โชคทิพย์พัฒนา |
| 2. นายสาธิต | บัวชู |
| 3. นางสาวสาวิณี | สุขศรีวงศ์ |
| 4. นายปิติ | ประติพัทธ์พงษ์ |
| 5. นายกวิฬ | เหรียญเสาวภาคย์ |
| 6. นายจตุรันต์ | สอนไว |
| 7. นายชูศักดิ์ | อวยพรชัยสกุล |
| 8. นายพงศ์สันต์ | อนรรจน์ |
| 9. นางสาววรดา | คันติสุนทร |
| 10. นายวัชรินทร์ | คังตังซ์ |

(3) การเปิดเผยข้อมูลการถือหน่วยลงทุนเกิน 1 ใน 3 ณ วันที่ 31 สิงหาคม 2565

ไม่มีการถือหน่วยลงทุนเกิน 1 ใน 3 ของบุคคลใดบุคคลหนึ่ง

ผู้ถือหน่วยลงทุนสามารถตรวจสอบข้อมูลสัดส่วนการถือหน่วยลงทุน โดยตรงได้ที่ www.krungsriasset.com

(4) อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุนของกองทุน (portfolio turnover ratio) ในรอบระยะเวลาที่ผ่านมา เท่ากับ 14.66%

(5) ผลการดำเนินงานและข้อมูลการลงทุนของกองทุนหลัก (ข้อมูล ณ วันที่ 31/08/2022)

Return	1 month	3 months	6 months	1 year	3 years	Since Incep.
NAV (dividend re-invested)	1.1%	3.1%	7.0%	1.8%	42.7%	207.3%

(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)
9983	FAST RETAILING CO.,LTD.	RETAIL TRADE	10.1%
8035	TOKYO ELECTRON LIMITED	ELECTRIC APPLIANCES	5.5%
9984	SOFTBANK GROUP CORP.	INFORMATION & COMMUNICATION	4.1%
9433	KDDI CORPORATION	INFORMATION & COMMUNICATION	3.2%
6367	DAIKIN INDUSTRIES,LTD.	MACHINERY	3.0%
6954	FANUC CORPORATION	ELECTRIC APPLIANCES	2.8%
4543	TERUMO CORPORATION	PRECISION INSTRUMENTS	2.2%
4063	SHIN-ETSU CHEMICAL CO.,LTD.	CHEMICALS	2.0%
6857	ADVANTEST CORPORATION	ELECTRIC APPLIANCES	2.0%
6971	KYOCERA CORPORATION	ELECTRIC APPLIANCES	1.9%
Total			36.8%

Number of Holdings :
225

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

Sector Allocation	(% of NAV)
ELECTRIC APPLIANCES	22.4%
RETAIL TRADE	11.8%
INFORMATION & COMMUNICATION	11.6%
PHARMACEUTICAL	7.2%
CHEMICALS	7.0%
Others	38.8%
Total	98.7%