

รายงานสถานะการลงทุน

รอบระยะเวลาบัญชี 6 เดือน

กองทุนเปิดซีไอเอ็มบี-พรินซิเพิล โกลบอล แมเนจ โวลาทิลิตี้ อิกวิตี

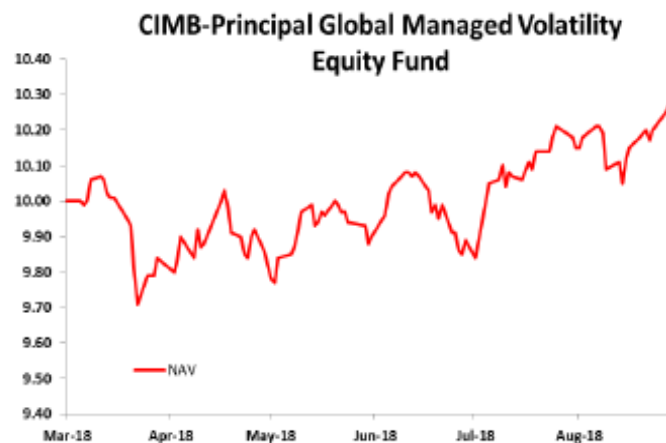
ตั้งแต่วันที่ 2 มีนาคม 2561 - 31 สิงหาคม 2561

เรียน ท่านผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุน

บริษัทหลักทรัพย์จัดการลงทุน ซีไอเอ็มบี-พริ้นซิเพิล จำกัด (บลจ.ซีไอเอ็มบี-พริ้นซิเพิล) ขอนำเสนอรายงานสำหรับระยะเวลา ตั้งแต่ วันที่ 2 มีนาคม 2561 ถึง วันที่ 31 สิงหาคม 2561 ของกองทุนเปิดซีไอเอ็มบี-พริ้นซิเพิล โกลบอล แมเนจ โวลิตีตี้คิวคิวดี มีนโยบายลงทุนใน หน่วยลงทุนของกองทุน Acadian Global Managed Volatility Equity UCITS Fund ชนิดหน่วยลงทุน (Share Class) A USD Accumulation โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน โดยมีเป้าหมายเพื่อมุ่งหาผลตอบแทนที่ เทียบเท่าหรือสูงกว่า MSCI World Index แต่มีความผันผวนน้อยกว่าตลาด บริษัทจัดการอาจลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) เพื่อป้องกันความเสี่ยงที่เกี่ยวข้องกับอัตราแลกเปลี่ยนเงินตรา ที่อาจเกิดขึ้นได้จากการลงทุนในต่างประเทศตามความเหมาะสมและ สภาพการณ์ในแต่ละขณะขึ้นอยู่กับดุลยพินิจของผู้จัดการกองทุน

ในรอบบัญชีที่ผ่านมา ผลการดำเนินงานของกองทุนปรับตัวเพิ่มขึ้นร้อยละ 2.31 โดยในช่วงต้นปีที่ผ่านมาตลาดหุ้นทั่วโลกได้ปรับตัว ลงจากความกังวลว่าเศรษฐกิจสหรัฐฯฟื้นตัวได้ดีกว่าประเทศอื่นอย่างโดดเด่น ในขณะที่ราคาน้ำมันดิบก็ปรับตัวเพิ่มขึ้นอย่างต่อเนื่องตาม สต็อกน้ำมันที่ลดลงจากการลดกำลังผลิตของกลุ่ม OPEC และรัสเซีย ส่งผลให้เกิดแรงกดดันด้านอัตราเงินเฟ้อในทางอ้อม และนักลงทุนส่วนใหญ่เริ่มกลับมากังวลถึงการปรับขึ้นอัตราดอกเบี้ยของธนาคารกลางสหรัฐฯ ว่าจะมากถึง 4 ครั้งในปีนี้ หลังจากที่เคยประมาณการไว้ในปีที่ 3 ครั้ง รวมไปถึงสงครามการค้าระหว่างประเทศสหรัฐฯ กับคู่ค้าโดยเฉพาะประเทศจีน อย่างไรก็ตามในช่วงไตรมาสสองเป็นต้นมาตลาดหุ้น ประเทศพัฒนาแล้ว โดยเฉพาะตลาดหุ้นสหรัฐฯได้ฟื้นตัวขึ้นอย่างต่อเนื่อง สนับสนุนโดยตัวเลขทางเศรษฐกิจต่างๆ และตัวเลขการจ้างงานที่ ออกมาอย่างต่อเนื่อง รวมไปถึง fund flow ที่ออกจากตลาดประเทศเกิดใหม่

สำหรับมุมมองในอนาคตคาดว่าตลาดหุ้นทั่วโลกจะผันผวนต่อเนื่องตามกระแสข่าวสงครามการค้า และการดำเนินนโยบายทาง การเงินของธนาคารกลางสหรัฐฯ ยุโรป ญี่ปุ่น และจีน อย่างไรก็ตามการลงทุนในหุ้นที่มีความผันผวนต่ำในสภาวะที่สถานการณ์ต่างๆในการ ลงทุนมีความไม่แน่นอนสูง จะช่วยลดความผันผวนของพอร์ตโฟลิโอโดยรวมลงได้



สุดท้ายนี้ บลจ.ซีไอเอ็มบี-พริ้นซิเพิล ขอขอบคุณท่านผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุนทุกท่าน ที่ได้มอบความไว้วางใจลงทุนในกองทุนรวมของ บลจ.ซีไอเอ็มบี-พริ้นซิเพิล

ขอแสดงความนับถือ

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ซีไอเอ็มบี-พริ้นซิเพิล จำกัด



ธนาคารกสิกรไทย
开泰银行 KASIKORNBANK



ความเห็นของผู้ดูแลผลประโยชน์

เรียน ผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุน กองทุนเปิดซีไอเอ็มบี-พริ้นซิเพิล โกลบอล แมเนจ โวลาคิลิตี้ อีควิตี้

ข้าพเจ้า บมจ. ธนาคารกสิกรไทย ในฐานะผู้ดูแลผลประโยชน์ ได้ดูแลการจัดการ กองทุนเปิดซีไอเอ็มบี-พริ้นซิเพิล โกลบอล แมเนจ โวลาคิลิตี้ อีควิตี้ ซึ่งจัดการโดยบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ซีไอเอ็มบี-พริ้นซิเพิล จำกัด ตั้งแต่วันที่ 2 มีนาคม พ.ศ. 2561 ถึงวันที่ 31 สิงหาคม พ.ศ. 2561 แล้ว

ข้าพเจ้าเห็นว่า บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ซีไอเอ็มบี-พริ้นซิเพิล จำกัด ได้ ปฏิบัติหน้าที่ในการจัดการกองทุนเปิดซีไอเอ็มบี-พริ้นซิเพิล โกลบอล แมเนจ โวลาคิลิตี้ อีควิตี้ เหมาะสมตามสมควรแห่งวัตถุประสงค์ที่ได้กำหนดไว้ในโครงการ และ ภายใต้พระราชบัญญัติ หลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535

ผู้ดูแลผลประโยชน์
บมจ. ธนาคารกสิกรไทย


(นางศิริพร ทองธานี)

รองผู้อำนวยการ ฝ่ายบริการธุรกิจหลักทรัพย์


(นายเอกพัฒน์ กมลวุฒิพงศ์)

ผู้ช่วยผู้อำนวยการ ฝ่ายบริการธุรกิจหลักทรัพย์

วันที่ 7 กันยายน พ.ศ. 2561

Fund Name: CIMB-P GMV-A
Balance Date: ศ. 31 ส.ค. 2018
Inception: ศ. 2 มี.ค. 2018

ผลการดำเนินงาน ณ วันที่ 31 สิงหาคม 2561
มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ (บาท) 1,157,196,850.77
มูลค่าหน่วยลงทุน (บาท) 10.2305

ผลตอบแทนย้อนหลัง	ผลตอบแทนของ กองทุน	เกณฑ์มาตรฐาน*	ค่าเบี่ยงเบน มาตรฐาน	Information Ratio
3 เดือน	2.90%	3.07%	3.15%	-0.08
6 เดือน	n/a	n/a	n/a	n/a
1 ปี ¹	n/a	n/a	n/a	n/a
3 ปี ¹	n/a	n/a	n/a	n/a
5 ปี ¹	n/a	n/a	n/a	n/a
10 ปี ¹	n/a	n/a	n/a	n/a
YTD	n/a	n/a	n/a	n/a
ตั้งแต่จัดตั้งกองทุน ²	2.31%	4.10%	4.84%	-0.49

¹ % ต่อปี (Annualized Return)

² % ต่อปี (Annualized Return) หากกองทุนจัดตั้งมาแล้ว 1 ปีขึ้นไป

*เกณฑ์มาตรฐาน MXWO Index 100.00%

**เกณฑ์มาตรฐานที่ใช้ในอดีต -

Fund Name: CIMB-P GMV-C
Balance Date: ศ. 31 ส.ค. 2018
Inception: จ. 9 ก.ค. 2018

ผลการดำเนินงาน ณ วันที่ 31 สิงหาคม 2561
มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ (บาท) 10,798,258.08
มูลค่าหน่วยลงทุน (บาท) 10.2584

ผลตอบแทนย้อนหลัง	ผลตอบแทนของ กองทุน	เกณฑ์มาตรฐาน*	ค่าเบี่ยงเบน มาตรฐาน	Information Ratio
3 เดือน	n/a	n/a	n/a	n/a
6 เดือน	n/a	n/a	n/a	n/a
1 ปี ¹	n/a	n/a	n/a	n/a
3 ปี ¹	n/a	n/a	n/a	n/a
5 ปี ¹	n/a	n/a	n/a	n/a
10 ปี ¹	n/a	n/a	n/a	n/a
YTD	n/a	n/a	n/a	n/a
ตั้งแต่จัดตั้งกองทุน ²	2.12%	2.08%	2.07%	0.01

¹ % ต่อปี (Annualized Return)

² % ต่อปี (Annualized Return) หากกองทุนจัดตั้งมาแล้ว 1 ปีขึ้นไป

*เกณฑ์มาตรฐาน MXWO Index 100.00%

**เกณฑ์มาตรฐานที่ใช้ในอดีต -

FOR INSTITUTIONAL INVESTORS ONLY



GLOBAL MANAGED VOLATILITY EQUITY UCITS FUND

AUGUST 2018

The Acadian Global Managed Volatility Equity UCITS Fund will seek to achieve a return similar to or better than that of the MSCI World Index but with lower volatility over a full market cycle.

NAV
\$19.64 USD

FUND AUM: USD
\$1.2 BILLION

INCEPTION DATE
10 Feb 2012

FUND FACTS

See page 3 for available share classes, Bloomberg codes, ISINs, and fees.

Base Currency
EUR

Liquidity
Daily

Settlement
T+3

Yearly On-going Charges
0.88%

Deadline Date Cut-Off Time
14:00 GMT

Minimum Investment
\$1 MILLION

Volatility
65 – 75% of BM

Beta
0.60 – 0.70

Max Position Size
1.50%

Range of Holdings
300 – 700

PERFORMANCE*

Performance Currency: USD	FUND (NAV)	MSCI WORLD INDEX	VALUE-ADDED VS BENCHMARK
One Month Return	1.0	1.2	-0.2
Three Month Return	4.2	4.3	-0.1
Year-to-Date Return	2.5	4.8	-2.3
One Year Annualized Return	8.7	13.1	-4.4
Three Year Annualized Return	10.5	11.9	-1.4
Five Year Annualized Return	10.1	10.2	-0.1
SINCE INCEPTION ANNUALIZED RETURN	10.8	10.8	0.0
SINCE INCEPTION ANNUALIZED STANDARD DEVIATION AND ACTIVE RISK	8.2	10.0	5.0
SINCE INCEPTION SHARPE RATIO	1.3	1.0	
SINCE INCEPTION BETA	0.7	1.0	

■ Fund ■ MSCI World index ■ Active

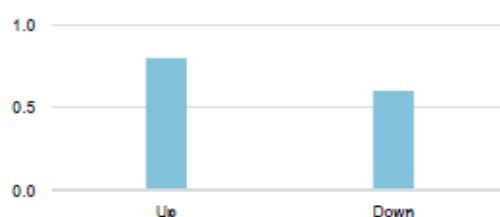
CUMULATIVE PERFORMANCE*

NAV RETURNS (%)



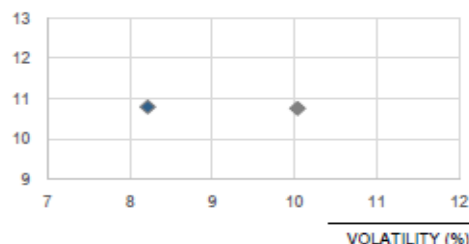
CAPTURE RATIO*

NAV RETURNS (%)



SINCE INCEPTION RISK/RETURN*

NAV RETURNS (%)



*Reference to the benchmark is for comparative purposes only and is not intended to indicate that the portfolio will contain the same investments as the benchmark. Investors have the opportunity for losses as well as profits. Past performance is no guarantee of future returns. Index Source: MSCI Copyright MSCI 2018. All Rights Reserved. Unpublished. PROPRIETARY TO MSCI. This document is directed solely at persons categorised as Professional Clients under MiFID. Retail Clients should not act or rely on the information contained in this document. Acadian Asset Management (UK) Limited is authorised and regulated by the Financial Conduct Authority – Reg No 460224.

ACADIAN ASSET MANAGEMENT LLC

FUND CHARACTERISTICS

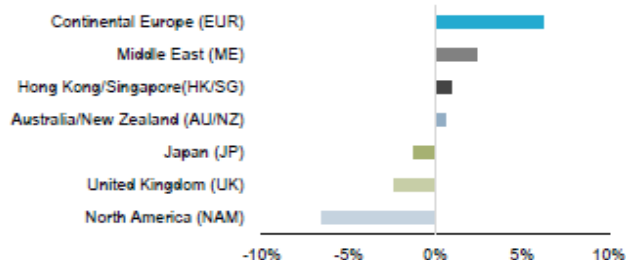
	FUND	MSCI WORLD INDEX
VALUATION		
Price/Earnings	19.2	19.4
Price/Book	2.3	2.5
Price/Sales	1.3	1.7
Price/Cash Earnings	11.8	12.0
Yield	2.5%	2.3%
MARKET CAP		
Large > \$50B	26.7%	56.6%
Med/Large \$20-\$50	16.7%	23.5%
Medium \$10-\$20	14.5%	12.8%
Med/Small \$3-\$10	27.5%	7.0%
Small < \$3	14.5%	0.1%
WEIGHTED AVERAGE (B)	53.0	170.8
MEDIAN (B)	2.0	13.8
ACTIVE SHARE OF PORTFOLIO (%)	84.9	

TOP TEN HOLDINGS

	% OF PORTFOLIO
CHEMED CORP	1.5
SWEDISH MATCH AB	1.4
HUMANA INC	1.4
ZOETIS INC	1.3
CLP HOLDINGS LTD	1.2
MASTERCARD INC	1.2
HOME DEPOT INC THE	1.2
ESTEE LAUDER COS INC THE	1.2
QUEST DIAGNOSTICS INC	1.1
PFIZER INC	1.1
NUMBER OF SECURITIES	548
% OF PORTFOLIO FOR TOP 20 CURRENT HOLDINGS	23.1
% OF NON-BENCHMARK PORTFOLIO HOLDINGS	32.2

CURRENT POSITIONING - REGION

ACTIVE

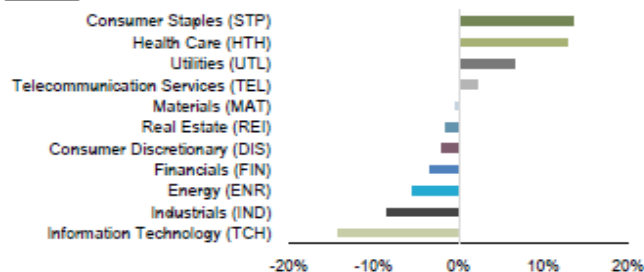


ABSOLUTE

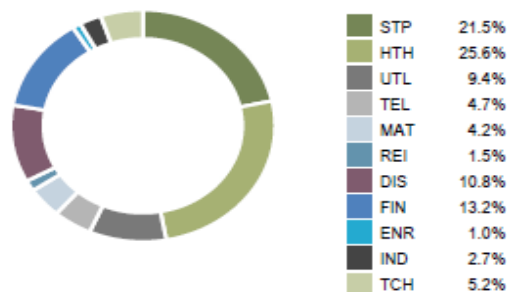


CURRENT POSITIONING - SECTOR

ACTIVE



ABSOLUTE



Portfolio holdings are subject to change and should not be considered a recommendation to buy or sell individual securities. Reference to the benchmark is for comparative purposes only and is not intended to indicate that the portfolio will contain the same investments as the benchmark. Investors have the opportunity for losses as well as profits. Past performance is no guarantee of future returns. Index Source: MSCI Copyright MSCI 2018. All Rights Reserved. Unpublished. PROPRIETARY TO MSCI. This document is directed solely at persons categorised as Professional Clients under MiFID. Retail Clients should not act or rely on the information contained in this document. Acadian Asset Management (UK) Limited is authorised and regulated by the Financial Conduct Authority – Reg No 460224.

FUND ANALYSIS

For the month of August, the UCITS saw return differential of -20 basis points (based on NAV returns). Stock selection was negative for return, as it was weaker than the index in several markets – including Sweden, the U.S., and Germany. Country allocations were negative in aggregate, driven by an emphasis on Austria and a relatively smaller exposure to the U.S. Sector allocations were also negative overall, largely due to a lower weighting in information technology and a higher weighting in consumer staples.

From a risk perspective, the overall weighting in the different risk quintiles, with the highest weighting in the lowest-risk quintile and the lowest weighting in the highest-risk quintile, had a positive impact on return. Stock selection more than offset this result, however, primarily in the second-highest risk quintile.

SHARE CLASS DETAILS

FUND BASE CURRENCY - EUR
BENCHMARK - MSCI WORLD (BB CODE: MXWO)

	MANAGEMENT FEE	ISIN	BLOOMBERG CODE	YEARLY ON-GOING CHARGES	MINIMUM INVESTMENT
Accum. Class Shares – USD	75bps	IE00B4T3NP37	RICAGMV ID	0.88%	US\$ 1 Million
Accum. Class C Shares – GBP	75bps	IE00B994MZ43	RICAGMC ID	0.88%	£ 1 Million
Accum. Class I Shares – EUR (Hedged)*	80bps	IE00BD1RP723	RICAGIE ID	0.93%	€ 1 Million

*Includes 5 bps currency hedging fee.

DISCLAIMER

Russell Investment Company Public Limited Company ("RIC") which is constituted as an investment company with variable capital incorporated under the laws of Ireland pursuant to the European Communities (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities) Regulations, 2003, as amended. RIC is an umbrella fund with segregated liability between sub-funds. Units in the Sub-Fund are offered subject to the terms and conditions of the latest prospectus. Pursuant to a money manager agreement (as amended and novated), Russell Investments Ireland Limited (the manager of RIC) has appointed Acadian Asset Management LLC as the money manager of the Sub-Fund. Russell Investments Limited (which is incorporated in England and Wales and is authorised and regulated by the Financial Conduct Authority) has been appointed as distributor to RIC. RIL has appointed Acadian Asset Management (UK) Limited as subdistributor of RIC.

BENCHMARK DISCLOSURE

+MSCI - Copyright MSCI 2018. All Rights Reserved. Without prior written permission of MSCI this information and any other MSCI intellectual property may only be used for your internal use, may not be reproduced or re-disseminated in any form and may not be used to create financial instruments or products or any indices. This information is provided on an "as is" basis, and the user of this information assumes the entire risk of any use of this information. Neither MSCI nor any third party involved in or related to the computing or compiling of the data makes any express or implied warranties, representations or guarantees concerning the MSCI index-related data, and in no event shall MSCI or any third party have any liability for any direct, indirect, special, punitive, consequential or any other damages (including lost profits) relating to any use of this information.

Applications for shares in the fund are subject to the terms and conditions set out in the fund's prospectus, Key Investor Information Document (KIID), memorandum and articles of association. Investors and potential investors are advised to read these documents (and in particular the risk warnings), as well as the further information contained in the annual and half-yearly reports before making an investment. Copies are available free of charge on request. For more information, please contact your Acadian representative or email AcadianUCITSFunds@acadian-asset.com. WARNING - The contents of this document have not been reviewed by any regulatory authority in Hong Kong. You are advised to exercise caution in relation to the offer. If you are in any doubt about any of the contents of this document, you should obtain independent professional advice. This document is directed solely at persons categorised as Professional Clients under MiFID. Retail Clients should not act or rely on the information contained in this document. Acadian Asset Management (UK) Limited is authorised and regulated by the Financial Conduct Authority – Reg No 460224.

GENERAL LEGAL DISCLAIMER

Acadian provides this material as a general overview of the firm, our processes and our investment capabilities. It has been provided for informational purposes only. It does not constitute or form part of any offer to issue or sell, or any solicitation of any offer to subscribe or to purchase, shares, units or other interests in investments that may be referred to herein and must not be construed as investment or financial product advice. Acadian has not considered any reader's financial situation, objective or needs in providing the relevant information.

The value of investments may fall as well as rise and you may not get back your original investment. Past performance is not necessarily a guide to future performance or returns. Acadian has taken all reasonable care to ensure that the information contained in this material is accurate at the time of its distribution, no representation or warranty, express or implied, is made as to the accuracy, reliability or completeness of such information.

This material contains privileged and confidential information and is intended only for the recipient/s. Any distribution, reproduction or other use of this presentation by recipients is strictly prohibited. If you are not the intended recipient and this presentation has been sent or passed on to you in error, please contact us immediately. Confidentiality and privilege are not lost by this presentation having been sent or passed on to you in error.

Acadian's quantitative investment process is supported by extensive proprietary computer code. Acadian's researchers, software developers, and IT teams follow a structured design, development, testing, change control, and review processes during the development of its systems and the implementation within our investment process. These controls and their effectiveness are subject to regular internal reviews, at least annual independent review by our SOC1 auditor. However, despite these extensive controls it is possible that errors may occur in coding and within the investment process, as is the case with any complex software or data-driven model, and no guarantee or warranty can be provided that any quantitative investment model is completely free of errors. Any such errors could have a negative impact on investment results.

We have in place control systems and processes which are intended to identify in a timely manner any such errors which would have a material impact on the investment process.

Acadian Asset Management LLC has wholly owned affiliates located in London, Singapore, Sydney, and Tokyo. Pursuant to the terms of service level agreements with each affiliate, employees of Acadian Asset Management LLC may provide certain services on behalf of each affiliate and employees of each affiliate may provide certain administrative services, including marketing and client service, on behalf of Acadian Asset Management LLC.

Acadian Asset Management LLC is registered as an investment adviser with the U.S. Securities and Exchange Commission. Registration of an investment adviser does not imply any level of skill or training.

Acadian Asset Management (Japan) is a Financial Instrument Operator (Discretionary Investment Management Business). Register Number Director-General Kanto Local Financial Bureau (Kinsho) Number 2814. Member of Japan Investment Advisers Association.

Acadian Asset Management (Singapore) Pte Ltd, (Registration Number: 199902125D) is licensed by the Monetary Authority of Singapore.

Acadian Asset Management (Australia) Limited (ABN 41 114 200 127) is the holder of Australian financial services license number 291872 ("AFSL").

Under the terms of its AFSL, Acadian Asset Management (Australia) Limited is limited to providing the financial services under its license to wholesale clients only. This marketing material is not to be provided to retail clients.

Acadian Asset Management (UK) Limited is authorized and regulated by the Financial Conduct Authority ("the FCA") and is a limited liability company incorporated in England and Wales with company number 05644066. Acadian Asset Management (UK) Limited will only make this material available to Professional Clients and Eligible Counterparties as defined by the FCA under the Markets in Financial Instruments Directive.



BOSTON LONDON SINGAPORE TOKYO SYDNEY

ACADIAN-ASSET.COM

กองทุนเปิดซีไอเอ็มบี-พริ้นซิเพิล โกลบอล แมเนจไวลาติตี้ อีควิตี้

งบดุล

ณ วันที่ 31 สิงหาคม 2561

	หมายเหตุ	บาท
สินทรัพย์		
เงินลงทุนตามมูลค่าสุทธิรวม (ราคาทุน 1,094,801,264.00 บาท)	2	1,131,034,661.92
เงินฝากธนาคาร		56,656,481.93
ลูกหนี้		
จากดอกเบี้ย		22,687.25
จากการขายหน่วยลงทุน		125,629,440.00
จากสัญญาอนุพันธ์		16,878,681.04
ค่าใช้จ่ายรอการตัดบัญชี		527,877.45
ลูกหนี้อื่น		792,656.01
สินทรัพย์อื่น		2,098,522.58
รวมสินทรัพย์		1,333,641,008.18
หนี้สิน		
เจ้าหนี้		
จากการรับซื้อคืนหน่วยลงทุน		163,002,818.20
จากสัญญาอนุพันธ์		10,720.00
ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย		2,563,028.48
หนี้สินอื่น		69,332.65
รวมหนี้สิน		165,645,899.33
สินทรัพย์สุทธิ		1,167,995,108.85
สินทรัพย์สุทธิ :		
ทุนที่ได้รับจากผู้ถือหน่วยลงทุน		1,141,641,394.86
กำไร (ขาดทุน) สะสม		
บัญชีปรับสมดุล		(4,932,489.29)
กำไร(ขาดทุน)สะสมจากการดำเนินงาน		31,286,203.28
สินทรัพย์สุทธิ		1,167,995,108.85
สินทรัพย์สุทธิต่อหน่วยที่คำนวณแยกตามประเภทผู้ถือหน่วยลงทุน มีดังนี้		
ชนิดสะสมมูลค่า		10.2305
ชนิดผู้ลงทุนกลุ่ม		10.2584
จำนวนหน่วยลงทุนที่จำหน่ายแล้วทั้งหมด (หน่วย) แยกตามประเภทผู้ถือหน่วยลงทุน มีดังนี้		
ชนิดสะสมมูลค่า		113,111,515.6793
ชนิดผู้ลงทุนกลุ่ม		1,052,623.8070
รวม		114,164,139.4863
หมายเหตุประกอบงบการเงินเป็นส่วนหนึ่งของงบการเงินนี้		

กองทุนเปิดซีไอเอ็มบี-พริ้นซิเพิล โกลบอล แวนเนจ โวลาทิลิตี อีควิตี้

งบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน

ณ วันที่ 31 สิงหาคม 2561

การแสดงรายละเอียดเงินลงทุนใช้การจัดกลุ่มตามประเภทของเงินลงทุน

ชื่อหลักทรัพย์	จำนวนหน่วย/ เงินต้น (หน่วย / บาท)	มูลค่ายุติธรรม (บาท)	ร้อยละของ มูลค่าเงินลงทุน
----------------	---	-------------------------	------------------------------

เงินลงทุนต่างประเทศ

Unit Trust Foreign Equity-US Dollar

Acadian Global Managed Volatility fund

1,760,249.51

1,131,034,661.92

100.00

รวม Unit Trust Foreign Equity-US Dollar

1,131,034,661.92

100.00

รวมเงินลงทุนต่างประเทศ

1,131,034,661.92

100.00

ยอดรวมเงินลงทุน (ราคาทุน 1,094,801,264.00 บาท)

1,131,034,661.92

100.00

กองทุนเปิดซีไอเอ็มบี-พริ้นซิเพิล โกลบอล แมเนจโวลิตีตี้ อีควิตี้

งบกำไรขาดทุน

สำหรับงวดหกเดือน ตั้งแต่วันที่ 2 มีนาคม 2561 (วันจดทะเบียนจัดตั้งกองทุน) ถึงวันที่ 31 สิงหาคม 2561

	บาท
รายได้จากการลงทุน	
รายได้ดอกเบี้ย	261,133.65
รายได้อื่น	2,351,164.30
รวมรายได้	2,612,297.95
ค่าใช้จ่าย	
ค่าธรรมเนียมการจัดการ	11,255,854.66
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์	225,117.12
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน	2,251,170.98
ค่าธรรมเนียมวิชาชีพ	19,607.66
ค่าใช้จ่ายอื่น	657,742.20
รวมค่าใช้จ่าย	14,409,492.62
ขาดทุนจากการลงทุนสุทธิ	(11,797,194.67)
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิจากเงินลงทุน	
รายการกำไรสุทธิที่เกิดขึ้นจากเงินลงทุน	7,965,676.97
รายการกำไรสุทธิที่ยังไม่เกิดขึ้นจากเงินลงทุน	36,233,397.92
รายการขาดทุนสุทธิที่เกิดขึ้นจากสัญญาอนุพันธ์	(77,514,445.20)
รายการกำไรสุทธิที่ยังไม่เกิดขึ้นจากสัญญาอนุพันธ์	16,867,961.04
รายการกำไรสุทธิที่เกิดขึ้นจากอัตราแลกเปลี่ยน	59,530,807.22
รวมรายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิจากเงินลงทุนที่เกิดขึ้นและที่ยังไม่เกิดขึ้น	43,083,397.95
การเพิ่มขึ้นในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงาน	31,286,203.28
การเพิ่มขึ้นในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงานแยกตามประเภทผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุน มีดังนี้	
<u>ประเภทผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุน</u>	
ชนิดสะสมมูลค่า	31,187,945.20
ชนิดผู้ลงทุนกลุ่ม	98,258.08
รวม	31,286,203.28

กองทุนเปิดซีไอเอ็มบี-พริ้นซิเพิล โกลบอล แมเนจ โวลาทิลิตี อีควิตี้

หมายเหตุประกอบงบการเงิน

สำหรับงวดหกเดือน ตั้งแต่วันที่ 2 มีนาคม 2561 (วัดจกทะเบียนจัดตั้งกองทุน) ถึงวันที่ 31 สิงหาคม 2561

1. ลักษณะของกองทุนเปิดซีไอเอ็มบี-พริ้นซิเพิล โกลบอล แมเนจ โวลาทิลิตี อีควิตี้

กองทุนเปิดซีไอเอ็มบี-พริ้นซิเพิล โกลบอล แมเนจ โวลาทิลิตี อีควิตี้ (“กองทุน”) จัดทะเบียนเป็นกองทุนรวมกับสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ (“ก.ล.ต.”) เมื่อวันที่ 2 มีนาคม 2561 มีเงินทุนจดทะเบียน 5,000 ล้านบาท (แบ่งเป็น 500 ล้านหน่วย มูลค่าหน่วยลงทุนละ 10 บาท) โดยมีบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ซีไอเอ็มบี-พริ้นซิเพิล จำกัด (“บริษัทจัดการ”) เป็นผู้จัดการกองทุนและนายทะเบียนหน่วยลงทุน และธนาคารกสิกรไทย จำกัด (มหาชน) เป็นผู้ดูแลผลประโยชน์ของกองทุน

กองทุนมีนโยบายการลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งหน่วยลงทุนของกองทุนรวมต่างประเทศเพียงกองทุนเดียว คือ Acadian Global Managed Volatility Equity UCITS Fund (กองทุนหลัก) ชนิดหน่วยลงทุน (Share Class) A USD Accumulation โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน (Feeder Fund) ซึ่งจดทะเบียนในประเทศไอร์แลนด์ โดยกองทุนบริหารและจัดการ โดย Russell Investments Ireland Limited และบริหารเงินลงทุนโดย Acadian Asset Management, LLC. โดยส่วนที่เหลือลงทุนในหลักทรัพย์อื่นใดที่ได้รับความเห็นชอบจากสำนักงาน กสท.

กองทุนมีนโยบายที่จะไม่จ่ายเงินปันผลให้แก่ผู้ถือหน่วยลงทุน

2. นโยบายการบัญชีที่สำคัญ

การวัดค่าเงินลงทุน

เงินลงทุนจะรับรู้เป็นสินทรัพย์ด้วยจำนวนต้นทุนของเงินลงทุน ณ วันที่กองทุนมีสิทธิในเงินลงทุน ต้นทุนของเงินลงทุนประกอบด้วยรายจ่ายซื้อเงินลงทุนและค่าใช้จ่ายโดยตรงทั้งสิ้นที่กองทุนจ่ายเพื่อให้ได้มาซึ่งเงินลงทุนนั้น

- เงินลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมต่างประเทศแสดงในงบดุลด้วยมูลค่ายุติธรรม โดยใช้ราคาหน่วยลงทุนราคาล่าสุด ณ วันที่วัดค่าเงินลงทุน
- หลักทรัพย์ที่เป็นตราสารหนี้ในประเทศแสดงด้วยมูลค่ายุติธรรม โดยใช้ราคาหรืออัตราผลตอบแทนที่ประกาศโดยสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย ณ วันที่วัดค่าเงินลงทุน

ถ้าหรือขาดทุนสุทธิที่ยังไม่เกิดขึ้นจากการปรับมูลค่าของเงินลงทุน ให้เป็นมูลค่ายุติธรรมจะรับรู้ในงบกำไรขาดทุน ณ วันที่วัดค่าเงินลงทุน

ราคาทุนของเงินลงทุนที่จำหน่ายใช้วิธีถัวเฉลี่ยถ่วงน้ำหนัก

การรับรู้รายได้

ดอกเบี้ยรับรู้เป็นรายได้ตามระยะเวลาที่พึงรับ

บัญชีส่วนเกินและส่วนลดมูลค่าตราสารหนี้ตัดจำหน่ายตามวิธีอัตราดอกเบี้ยที่แท้จริง ซึ่งยอดที่ตัดจำหน่ายนี้แสดงเป็นรายการปรับปรุงกับดอกเบี้ยรับ

กำไรหรือขาดทุน จากการจำหน่ายเงินลงทุนรับรู้เป็นรายได้หรือค่าใช้จ่าย ณ วันที่จำหน่ายเงินลงทุน

รายการที่เป็นเงินตราต่างประเทศ

บัญชีที่เป็นเงินตราต่างประเทศแปลงค่าเงินบาทโดยใช้อัตราแลกเปลี่ยน ณ วันเกิดรายการ และสัญญาซื้อขายเงินตราต่างประเทศล่วงหน้า ณ วันที่เกิดรายการ แปลงค่าเป็นเงินบาทโดยใช้อัตราตามสัญญา

กำไรหรือขาดทุนจากการแปลงค่าเงินตราต่างประเทศรับรู้เป็นรายได้หรือค่าใช้จ่ายในงบกำไรขาดทุน

ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนซีไอเอ็มบี-พริ้นซิเพิล โกลบอล แมเนจโวลาคิลิตี้ อีควิตี้
สำหรับงวดหกเดือน ตั้งแต่ 2 มีนาคม 2561 (วันจดทะเบียนจัดตั้งกองทุน) ถึงวันที่ 31 สิงหาคม 2561

ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุน * (Fund's Direct Expenses)	จำนวนเงิน (พันบาท)	% ของมูลค่า ทรัพย์สินสุทธิ
ค่าธรรมเนียมจัดการกองทุน (Management Fee)	11,255.85	0.805
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ (Trustee Fee)	225.12	0.016
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียนหน่วยลงทุน (Registrar Fee)	2,251.17	0.161
ค่าที่ปรึกษาการลงทุน (Advisory Fee)	ไม่มี	ไม่มี
ค่าธรรมเนียมการจัดตั้งกองทุน (Set Up Fee)	112.62	0.008
ค่าสอบบัญชี	19.61	0.001
ค่าใช้จ่ายอื่นๆ	60.34	0.004
ค่าโฆษณา ประชาสัมพันธ์และส่งเสริมการขาย		
ในช่วงเสนอขายหน่วยลงทุนครั้งแรก		
ภายหลังเสนอขายหน่วยลงทุนครั้งแรก	484.78	0.035
รวมค่าใช้จ่ายทั้งหมด **	14,409.49	1.030

หมายเหตุ * ค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายต่างๆ ได้รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดในตนเองเดียวกัน (ถ้ามี) ไว้แล้ว

** ไม่รวมค่าโฆษณาประชาสัมพันธ์และค่าธรรมเนียมต่างๆ ที่เกิดขึ้นจากการซื้อขายหลักทรัพย์

กองทุนเปิดซีไอเอ็มบี-พริ้นซิเพิล โกลบอล แมเนจโวลาคิลิตี้ อีควิตี้

ข้อมูลอัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุนของกองทุนรวม

สำหรับงวดหกเดือน ตั้งแต่ 2 มีนาคม 2561 (วันจดทะเบียนจัดตั้งกองทุน) ถึงวันที่ 31 สิงหาคม 2561

	(ร้อยละ)
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุนของกองทุนรวม	23.56

1. รายชื่อบุคคลที่เกี่ยวข้องที่มีการทำธุรกรรมกับกองทุนรวม

รายชื่อบุคคลที่เกี่ยวข้องที่มีการทำธุรกรรมกับกองทุนรวม กองทุนเปิดซีไอเอ็มบี-พริ้นซิเพิล โกลบอล แมเนจ โวลาติลิตี อีควิตี้ ตั้งแต่วันที่ 2 มีนาคม 2561 ถึงวันที่ 31 สิงหาคม 2561
- ไม่มี -
หมายเหตุ : ผู้ลงทุนสามารถตรวจสอบการทำธุรกรรมกับบุคคลที่เกี่ยวข้องกับกองทุนรวมได้ที่ บริษัทจัดการ โดยตรง หรือที่ website ของบริษัทจัดการ (www.cimb-principal.com) และสำนักงาน ก.ล.ต. (www.sec.or.th)

2. รายงานการรับผลประโยชน์ตอบแทนเนื่องจากการที่กองทุนใช้บริการบุคคลอื่น (Soft Commission)

รายงานการรับผลประโยชน์ตอบแทนเนื่องจากการที่กองทุนใช้บริการบุคคลอื่น (Soft Commission)
ของธุรกิจกองทุนรวม
- ไม่มีการรับผลประโยชน์ตอบแทนจากการใช้บริการบุคคลอื่น (Soft Commission) -

3. คำนวณหน้าทั้งหมดจากการที่บริษัทซื้อขายหลักทรัพย์ฯ

- ไม่มี - (เป็นการซื้อ/ขายหน่วยลงทุน)

4. รายละเอียดการลงทุน การกู้ยืมเงิน และการก่อภาระผูกพัน

รายละเอียดการลงทุน การกู้ยืมเงิน และการก่อภาระผูกพัน

ณ วันที่ 31 สิงหาคม 2561

รายละเอียดการลงทุน

กองทุนเปิดซีไอเอ็มบี-พริ้นซิเพิล โกลบอล แมเนจ โวลาติลิตี อีควิตี้

	มูลค่าตามราคาตลาด (บาท) ¹	% NAV
หลักทรัพย์หรือทรัพย์สินในประเทศ		
เงินฝากธนาคาร	56,678,841.69	4.85
เงินฝากธนาคารสกุลต่างประเทศ	327.49	0.00
หลักทรัพย์หรือทรัพย์สินต่างประเทศ		
หน่วยลงทุน ²	1,131,034,661.92	96.84
อื่น ๆ		
ทรัพย์สินอื่น	145,927,177.08	12.49
หนี้สินอื่น	(165,645,899.33)	(14.18)
มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ	1,167,995,108.85	100.00

หมายเหตุ : ¹ มูลค่าตามราคาตลาดที่รวมดอกเบี้ยค้างรับแล้ว

² หน่วยลงทุนกองทุน RICAGMV ID

รายงานสรุปจำนวนเงินลงทุนในตราสารแห่งหนึ่ง เงินฝากหรือตราสารกึ่งหนึ่งลงทุน ของกองทุนรวม

รายงานสรุปเงินลงทุน

กองทุนเปิดซีไอเอ็มบี-พริ้นซิเพิล โกลบอล แมเนจ โวลาทิลิตี้ อีควิตี้

กลุ่มของตราสาร	มูลค่าตาม ราคาตลาด (บาท)*	% NAV
(ก) ตราสารภาครัฐไทยและตราสารภาครัฐต่างประเทศ		
- ตราสารภาครัฐไทย	- ไม่มี -	- ไม่มี -
- ตราสารภาครัฐต่างประเทศ	- ไม่มี -	- ไม่มี -
(ข) ตราสารที่ธนาคารที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้น ธนาคารพาณิชย์ หรือบริษัทเงินทุน เป็นผู้ออก ผู้ส่งจ่าย ผู้รับรอง ผู้รับอาวัล ผู้สลับหลัง หรือ ผู้ค้ำประกัน	56,678,841.69	4.85
(ค) ตราสารที่มีอันดับความน่าเชื่อถืออยู่ในอันดับที่สามารถลงทุนได้ (investment grade)	- ไม่มี -	- ไม่มี -
(ง) ตราสารที่มีอันดับความน่าเชื่อถืออยู่ในอันดับต่ำกว่าอันดับที่สามารถลงทุนได้ (investment grade) หรือตราสารที่ไม่ได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือ	- ไม่มี -	- ไม่มี -
สัดส่วนเงินลงทุนขั้นสูง (upper limit) ที่บริษัทจัดการคาดว่าจะลงทุนในตราสารกลุ่ม (ง) 15% NAV		
หมายเหตุ : * มูลค่าตามราคาตลาดที่รวมดอกเบี้ยค้างรับแล้ว		

รายละเอียดตัวตราสารและอันดับความน่าเชื่อถือของตราสารทุกตัวใน Port

กองทุนเปิดซีไอเอ็มบี-พริ้นซิเพิล โกลบอล แมเนจ โวลาทิลิตี้ อีควิตี้

ประเภท	ผู้ออก	ผู้ค้ำ/ ผู้ รับรอง/ ผู้สลับ หลัง	วันครบ กำหนด	อันดับ ความ น่าเชื่อถือ	จำนวนเงินต้น/ มูลค่าหน้าตั๋ว	มูลค่าตาม ราคาตลาด ¹
1 เงินฝาก	ธนาคารสแตนดาร์ดชาร์เตอร์ด (ไทย) จำกัด (มหาชน)	-	-	A-	56,656,481.93	56,678,841.69
หมายเหตุ :	¹ มูลค่าตามราคาตลาดที่รวมดอกเบี้ยค้างรับแล้ว					

5. สัดส่วนผู้ถือหุ้นหน่วยเกิน 1 ใน 3 (%)

- ร้อยละ :



บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ซีไอเอ็มบี-พริ้นซิเพิล จำกัด

44 อาคารซีไอเอ็มบี ไทย ชั้น16 ถนนหลังสวน แขวงลุมพินี เขตปทุมวัน กรุงเทพฯ 10330

โทรศัพท์ 0 2686 9500 โทรสาร 0 2657 3167 www.cimb-principal.com