



krungsri

Asset
Management

Make Life
Simple

A member of  MUFG
a global financial group

รายงานประจำปีแรก 2564

รอบระยะเวลาตั้งแต่วันที่ 1 มกราคม 2564 – 30 มิถุนายน 2564

กองทุนรวม

KFCASH

กองทุนเปิดกรุงศรีตราสารเงิน

Krungsri Cash Management Fund

กองทุนนี้มีการแบ่งชนิดหน่วยลงทุนเป็น 2 ชนิด ได้แก่

1. หน่วยลงทุนชนิดสะสมมูลค่า :

กองทุนเปิดกรุงศรีตราสารเงิน-สะสมมูลค่า (ชื่อย่อ : KFCASH-A)

2. หน่วยลงทุนชนิดเพื่อการออม :

กองทุนเปิดกรุงศรีตราสารเงิน-เพื่อการออม (ชื่อย่อ : KFCASHSSF)

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

อาคารเพลีนจิตทาวเวอร์ 898 ถนนเพลินจิต แขวงลุมพินี

เขตปทุมวัน กรุงเทพฯ 10330

โทรศัพท์ +66 (0) 2657 5757 โทรสาร +66 (0) 2657 5777

www.krungsriasset.com

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด

รายงานประจำปีครั้งแรก 2564

กองทุนเปิดกรุงศรีตราสารเงิน

● สารบัญจัดการ	3
● รายงานผู้ดูแลผลประโยชน์	5
● งบแสดงฐานะการเงิน งบกำไรขาดทุนเบ็ดเสร็จ และงบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน	6
● รายละเอียดเงินลงทุน การกู้ยืมเงิน และการก่อภาระผูกพันของกองทุนรวม	9
● ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม	14
● ผลการดำเนินงาน	15
● ข้อมูลอื่นๆ ที่ผู้ถือหน่วยลงทุนควรทราบ	16
- รายงานบุคคลที่เกี่ยวข้องที่มีการทำธุรกรรมในรอบเวลาที่ผ่านมา	
- การรับผลประโยชน์ตอบแทนเนื่องจากการใช้บริการบุคคลอื่นๆ	
- รายชื่อผู้จัดการกองทุน	
- การเปิดเผยข้อมูลการถือหน่วยลงทุนเกิน 1 ใน 3	
- อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุนของกองทุน	

เรียน ผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุน

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด (บริษัทฯ) ขอส่งรายงานสำหรับรอบระยะเวลา 6 เดือน ของกองทุนเปิดกรุงศรีตราสารเงิน (KFCASH) ตั้งแต่วันที่ 1 มกราคม 2564 ถึงวันที่ 30 มิถุนายน 2564 มายังผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุน โดยมีรายละเอียดดังนี้

ผลการดำเนินงาน

กองทุนเปิดกรุงศรีตราสารเงิน มีมูลค่าทรัพย์สินสุทธิ ณ วันที่ 30 มิถุนายน 2564 ซึ่งแบ่งตามชนิดหน่วยลงทุน ดังนี้

- KFCASH-A จำนวน 12,956.96 ล้านบาท คิดเป็นมูลค่าทรัพย์สินสุทธิต่อหน่วยลงทุน 13.3376 บาท
 - KFCASHSSF จำนวน 87.93 ล้านบาท คิดเป็นมูลค่าทรัพย์สินสุทธิต่อหน่วยลงทุน 13.3377 บาท
- และมีผลการดำเนินงานย้อนหลัง 6 เดือน โดยแบ่งตามชนิดหน่วยลงทุน ได้แก่
- KFCASH-A เพิ่มขึ้นร้อยละ 0.06 น้อยกว่าเกณฑ์มาตรฐานการวัดผลการดำเนินงาน ที่เพิ่มขึ้นร้อยละ 0.16
 - KFCASHSSF เพิ่มขึ้นร้อยละ 0.06 น้อยกว่าเกณฑ์มาตรฐานการวัดผลการดำเนินงาน ที่เพิ่มขึ้นร้อยละ 0.16

ภาวะการลงทุนในช่วงที่ผ่านมา

ไตรมาสที่ 1 ปี 2564 อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลปรับตัวเพิ่มขึ้นประมาณร้อยละ +0.05 ถึง +1.00 ในลักษณะที่ส่งผลให้ความชันของเส้นอัตราผลตอบแทนปรับตัวเพิ่มขึ้นอย่างมีนัยสำคัญ สอดคล้องกับการเคลื่อนไหวของอัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลสหรัฐฯ ที่ปรับตัวเพิ่มขึ้นอย่างมีนัยสำคัญเช่นกัน ทั้งนี้มีสาเหตุมาจากความคาดหวังของนักลงทุนต่อการฟื้นตัวทางเศรษฐกิจภายหลังที่การกระจายวัคซีนมีความคืบหน้าในหลายประเทศทั่วโลก นอกจากนี้การประกาศใช้มาตรการกระตุ้นเศรษฐกิจขนาดใหญ่ของสหรัฐฯ เพื่อสนับสนุนการฟื้นตัวทางเศรษฐกิจ ส่งผลให้นักลงทุนเริ่มมีความกังวลว่าอัตราเงินเฟ้ออาจเร่งตัวขึ้นเร็วกว่าที่ธนาคารกลางและตลาดคาด และทำให้อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลสหรัฐฯ ปรับตัวเพิ่มขึ้นอย่างรวดเร็วและส่งผลกระทบต่อมายังตลาดตราสารหนี้ไทย สำหรับตลาดตราสารหนี้ภาคเอกชนอัตราผลตอบแทนยังคงปรับตัวลดลงจากส่วนต่างของอัตราผลตอบแทนตราสารหนี้ภาคเอกชนและพันธบัตรรัฐบาลที่ปรับลดลงอย่างต่อเนื่องโดยเฉพาะในกลุ่มตราสารหนี้ที่มีอันดับเครดิต A ขึ้นไป

สำหรับแนวโน้มของสภาวะเศรษฐกิจไทยในไตรมาสที่ 2 ปี 2564 คาดว่าในระยะสั้นจะได้รับแรงสนับสนุนจากการดำเนินนโยบายทางการเงินแบบผ่อนคลายและฐานต่ำจากปีที่แล้ว หากแต่ในระยะกลางถึงยาวจากการฟื้นตัวของเศรษฐกิจและแนวโน้มอัตราเงินเฟ้อ คาดว่าอัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลจะยังคงมีแนวโน้มปรับเพิ่มขึ้น นอกจากนี้อัตราผลตอบแทนยังคงเผชิญความผันผวนตามกระแสของเงินทุนไหลเข้า-ออกจากต่างประเทศ โดยปัจจัยสำคัญที่ต้องติดตามคือความคืบหน้าในการพัฒนาและประสิทธิผลของวัคซีนในการยับยั้งการแพร่ระบาดของโรค Covid-19 และการฟื้นตัวของเศรษฐกิจภายในประเทศโดยเฉพาะในภาคการท่องเที่ยวและบริการ

ไตรมาสที่ 2 ปี 2564 อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลอายุต่ำกว่า 3 ปีปรับตัวเพิ่มขึ้นประมาณร้อยละ 0.00 ถึง +0.05 ในขณะที่อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลอายุตั้งแต่ 3 ปีขึ้นไปปรับตัวลดลงประมาณร้อยละ -0.05 ถึง -0.25 ส่งผลให้ความชันของเส้นอัตราผลตอบแทนปรับตัวลดลง สอดคล้องกับการเคลื่อนไหวของเส้นอัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลสหรัฐฯ โดยในการประชุมเมื่อเดือนมิถุนายน ธนาคารกลางสหรัฐฯ (Fed) มีมติคงอัตราดอกเบี้ยระยะสั้นที่ระดับร้อยละ 0.00-0.25 และคงปริมาณการซื้อพันธบัตรตามมาตรการผ่อนคลายเชิงปริมาณ เนื่องจากคณะกรรมการยังคงมีความเห็นว่าการจ้างงานและอัตราเงินเฟ้อยังคงอยู่ห่างจากเป้าหมายของธนาคารกลาง อย่างไรก็ตามคณะกรรมการมีการอภิปรายเกี่ยวกับการปรับลดปริมาณการซื้อพันธบัตรหากเศรษฐกิจฟื้นตัวอย่างรวดเร็ว และส่งสัญญาณว่าอาจมีการปรับขึ้นอัตราดอกเบี้ย 2 ครั้งในปี 2566 ซึ่งเร็วกว่าที่คาดการณ์เมื่อเดือนมีนาคมว่า Fed จะยังไม่ปรับขึ้นอัตราดอกเบี้ยจนกว่าจะถึงปี 2567 ในขณะเดียวกัน ธปท. มีมติ ให้คงอัตราดอกเบี้ยนโยบายที่ร้อยละ 0.50 และปรับลดคาดการณ์การขยายตัวของ GDP ลงเป็นร้อยละ 1.8 จากร้อยละ 3 เมื่อเดือนมีนาคม ท่ามกลางสถานการณ์การแพร่ระบาดที่ทวีความรุนแรงขึ้น

สำหรับสภาวะเศรษฐกิจไทยในไตรมาสที่ 3 ปี 2564 คาดว่าในระยะสั้นตลาดพันธบัตรจะได้รับแรงสนับสนุนจากการดำเนินนโยบายทางการเงินแบบผ่อนคลาย เศรษฐกิจที่ชะลอตัวและความกังวลเกี่ยวกับสถานการณ์การแพร่ระบาดของโรค Covid-19 หากแต่ในระยะกลางถึงยาวคาดว่าอัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลจะยังคงมีแนวโน้มปรับเพิ่มขึ้นตามการฟื้นตัวของเศรษฐกิจและแนวโน้มอัตราเงินเฟ้อ นอกจากนี้อัตราผลตอบแทนยังคงเผชิญความผันผวนตามกระแสของเงินทุนไหลเข้า-ออกจากต่างประเทศ โดยปัจจัยสำคัญที่ต้องติดตามคือความคืบหน้าในการพัฒนาและประสิทธิผลของวัคซีนในการยับยั้งการแพร่ระบาดของโรค Covid-19 และการฟื้นตัวของเศรษฐกิจภายในประเทศโดยเฉพาะในภาคการท่องเที่ยวและบริการ

แนวโน้มการลงทุน

บริษัทฯ มีมุมมองต่อตลาดตราสารหนี้ในระยะสั้นดีขึ้นเล็กน้อย หากแต่ยังคงอยู่ในระดับ “เป็นกลาง” ทั้งนี้มีสาเหตุหลักมาจากแนวโน้มเศรษฐกิจไทยที่อาจยังคงเผชิญกับความเสี่ยงด้านลบอยู่อีกมาก จากสถานการณ์การแพร่ระบาดของ Covid-19 ในระลอกที่ 3 ที่ยังไม่มีแนวโน้มที่จะดีขึ้นได้ในเร็ววัน ทำให้คาดว่าอัตราดอกเบี้ยนโยบายของไทยจะอยู่ในระดับต่ำยาวนาน ถึงแม้ว่าเฟดอาจเริ่มส่งสัญญาณการปรับขึ้นดอกเบี้ยภายในปี 2566 ถึง 2 ครั้ง ทั้งนี้ขึ้นกับความรุนแรงของเศรษฐกิจสหรัฐฯ จากนโยบายการคลังเพื่อกระตุ้นเศรษฐกิจของนายไบเดน การเปิดเมือง และอัตราเงินเฟ้อที่คาดว่าจะเร่งตัวขึ้น ทั้งนี้ปัจจัยหลักดังกล่าวยังคงทำให้อัตราดอกเบี้ยพันธบัตรรัฐบาลสหรัฐฯ มีแนวโน้มที่ผันผวนสูง และอาจปรับขึ้นได้ในระยะกลางถึงยาว สำหรับแนวโน้มเศรษฐกิจไทย ธปท.ได้ปรับลดคาดการณ์อัตราดอกเบี้ยเศรษฐกิจปี 2564 จาก +3.0% มาอยู่ที่ +1.8% จากปริมาณนักท่องเที่ยวที่คาดว่าจะน้อยกว่าประมาณการณ์เดิม ทั้งนี้คาดว่าจะยังคงรอการประเมินสถานการณ์ Covid-19 ที่กลับมารุนแรงขึ้นในไทยระลอกที่ 3 ต่อไปและยังคงไม่ปิดทางเลือกที่อาจพิจารณาปรับลดอัตราดอกเบี้ยนโยบายลงได้อีก หากแต่จะยังคงเน้นการใช้มาตรการอื่นๆ ที่ตรงจุดก่อน ดังนั้นการลงทุนในตราสารหนี้ โดยเฉพาะอย่างยิ่งตราสารหนี้ระยะกลาง ถึงระยะยาวคาดว่าจะยังคงสามารถสร้างอัตราผลตอบแทนส่วนเพิ่มได้บ้าง หากเทียบกับการลงทุนในตราสารหนี้ระยะสั้น แม้จะยังคงมีความผันผวนในระดับสูงได้ต่อไปได้ตลอดทั้งปี

บริษัทฯ ใคร่ขอขอบพระคุณท่านผู้ถือหุ้นฯ ที่ได้อุปถัมภ์และไว้วางใจให้บริษัทฯ เป็นผู้บริหารเงินลงทุนของท่าน ทั้งนี้ บริษัทฯ จะพิจารณาดำเนินนโยบายการลงทุนที่เหมาะสมกับสถานการณ์ด้วยความระมัดระวัง และคำนึงถึงผลประโยชน์สูงสุดของผู้ถือหุ้นฯ เป็นสำคัญ

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด



รายงานความเห็นของผู้ดูแลผลประโยชน์

เสนอ ผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุนกองทุนเปิดกรุงศรีตราสารเงิน

ตามที่ธนาคารไทยพาณิชย์ จำกัด (มหาชน) ในฐานะผู้ดูแลผลประโยชน์กองทุนเปิดกรุงศรีตราสารเงิน ซึ่งมีบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด เป็นผู้จัดการกองทุน ได้ปฏิบัติหน้าที่ดูแลผลประโยชน์ของกองทุนดังกล่าว สำหรับระยะเวลาตั้งแต่วันที่ 1 มกราคม 2564 ถึงวันที่ 30 มิถุนายน 2564 แล้วนั้น

ธนาคารฯ เห็นว่าบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด ได้ปฏิบัติหน้าที่ในการจัดการกองทุนเปิดกรุงศรีตราสารเงิน โดยถูกต้องตามที่ควร ตามวัตถุประสงค์ที่ได้กำหนดไว้ในโครงการจัดการที่ได้รับอนุมัติจากสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ และภายใต้พระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535

ขอแสดงความนับถือ

ธนาคารไทยพาณิชย์ จำกัด (มหาชน)

(นางสาวกรงจิต อ้าบุญธรรม)

ผู้จัดการบริการผู้ดูแลผลประโยชน์และบริการบัญชีกองทุน

กองทุนเปิดกรุงศรีตราสารเงิน
งบแสดงฐานะการเงิน
ณ 30 มิถุนายน 2564

	Unaudited (บาท)
สินทรัพย์	
เงินลงทุนตามราคาขุดิธรรม (ราคาทุน 14,196,890,875.55 บาท)	14,196,799,115.07
เงินฝากธนาคาร	7,329,434.36
ลูกหนี้	
จากดอกเบี้ย	558,358.91
จากการขายหน่วยลงทุน	5,536,350.02
รวมสินทรัพย์	14,210,223,258.36
หนี้สิน	
เจ้าหนี้	
จากการซื้อเงินลงทุน	1,163,077,554.10
ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย	2,111,594.98
ภาษีเงินได้ค้างจ่าย	83,753.83
หนี้สินอื่น	63,632.48
รวมหนี้สิน	1,165,336,535.39
สินทรัพย์สุทธิ	13,044,886,722.97
สินทรัพย์สุทธิ:	
หน่วยลงทุนจดทะเบียน 10,000 ล้านหน่วย มูลค่าที่ตราไว้หน่วยละ 10 บาท	
ทุนที่ได้รับจากผู้ถือหน่วยลงทุน	9,780,508,063.01
กำไรสะสม	2,786,364,912.39
บัญชีปรับสมดุล	478,043,747.57
สินทรัพย์สุทธิ	13,044,886,722.97
ชนิดเพื่อการออม	
สินทรัพย์สุทธิ	87,925,746.29
หน่วยลงทุนที่ออกจำหน่ายแล้ว ณ วันสิ้นปี (หน่วย)	6,592,237.8246
สินทรัพย์สุทธิต่อหน่วย	13.3377
ชนิดสะสมมูลค่า	
สินทรัพย์สุทธิ	12,956,960,976.68
หน่วยลงทุนที่ออกจำหน่ายแล้ว ณ วันสิ้นปี (หน่วย)	971,458,568.4767
สินทรัพย์สุทธิต่อหน่วย	13.3376

กองทุนเปิดกรุงศรีตราสารเงิน
งบกำไรขาดทุนเบ็ดเสร็จ
สำหรับงวดบัญชีสิ้นสุดวันที่ 30 มิถุนายน 2564

	Unaudited (บาท)
รายได้จากการลงทุน	
รายได้ดอกเบี้ย	23,456,153.28
รวมรายได้	23,456,153.28
ค่าใช้จ่าย	
ค่าธรรมเนียมการจัดการ	7,821,719.08
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์	2,015,650.43
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน	4,888,574.51
รวมค่าใช้จ่าย	14,725,944.02
รายได้จากการลงทุนสุทธิ	8,730,209.26
รายการกำไร (ขาดทุน) สุทธิจากเงินลงทุน	
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิที่เกิดขึ้นจากเงินลงทุน	(72,298.36)
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิที่ยังไม่เกิดขึ้นจากเงินลงทุน	(91,544.09)
รวมรายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิจากเงินลงทุนที่เกิดขึ้นและยังไม่มีเกิดขึ้น	(163,842.45)
หัก ภาษีเงินได้	(103,593.92)
การเพิ่มขึ้นในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงานหลังหักภาษีเงินได้	8,462,772.89
การเพิ่มขึ้นในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงานแยกตามชนิดหน่วยลงทุน มีดังนี้	
ชนิดเพื่อการออม	49,240.38
ชนิดสะสมมูลค่า	8,413,532.51
รวม	8,462,772.89

กองทุนเปิดกรุงศรีตราสารเงิน
งบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน
ณ 30 มิถุนายน 2564

การแสดงรายละเอียดเงินลงทุนใช้การจัดกลุ่มตามประเภทของเงินลงทุนและประเภทของอุตสาหกรรม

ประเภทเงินลงทุน/ผู้ออกตราสาร/ผู้ออกหลักทรัพย์	หมายเลขตราสาร	อัตรา	วันครบอายุ	เงินต้น (บาท) /	มูลค่ายุติธรรม	Unaudited
		ดอกเบี้ย		จำนวนหุ้น	(บาท)	ร้อยละของ
		(%)				
หลักทรัพย์ในประเทศ						
เงินฝากออมทรัพย์						5.07
บมจ.ร.ทิสโก้		0.150000	เมื่อทวงถาม	340,461.93	340,461.93	0.00
บมจ.ร.ยูโอบี		0.250000	เมื่อทวงถาม	719,413,788.95	719,413,788.95	5.07
ตั๋วเงินคลัง						10.70
กระทรวงการคลัง	TB21707A		7 ก.ค. 2564	900,000,000.00	899,946,747.00	6.34
กระทรวงการคลัง	TB21707A		7 ก.ค. 2564	119,000,000.00	118,992,958.77	0.84
กระทรวงการคลัง	TB21804A		4 ส.ค. 2564	100,000,000.00	99,962,754.00	0.70
กระทรวงการคลัง	TB21901A		1 ก.ย. 2564	400,000,000.00	399,708,048.00	2.82
พันธบัตร						84.23
ธนาคารแห่งประเทศไทย	CB21701A		1 ก.ค. 2564	300,000,000.00	300,000,000.00	2.11
ธนาคารแห่งประเทศไทย	CB21701B		1 ก.ค. 2564	987,000,000.00	987,000,000.00	6.95
ธนาคารแห่งประเทศไทย	CB21708A		8 ก.ค. 2564	95,000,000.00	94,992,894.95	0.67
ธนาคารแห่งประเทศไทย	CB21708A		8 ก.ค. 2564	2,132,000,000.00	2,131,840,547.72	15.02
ธนาคารแห่งประเทศไทย	CB21708B		8 ก.ค. 2564	300,000,000.00	299,984,178.00	2.11
ธนาคารแห่งประเทศไทย	CB21715A		15 ก.ค. 2564	1,783,000,000.00	1,782,798,271.38	12.56
ธนาคารแห่งประเทศไทย	CB21722A		22 ก.ค. 2564	100,000,000.00	99,977,567.00	0.70
ธนาคารแห่งประเทศไทย	CB21729A		29 ก.ค. 2564	1,867,000,000.00	1,866,427,279.08	13.15
ธนาคารแห่งประเทศไทย	CB21805A		5 ส.ค. 2564	1,400,000,000.00	1,399,530,300.00	9.86
ธนาคารแห่งประเทศไทย	CB21805B		5 ส.ค. 2564	290,000,000.00	289,894,367.50	2.04
ธนาคารแห่งประเทศไทย	CB21805B		5 ส.ค. 2564	68,200,000.00	68,175,158.15	0.48
ธนาคารแห่งประเทศไทย	CB21813A		13 ส.ค. 2564	230,000,000.00	229,891,667.70	1.62
ธนาคารแห่งประเทศไทย	CB21819A		19 ส.ค. 2564	382,000,000.00	381,792,421.20	2.69
ธนาคารแห่งประเทศไทย	CB21826A		26 ส.ค. 2564	125,600,000.00	125,529,702.94	0.88
ธนาคารแห่งประเทศไทย	CB21902A		2 ก.ย. 2564	500,000,000.00	499,655,035.00	3.52
ธนาคารแห่งประเทศไทย	CB21902B		2 ก.ย. 2564	802,000,000.00	801,495,060.80	5.65
ธนาคารแห่งประเทศไทย	CB21916A		16 ก.ย. 2564	300,000,000.00	299,734,428.00	2.11
ธนาคารแห่งประเทศไทย	CB21923A		23 ก.ย. 2564	300,000,000.00	299,715,477.00	2.11
					14,196,799,115.07	100.00

กองทุนเปิดกรุงศรีตราสารเงิน

รายละเอียดการลงทุน ณ 30 มิถุนายน 2564

	มูลค่าตามราคาตลาด	% NAV
หลักทรัพย์หรือทรัพย์สินในประเทศ	14,204,686,908.34	108.89
พันธบัตรรัฐบาลและตั๋วเงินคลัง		
อายุคงเหลือน้อยกว่า 1 ปี	1,518,610,507.77	11.64
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย		
อายุคงเหลือน้อยกว่า 1 ปี	11,958,434,356.42	91.67
เงินฝากธนาคาร		
TRIS		
Rate A	340,470.34	0.00
FITCH-LONG		
Rate BBB	7,329,482.32	0.06
FITCH_TH-LONG		
Rate AAA	719,972,091.49	5.52
อื่นๆ	(1,159,800,185.37)	(8.89)
ลูกหนี้	322,536,350.02	2.47
เจ้าหนี้	(1,480,224,940.41)	(11.34)
ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย	(2,111,594.98)	(0.02)
มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ	13,044,886,722.97	100.00

กองทุนเปิดกรุงศรีตราสารเงิน

รายงานสรุปเงินลงทุน ณ 30 มิถุนายน 2564

กลุ่มของตราสาร	มูลค่าตามราคาตลาด	%NAV
(ก) ตราสารภาครัฐไทยและตราสารภาครัฐต่างประเทศ	13,477,044,864.19	103.31
(ข) ตราสารที่ธนาคารที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้น ธนาคารพาณิชย์ หรือบริษัทเงินทุนเป็นผู้ออก ผู้ส่งจ่าย ผู้รับรอง ผู้รับอวัล ผู้สลักหลัง หรือผู้ค้ำประกัน	0.00	0.00
(ค) ตราสารที่มีบริษัทที่ได้รับ rating ในระดับ investment grade เป็นผู้ออก ผู้รับรอง ผู้รับอวัล ผู้สลักหลัง หรือผู้ค้ำประกัน	0.00	0.00
(ง) ตราสารที่มีบริษัทที่ได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือในระดับที่ต่ำกว่า investment grade หรือไม่มี rating เป็นผู้ออก ผู้รับรอง ผู้รับอวัล หรือผู้ค้ำประกัน	0.00	0.00

กองทุนเปิดกรุงศรีตราสารเงิน

รายละเอียดตัวตราสารและความน่าเชื่อถือของตราสารทุกตัวใน Port ณ 30 มิถุนายน 2564

ประเภท	ผู้ออก	ผู้ค้า/ผู้รับรอง/ผู้สัถหลักหลัง	วันครบกำหนด	อันดับความน่าเชื่อถือ	มูลค่าหน้าตั๋ว	มูลค่าตามราคาตลาด
หลักทรัพย์ในประเทศ						
1 ตั๋วเงินคลัง	บมจ.ธ.กสิกรไทย	บมจ.ธ.กสิกรไทย	4 สิงหาคม 2564	AA	100,000,000.00	99,962,754.00
	บมจ.ธ.กสิกรไทย	บมจ.ธ.กสิกรไทย	1 กันยายน 2564	AA	400,000,000.00	399,708,048.00
	บมจ.ธ.ไทยพาณิชย์	บมจ.ธ.ไทยพาณิชย์	7 กรกฎาคม 2564	AA	1,019,000,000.00	1,018,939,705.77
2 พันธบัตร	ธนาคารแห่งประเทศไทย	กระทรวงการคลัง	1 กรกฎาคม 2564		300,000,000.00	300,000,000.00
	ธนาคารแห่งประเทศไทย	กระทรวงการคลัง	1 กรกฎาคม 2564		987,000,000.00	987,000,000.00
	ธนาคารแห่งประเทศไทย	กระทรวงการคลัง	8 กรกฎาคม 2564		2,227,000,000.00	2,226,833,442.67
	ธนาคารแห่งประเทศไทย	กระทรวงการคลัง	8 กรกฎาคม 2564		300,000,000.00	299,984,178.00
	ธนาคารแห่งประเทศไทย	กระทรวงการคลัง	15 กรกฎาคม 2564		1,783,000,000.00	1,782,798,271.38
	ธนาคารแห่งประเทศไทย	กระทรวงการคลัง	22 กรกฎาคม 2564		100,000,000.00	99,977,567.00
	ธนาคารแห่งประเทศไทย	กระทรวงการคลัง	29 กรกฎาคม 2564		1,867,000,000.00	1,866,427,279.08
	ธนาคารแห่งประเทศไทย	กระทรวงการคลัง	5 สิงหาคม 2564		358,200,000.00	358,069,525.65
	ธนาคารแห่งประเทศไทย	กระทรวงการคลัง	5 สิงหาคม 2564		1,400,000,000.00	1,399,530,300.00
	ธนาคารแห่งประเทศไทย	กระทรวงการคลัง	13 สิงหาคม 2564		230,000,000.00	229,891,667.70
	ธนาคารแห่งประเทศไทย	กระทรวงการคลัง	19 สิงหาคม 2564		382,000,000.00	381,792,421.20
	ธนาคารแห่งประเทศไทย	กระทรวงการคลัง	26 สิงหาคม 2564		125,600,000.00	125,529,702.94

กองทุนเปิดกรุงศรีตราสารเงิน

รายละเอียดตัวตราสารและความน่าเชื่อถือของตราสารทุกตัวใน Port ณ 30 มิถุนายน 2564

ประเภท	ผู้ออก	ผู้ค้า/ผู้รับรอง/ผู้สัถหลักหลัง	วันครบกำหนด	อันดับความน่าเชื่อถือ	มูลค่าหน้าตั๋ว	มูลค่าตามราคาตลาด
3 เงินฝากออมทรัพย์	ธนาคารแห่งประเทศไทย	กระทรวงการคลัง	2 กันยายน 2564		500,000,000.00	499,655,035.00
	ธนาคารแห่งประเทศไทย	กระทรวงการคลัง	2 กันยายน 2564		802,000,000.00	801,495,060.80
	ธนาคารแห่งประเทศไทย	กระทรวงการคลัง	16 กันยายน 2564		300,000,000.00	299,734,428.00
	ธนาคารแห่งประเทศไทย	กระทรวงการคลัง	23 กันยายน 2564		300,000,000.00	299,715,477.00
	บมจ.ช.ยูโอบี	บมจ.ช.ยูโอบี	เมื่อทวงถาม	AAA	719,413,788.95	719,972,091.49
	บมจ.ช.ทิสโก้	บมจ.ช.ทิสโก้	เมื่อทวงถาม	A	340,461.93	340,470.34

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)

กองทุนเปิดกรุงศรีตราสารเงิน

ตั้งแต่วันที่ 1 มกราคม 2564 ถึงวันที่ 30 มิถุนายน 2564

ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (Fund's Direct Expenses)	จำนวนเงิน (หน่วย: พันบาท)	ร้อยละของมูลค่า ทรัพย์สินสุทธิ (ต่อปี) 1/
ค่าธรรมเนียมการจัดการ (Management Fee)	7,821.72	0.1070
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ (Trustee Fee) 2/	2,015.65	0.0276
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน (Registrar Fee)	4,888.57	0.0669
ค่าที่ปรึกษาการลงทุน (Advisory Fee)	-	-
ค่าใช้จ่ายอื่น ๆ (Others)	-	-
รวมค่าใช้จ่ายทั้งหมด 3/	14,725.94	0.2015

หมายเหตุ

- 1/ ค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวมข้างต้น เป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่มหรือภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว
- 2/ ปัจจุบันเรียกเก็บในอัตราร้อยละ 0.0251 ต่อปีของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิ มีผลตั้งแต่วันที่ 16 มีนาคม 2564 เป็นต้นไป
- 3/ ไม่รวมค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ และค่าธรรมเนียมต่าง ๆ ที่เกิดขึ้นจากการซื้อขายหลักทรัพย์

ผลการดำเนินงานของกองทุนเปิดกรุงศรีตราสารเงิน

ผลการดำเนินงาน สิ้นสุด ณ วันที่ 30 มิ.ย. 2564	% ตามช่วงเวลา			% ต่อปี				
	Year to Date	ย้อนหลัง 3 เดือน	ย้อนหลัง 6 เดือน	ย้อนหลัง 1 ปี	ย้อนหลัง 3 ปี	ย้อนหลัง 5 ปี	ย้อนหลัง 10 ปี	นับจากวันเริ่มโครงการ (4 มีนาคม 2547)
KFCASH-A	0.06%	0.03%	0.06%	0.16%	0.67%	0.76%	1.34%	1.68%
ดัชนีชี้วัด (Benchmark)*	0.16%	0.08%	0.16%	0.36%	0.87%	0.98%	1.45%	1.77%
ความผันผวนของผลการดำเนินงาน	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.04%	0.04%	0.08%	0.11%
ความผันผวนของตัวชี้วัด	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.02%	0.02%	0.05%	0.05%

ผลการดำเนินงาน สิ้นสุด ณ วันที่ 30 มิ.ย. 2564	% ตามช่วงเวลา			% ต่อปี				
	Year to Date	ย้อนหลัง 3 เดือน	ย้อนหลัง 6 เดือน	ย้อนหลัง 1 ปี	ย้อนหลัง 3 ปี	ย้อนหลัง 5 ปี	ย้อนหลัง 10 ปี	นับจากวันเริ่มโครงการ (1 เมษายน 2563)
KFCASHSSF	0.06%	0.03%	0.06%	0.16%	N/A	N/A	N/A	0.18%
ดัชนีชี้วัด (Benchmark)*	0.16%	0.08%	0.16%	0.36%	N/A	N/A	N/A	0.39%
ความผันผวนของผลการดำเนินงาน	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	N/A	N/A	N/A	0.01%
ความผันผวนของตัวชี้วัด	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	N/A	N/A	N/A	0.01%

หมายเหตุ: * ดัชนีชี้วัด (Benchmark) คือ

- อัตราดอกเบี้ยเงินฝากประจำ 3 เดือน วงเงินน้อยกว่า 5 ล้านบาท เฉลี่ยของ 3 ธนาคารพาณิชย์ขนาดใหญ่ ได้แก่ ธนาคารกรุงเทพ, ธนาคารกรุงไทย และธนาคารไทยพาณิชย์ หลังหักภาษี สัดส่วน 45%
- ดัชนีพันธบัตรที่มีอายุคงที่ (ZRR) อายุประมาณ 1 เดือน สัดส่วน 55%

* เริ่มใช้ดัชนีชี้วัดผลการดำเนินงานใหม่หลังหักภาษี (Net TRN Index) มีผลตั้งแต่วันที่ 31 ตุลาคม 2562

** ผลตอบแทนที่มีอายุเกินหนึ่งปีจะแสดงเป็นผลตอบแทนต่อปี

เอกสารการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวมฉบับนี้ ได้จัดทำตามมาตรฐานการวัดผลดำเนินงาน
ของกองทุนรวมของสมาคมบริษัทจัดการลงทุน

ข้อมูลอื่นๆ ที่ผู้ถือหน่วยลงทุนควรทราบ

(1) รายงานบุคคลที่เกี่ยวข้องที่มีการทำธุรกรรมในรอบเวลาที่ผ่านมา (วันที่ 1 มกราคม 2564 ถึงวันที่ 30 มิถุนายน 2564)

ชื่อกองทุน	รายชื่อบุคคลที่เกี่ยวข้อง
กองทุนเปิดกรุงศรีตราสารเงิน	ธนาคารกรุงศรีอยุธยา จำกัด (มหาชน)

หมายเหตุ: ผู้ลงทุนสามารถตรวจสอบการทำธุรกรรมกับบุคคลที่เกี่ยวข้องกับกองทุนรวมได้ที่บริษัทจัดการ โดยตรง หรือที่ web site ของบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด (<http://www.krungsriasset.com>) และสำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ด. (<http://www.sec.or.th>)

(2) การรับผลประโยชน์ตอบแทนเนื่องจากการที่กองทุนเปิดกรุงศรีตราสารเงิน ใช้บริการบุคคลอื่นๆ (soft commission)

บริษัทที่ให้ผลประโยชน์	ผลประโยชน์ที่ได้รับ	เหตุผลในการรับผลประโยชน์
1. ธนาคารกรุงเทพ จำกัด (มหาชน)	ข่าวสารและบทวิเคราะห์ต่างๆ	เพื่อประโยชน์ของกองทุน
2. ธนาคารแห่งอเมริกา เนชั่นแนล แอสโซซิเอชั่น	ข่าวสารและบทวิเคราะห์ต่างๆ	เพื่อประโยชน์ของกองทุน
3. ธนาคารกรุงศรีอยุธยา จำกัด (มหาชน)	ข่าวสารและบทวิเคราะห์ต่างๆ	เพื่อประโยชน์ของกองทุน
4. ธนาคาร บีเอ็นพี พารีบาส์ สาขากรุงเทพฯ	ข่าวสารและบทวิเคราะห์ต่างๆ	เพื่อประโยชน์ของกองทุน
5. ธนาคารซีไอเอ็มบี ไทย จำกัด (มหาชน)	ข่าวสารและบทวิเคราะห์ต่างๆ	เพื่อประโยชน์ของกองทุน
6. ธนาคาร ซิตี้แบงก์	ข่าวสารและบทวิเคราะห์ต่างๆ	เพื่อประโยชน์ของกองทุน
7. ธนาคารคอยส์แบงก์ เอจี, สาขาประเทศไทย	ข่าวสารและบทวิเคราะห์ต่างๆ	เพื่อประโยชน์ของกองทุน
8. ธนาคารออมสิน	ข่าวสารและบทวิเคราะห์ต่างๆ	เพื่อประโยชน์ของกองทุน
9. ธนาคารฮ่องกงและเซี่ยงไฮ้แบงกิงคอร์ปอเรชั่น จำกัด	ข่าวสารและบทวิเคราะห์ต่างๆ	เพื่อประโยชน์ของกองทุน
10. ธนาคาร เจพีมอร์แกน เชส	ข่าวสารและบทวิเคราะห์ต่างๆ	เพื่อประโยชน์ของกองทุน
11. ธนาคารกสิกรไทย จำกัด (มหาชน)	ข่าวสารและบทวิเคราะห์ต่างๆ	เพื่อประโยชน์ของกองทุน
12. ธนาคารเกียรตินาคินภัทร จำกัด (มหาชน)	ข่าวสารและบทวิเคราะห์ต่างๆ	เพื่อประโยชน์ของกองทุน
13. ธนาคารกรุงไทย จำกัด (มหาชน)	ข่าวสารและบทวิเคราะห์ต่างๆ	เพื่อประโยชน์ของกองทุน
14. ธนาคารไทยพาณิชย์ จำกัด (มหาชน)	ข่าวสารและบทวิเคราะห์ต่างๆ	เพื่อประโยชน์ของกองทุน
15. ธนาคาร โซซิเอเต้ เจเนราล	ข่าวสารและบทวิเคราะห์ต่างๆ	เพื่อประโยชน์ของกองทุน
16. ธนาคารสแตนดาร์ดชาร์เตอร์ด (ไทย) จำกัด มหาชน	ข่าวสารและบทวิเคราะห์ต่างๆ	เพื่อประโยชน์ของกองทุน
17. ธนาคารธนาชาต จำกัด (มหาชน)	ข่าวสารและบทวิเคราะห์ต่างๆ	เพื่อประโยชน์ของกองทุน
18. ธนาคารทีสโก้ จำกัด (มหาชน)	ข่าวสารและบทวิเคราะห์ต่างๆ	เพื่อประโยชน์ของกองทุน
19. ธนาคารทหารไทยธนชาต จำกัด (มหาชน)	ข่าวสารและบทวิเคราะห์ต่างๆ	เพื่อประโยชน์ของกองทุน
20. ธนาคารยูโอบี จำกัด (มหาชน)	ข่าวสารและบทวิเคราะห์ต่างๆ	เพื่อประโยชน์ของกองทุน

(3) รายชื่อผู้จัดการกองทุน ณ วันที่ 30 มิถุนายน 2564

- | | |
|---------------------|-------------|
| 1. นายศิริระ | คลองวิชา |
| 2. นางสาวพรทิพา | หนึ่งน้ำใจ |
| 3. นายทิมมพร | วิชัยธรรมธร |
| 4. นายธีรภาพ | จิรศกยกุล |
| 5. นางสาวรัมภารัตน์ | ยูธานัส |

(4) การเปิดเผยข้อมูลการถือหน่วยลงทุนเกิน 1 ใน 3 ณ วันที่ 30 มิถุนายน 2564

ไม่มีการถือหน่วยลงทุนเกิน 1 ใน 3 ของบุคคลใดบุคคลหนึ่ง

ผู้ถือหน่วยลงทุนสามารถตรวจสอบข้อมูลสัดส่วนการถือหน่วยลงทุนโดยตรงได้ที่ www.krungsriasset.com

(5) อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุนของกองทุน (portfolio turnover ratio) ในรอบระยะเวลาที่ผ่านมา เท่ากับ 50.44%