

KT-TMT6

กองทุนเปิดเคแธม ธีมเมติก ทริกเกอร์ ฟันด์6

KTAM Thematic Trigger Fund6



รายงานรอบระยะเวลา 6 เดือน

รอบระยะเวลาบัญชีสิ้นสุดวันที่ 30 พฤศจิกายน 2566

ระดับความเสี่ยงของกองทุน

| | | | | | | | | | | |
|-----|---|---|---|---|---|---|---|---|----|-----|
| ต่ำ | 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | 8+ | สูง |
|-----|---|---|---|---|---|---|---|---|----|-----|

เรียน ท่านผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุน

กองทุนเปิดเคแอม ธีมเมติก ทริกเกอร์ ฟันด์6

บริษัทขอส่ง “รายงานสรุปสถานะการลงทุน” เพื่อรายงานผลการดำเนินงานของกองทุนตั้งแต่วันที่ 1 มิถุนายน 2566 ถึงวันที่ 30 พฤศจิกายน 2566 มาเพื่อโปรดทราบ

บริษัทขอขอบพระคุณท่านผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุนเป็นอย่างสูง ที่ได้มอบความไว้วางใจให้บริษัทบริหารเงินลงทุนของท่าน บริษัทยังคงยืนยันในความตั้งใจและทุ่มเทความสามารถเพื่อบริหารเงินของท่านอย่างมีประสิทธิภาพที่สุดต่อไป

ขอแสดงความนับถือ

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงเทพ จำกัด (มหาชน)

ตารางเปรียบเทียบผลการดำเนินงานของ
กองทุนเปิดเคแทม ธีมเมติก ทริกเกอร์ ฟันด์ 6

| กองทุน | วันจดทะเบียน/ วันเปลี่ยนแปลง นโยบายการลงทุน | ราคา ต่อหน่วย (บาท) | ผลการดำเนินงาน (สิ้นสุด ณ 30 พฤศจิกายน 2566) | | | | | | | |
|---------------------------------|---|---------------------------|--|---------------------|---------------------|------------------|------------------|------------------|-------------------|--------------------------------------|
| | | | % ตามช่วงเวลา | | | % ต่อปี | | | | |
| | | | YTD | ย้อนหลัง 3 เดือน | ย้อนหลัง 6 เดือน | ย้อนหลัง 1 ปี | ย้อนหลัง 3 ปี | ย้อนหลัง 5 ปี | ย้อนหลัง 10 ปี | ตั้งแต่วันที่ จดทะเบียน กองทุน |
| KT-TMT6 | 23 มิถุนายน 2564 | 8.4393 | 3.84% | -0.26% | 2.66% | -0.71% | N/A | N/A | N/A | -6.72% |
| Benchmark | | | 15.77% | 2.09% | 7.78% | 9.89% | N/A | N/A | N/A | 3.97% |
| ความผันผวนของ ผลการดำเนินงาน | | | 11.97% | 11.08% | 11.05% | 12.18% | N/A | N/A | N/A | 15.34% |
| ความผันผวนของ ตัวชี้วัด | | | 11.29% | 11.44% | 11.02% | 11.31% | N/A | N/A | N/A | 13.48% |

Benchmark = คำนวณจากร้อยละ 20 ของอัตราผลตอบแทนรวมจาก Bloomberg Barclays US Aggregate Total Return Value Unhedged ในสกุลเงินดอลลาร์สหรัฐ ปรับด้วยอัตราแลกเปลี่ยนเมื่อเทียบกับค่าสกุลเงินบาท ณ วันที่คำนวณผลตอบแทน และร้อยละ 80 ของอัตราผลตอบแทนรวมจาก FTSE All World Net Total Return Index ในสกุลเงินดอลลาร์สหรัฐ ปรับด้วยอัตราแลกเปลี่ยนเมื่อเทียบกับค่าสกุลเงินบาท ณ วันที่คำนวณผลตอบแทน
ความผันผวนคำนวณเป็น % ต่อปี

การแสดงผลการดำเนินงานของกองทุนรวมด้วยวิธีการตามปีปฏิทิน
เปรียบเทียบกับตัวชี้วัด และค่าความเสี่ยงของกองทุนรวม (SD)

| ปี | % ต่อปี | | | | | | | | | |
|---------------------------------|---------|------|------|------|------|------|------|------|--------|---------|
| | 2556 | 2557 | 2558 | 2559 | 2560 | 2561 | 2562 | 2563 | 2564 | 2565 |
| KT-TMT6 | N/A | N/A | N/A | N/A | N/A | N/A | N/A | N/A | -1.03% | -17.88% |
| Benchmark | N/A | N/A | N/A | N/A | N/A | N/A | N/A | N/A | 10.39% | -13.95% |
| ความผันผวนของ ผลการดำเนินงาน | N/A | N/A | N/A | N/A | N/A | N/A | N/A | N/A | 11.39% | 19.33% |
| ความผันผวนของตัวชี้วัด | N/A | N/A | N/A | N/A | N/A | N/A | N/A | N/A | 9.29% | 16.81% |

* ผลการดำเนินงานปี 2564 เป็น % ตามช่วงเวลา

Benchmark = คำนวณจากร้อยละ 20 ของอัตราผลตอบแทนรวมจาก Bloomberg Barclays US Aggregate Total Return Value Unhedged ในสกุลเงินดอลลาร์สหรัฐ ปรับด้วยอัตราแลกเปลี่ยนเมื่อเทียบกับค่าสกุลเงินบาท ณ วันที่คำนวณผลตอบแทน และร้อยละ 80 ของอัตราผลตอบแทนรวมจาก FTSE All World Net Total Return Index ในสกุลเงินดอลลาร์สหรัฐ ปรับด้วยอัตราแลกเปลี่ยนเมื่อเทียบกับค่าสกุลเงินบาท ณ วันที่คำนวณผลตอบแทน

ความผันผวนคำนวณเป็น % ต่อปี

- เอกสารการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวมฉบับนี้ได้จัดทำขึ้นตามมาตรฐานการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวมของสมาคมบริษัทจัดการลงทุน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวมไม่ได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต
- การลงทุนมีความเสี่ยง ผู้ลงทุนควรศึกษาข้อมูลก่อนตัดสินใจลงทุน

แบบแสดงค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุน

กองทุนเปิดเคแธม ธีมเมติก ทริกเกอร์ ฟันด์6

ของรอบบัญชีตั้งแต่วันที่ 1 มิถุนายน 2566 ถึงวันที่ 30 พฤศจิกายน 2566

| ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม* (fund's direct expenses) | จำนวนเงิน หน่วย : พันบาท | ร้อยละของ มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ |
|---|-----------------------------|-----------------------------------|
| ค่าธรรมเนียมการจัดการ | 364.76 | 0.57 |
| ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ | 8.09 | 0.01 |
| ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน | 34.41 | 0.05 |
| ค่าสอบบัญชี | 17.50 | 0.03 |
| ค่าใช้จ่ายอื่น ๆ** | 21.61 | 0.03 |
| รวมค่าใช้จ่ายทั้งหมด*** | 446.37 | 0.69 |

*เป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่มแล้ว

**ค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายที่แต่ละรายการมีมูลค่าน้อยกว่าร้อยละ 0.01 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิ

***ไม่รวมค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์และค่าธรรมเนียมต่างๆ ที่เกิดขึ้นจากการซื้อขายหลักทรัพย์

****ไม่รวมค่าภาษีเงินได้นิติบุคคลสำหรับเงินได้ตามมาตรา 40 (4) (ก) แห่งประมวลรัษฎากร

บริษัทนายหน้าที่ได้รับค่านายหน้าสูงสุดลิบอันดับแรก

กองทุนเปิดเคแธม ธีมเมติก ทริกเกอร์ ฟันด์6

ระหว่างวันที่ 1 มิถุนายน 2566 ถึงวันที่ 30 พฤศจิกายน 2566

| อันดับ | ชื่อ | ค่านายหน้า (บาท) | อัตราส่วนค่านายหน้า |
|--------|--|-------------------|---------------------|
| 1 | DBS Vickers Securities (Singapore) Pte Ltd | 144,104.02 | 51.86% |
| 2 | UOB KAY HIAN PRIVATE LIMITED | 133,766.12 | 48.14% |
| | รวม | 277,870.14 | 100.00% |

ข้อมูลอัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน (Portfolio Turnover Ratio : PTR)

กองทุนเปิดเคแธม ธีมเมติก ทริกเกอร์ ฟันด์6

ระหว่างวันที่ 1 มิถุนายน 2566 ถึงวันที่ 30 พฤศจิกายน 2566

PTR = 290.72%

รายงานสถานะการลงทุนการกู้ยืมเงินและการก่อภาระผูกพัน
กองทุนเปิดเคแอม ธีมเมติก ทริกเกอร์ ฟันด์6
มูลค่า ณ วันที่ 30 พฤศจิกายน 2566

| รายละเอียดการลงทุน | มูลค่าตามราคาตลาด | %NAV |
|---|----------------------|---------------|
| หลักทรัพย์หรือทรัพย์สินในประเทศ | 423,328.83 | 0.70 |
| เงินฝากธนาคาร | | |
| อันดับความน่าเชื่อถือ : AA | 423,328.83 | 0.70 |
| หลักทรัพย์หรือทรัพย์สินต่างประเทศ | 57,253,628.73 | 94.18 |
| หุ้นสามัญ | | |
| หมวดเทคโนโลยี | 1,801,603.38 | 2.96 |
| หมวดธุรกิจการเงิน | 3,185,927.34 | 5.24 |
| หมวดสินค้าอุปโภคบริโภค | 2,326,390.89 | 3.83 |
| หน่วยลงทุน ตราสารทุน | 49,939,707.12 | 82.15 |
| สัญญาซื้อขายล่วงหน้า(กำไร/ขาดทุนจากสัญญา) | 269,734.19 | 0.45 |
| สัญญาที่อ้างอิงกับอัตราแลกเปลี่ยน เพื่อป้องกันความเสี่ยง (Hedging) | | |
| สัญญาสวอป/ สัญญาฟอเวิร์ด มี 6 คู่สัญญา | | |
| - ธนาคารกรุงเทพ จำกัด (มหาชน) อันดับความน่าเชื่อถือ : AA+ | 4,573.12 | 0.01 |
| - ธนาคารกรุงไทย จำกัด (มหาชน) อันดับความน่าเชื่อถือ : AA+ | 201,436.90 | 0.33 |
| - ธนาคารกรุงศรีอยุธยา จำกัด (มหาชน) อันดับความน่าเชื่อถือ : AAA | 64,773.91 | 0.11 |
| - ธนาคารเกียรตินาคินภัทร จำกัด (มหาชน) อันดับความน่าเชื่อถือ : A | 1,561.57 | 0.00 |
| - ธนาคารทหารไทยธนชาติ จำกัด (มหาชน) อันดับความน่าเชื่อถือ : AA- | 29,338.69 | 0.05 |
| - ธนาคารสแตนดาร์ดชาร์เตอร์ด (ไทย) จำกัด (มหาชน) อันดับความน่าเชื่อถือ : AAA | -31,950.00 | -0.05 |
| อื่นๆ | 2,841,074.97 | 4.67 |
| ประเภทหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินอื่นตามที่สำนักงานกำหนด | 2,824,259.30 | 4.65 |
| ประเภทรายการค้างรับอื่นๆ | 1,904,237.21 | 3.13 |
| ประเภทรายการค้างจ่ายหรือหนี้สินอื่นๆ | -1,887,421.54 | -3.11 |
| มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ | 60,787,766.72 | 100.00 |

รายงานสรุปจำนวนเงินลงทุนในตราสารแห่งนี้ เงินฝาก หรือตราสารกึ่งหนี้กึ่งทุน

กองทุนเปิดเคแอม ธีมเมติก ทริกเกอร์ ฟันด์6

มูลค่า ณ วันที่ 30 พฤศจิกายน 2566

| กลุ่มของตราสาร | มูลค่าตามราคาตลาด | %NAV |
|---|-------------------|------------|
| (ก) ตราสารภาครัฐไทย/ตราสารภาครัฐต่างประเทศ | 0.00 | 0.00 |
| (ข) ตราสารที่ธนาคารที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้น ธนาคารพาณิชย์ หรือบริษัทเงินทุนเป็นผู้ออก/ผู้รับรอง/อวัล/สลักหลัง/ค้ำประกัน | 423,328.83 | 0.70 |
| (ค) ตราสารหรือผู้ออกที่มีบริษัทที่ได้รับ rating ในระดับ investment grade เป็นผู้ออก/ผู้รับรอง/อวัล/สลักหลัง/ค้ำประกัน | 0.00 | 0.00 |
| (ง) ตราสารหรือผู้ออกที่มีบริษัทที่ได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือในระดับที่ต่ำกว่า investment grade หรือไม่มี rating เป็นผู้ออก/ผู้รับรอง/อวัล/สลักหลัง/ค้ำประกัน | 0.00 | 0.00 |
| สัดส่วนสูงสุด (upper limit) ที่บริษัทจัดการ คาดว่าจะลงทุนในกลุ่ม (ง) | 15.00% | NAV |

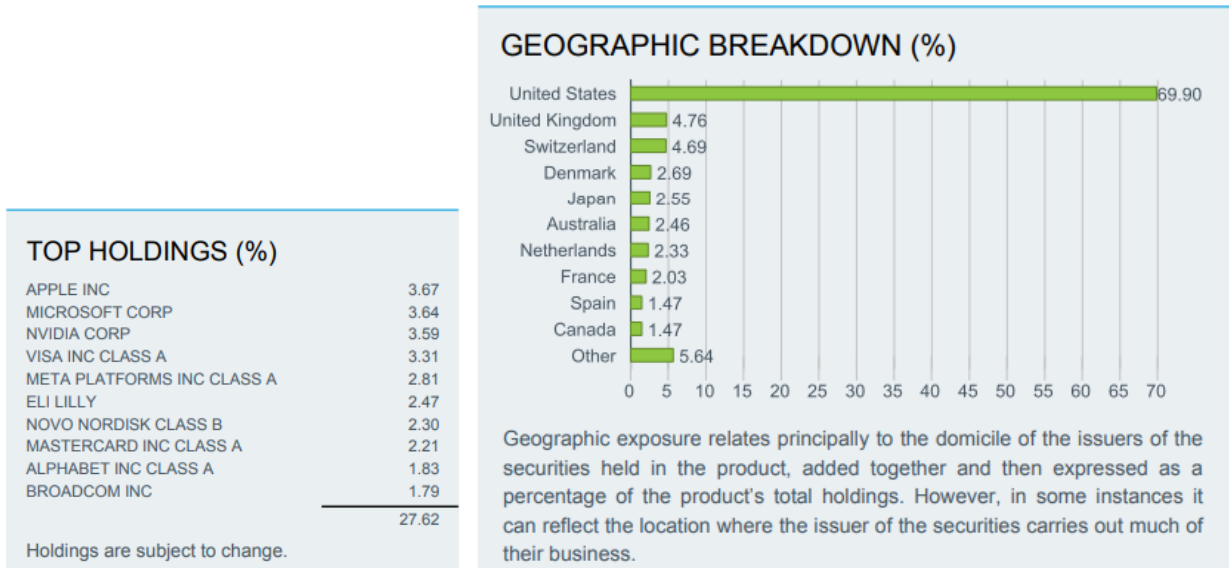
รายละเอียดตัวตราสารและอันดับความน่าเชื่อถือของตราสารทุกตัวใน port

กองทุนเปิดเคแอม ธีมเมติก ทริกเกอร์ ฟันด์6

มูลค่า ณ วันที่ 30 พฤศจิกายน 2566

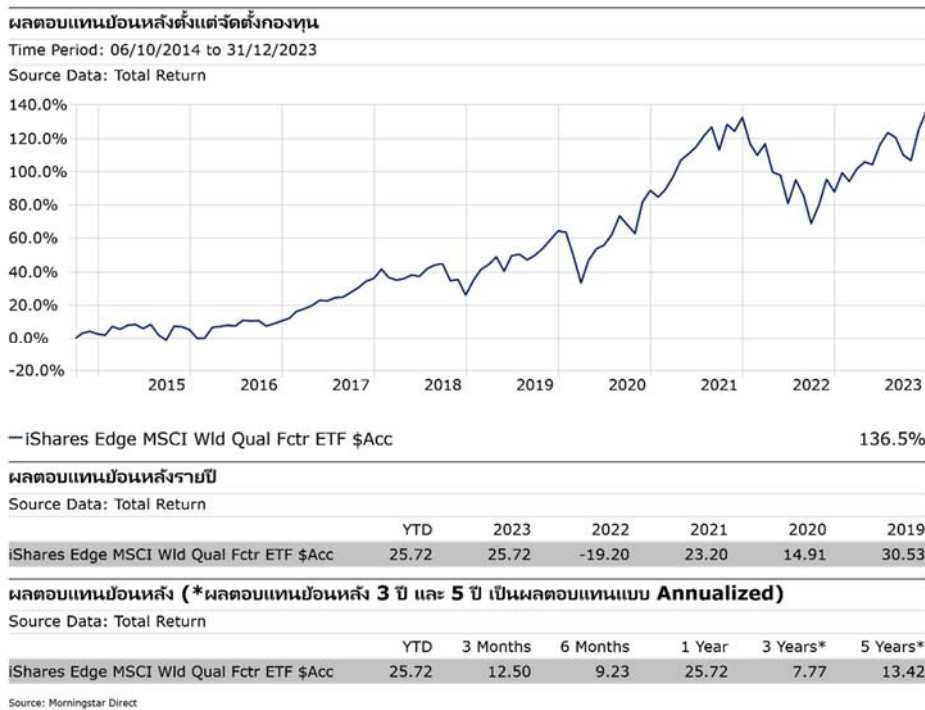
| ประเภท | ผู้ออก | อันดับความน่าเชื่อถือ | มูลค่าตามราคาตลาด |
|----------------------|-------------------------------------|-----------------------|-------------------|
| หุ้นสามัญ | Pinduoduo Inc. | | 2,326,390.89 |
| หุ้นสามัญ | MSFTUS | | 1,801,603.38 |
| หุ้นสามัญ | Mitsubishi UFJ Financial Group INC. | | 3,185,927.34 |
| หน่วยลงทุน ตราสารทุน | SPDR S&P 500 ETF TRUST | | 10,097,228.85 |
| หน่วยลงทุน ตราสารทุน | INVESCO POWERSHARES | | 6,463,847.71 |
| หน่วยลงทุน ตราสารทุน | ETF MANAGERS GROUP | | 2,908,790.22 |
| หน่วยลงทุน ตราสารทุน | Blackrock International Management | | 6,773,203.77 |
| หน่วยลงทุน ตราสารทุน | Blackrock International Management | | 20,237,247.87 |
| หน่วยลงทุน ตราสารทุน | The Vanguard Group. | | 3,459,388.70 |
| เงินฝากธนาคาร | ธนาคารไทยพาณิชย์ จำกัด (มหาชน) | AA+ | 423,328.83 |

ข้อมูลการลงทุน ผลการดำเนินงาน และความผันผวนของผลการดำเนินงานของกองทุนรวมในต่างประเทศที่เกินกว่า 20%
ข้อมูลการลงทุนของกองทุน iShares Edge MSCI World Quality Factor UCITS ETF



หมายเหตุ ข้อมูลจาก Factsheet กองทุนหลัก ฉบับ ณ 31 ธันวาคม 2566
ผลการดำเนินงานในอดีต มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

ผลการดำเนินงานของกองทุน iShares Edge MSCI World Quality Factor UCITS ETF



หมายเหตุ ข้อมูลจาก Morningstar Direct ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2566
ผลการดำเนินงานในอดีต มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต
ค่าตอบแทนที่ได้รับจากบริษัทจัดการต่างประเทศ (Rebate fee) 0.00% ของ NAV

สถาบันการจัดอันดับความน่าเชื่อถือ Tris Rating

ทริสเรตติ้งใช้สัญลักษณ์ตัวอักษรแสดงผลการจัดอันดับเครดิตองค์กรและตราสารหนี้ระยะกลางและระยะยาวที่มีอายุตั้งแต่ 1 ปีขึ้นไป จำนวน 8 อันดับ โดยเริ่มจาก AAA ซึ่งเป็นอันดับเครดิตสูงสุด จนถึง D ซึ่งเป็นอันดับต่ำสุดซึ่งแต่ละสัญลักษณ์มีความหมายดังนี้

- AAA** อันดับเครดิตองค์กรหรือตราสารหนี้ที่มีความเสี่ยงต่ำที่สุด ผู้ออกตราสารหนี้มีความสามารถในการชำระดอกเบี้ยและคืนเงินต้นในเกณฑ์สูงสุด และได้รับผลกระทบน้อยมากจากการเปลี่ยนแปลงทางธุรกิจ เศรษฐกิจ และสิ่งแวดล้อมอื่นๆ
- AA** องค์กรหรือตราสารหนี้มีความเสี่ยงต่ำมาก ผู้ออกตราสารหนี้มีความสามารถในการชำระดอกเบี้ยและคืนเงินต้นในเกณฑ์สูงมาก แต่อาจได้รับผลกระทบจากการเปลี่ยนแปลงทางธุรกิจ เศรษฐกิจ และสิ่งแวดล้อมอื่นๆ มากกว่าอันดับเครดิตที่อยู่ในระดับ AAA
- A** องค์กรหรือตราสารหนี้มีความเสี่ยงในระดับต่ำ ผู้ออกตราสารหนี้มีความสามารถในการชำระดอกเบี้ยและคืนเงินต้นในเกณฑ์สูง แต่อาจได้รับผลกระทบจากการเปลี่ยนแปลงทางธุรกิจ เศรษฐกิจ และสิ่งแวดล้อมอื่นๆ มากกว่าอันดับเครดิตที่อยู่ในระดับสูงกว่า
- BBB** องค์กรหรือตราสารหนี้มีความเสี่ยงในระดับปานกลาง ผู้ออกตราสารหนี้มีความสามารถในการชำระดอกเบี้ยและคืนเงินต้นในเกณฑ์ที่เพียงพอ แต่มีความอ่อนไหวต่อการเปลี่ยนแปลงทางธุรกิจ เศรษฐกิจ และสิ่งแวดล้อมอื่นๆ มากกว่า และอาจมีความสามารถในการชำระหนี้อ่อนแอลงเมื่อเทียบกับอันดับเครดิตที่อยู่ในระดับสูงกว่า
- BB** องค์กรหรือตราสารหนี้มีความเสี่ยงในระดับสูง ผู้ออกตราสารหนี้มีความสามารถในการชำระดอกเบี้ยและคืนเงินต้นในเกณฑ์ต่ำกว่าระดับปานกลาง และจะได้รับผลกระทบจากการเปลี่ยนแปลงที่รุนแรง (Adverse changes) ทางธุรกิจ เศรษฐกิจ และสิ่งแวดล้อมอื่นๆ ซึ่งอาจส่งผลให้ความสามารถในการชำระหนี้อยู่ในเกณฑ์ที่ไม่เพียงพอ
- B** องค์กรหรือตราสารหนี้มีความเสี่ยงในระดับสูงมาก ผู้ออกตราสารหนี้มีความสามารถในการชำระดอกเบี้ยและคืนเงินต้นในเกณฑ์ต่ำและอาจจะหมดความสามารถหรือความตั้งใจในการชำระหนี้ได้ตามการเปลี่ยนแปลงของสถานการณ์ทางธุรกิจ เศรษฐกิจ และสิ่งแวดล้อมอื่นๆ
- C** องค์กรหรือตราสารหนี้มีความเสี่ยงในการผิดนัดชำระหนี้สูงที่สุด ผู้ออกตราสารหนี้ไม่มีความสามารถในการชำระดอกเบี้ยและคืนเงินต้นตามกำหนดอย่างชัดเจน โดยต้องอาศัยเงื่อนไขที่เอื้ออำนวยทางธุรกิจ เศรษฐกิจ และสิ่งแวดล้อมอื่นๆ อย่างมากจึงจะมีความสามารถในการชำระหนี้ได้
- D** องค์กรหรือตราสารหนี้อยู่ในสถานะผิดนัดชำระหนี้ โดยผู้ออกตราสารหนี้ไม่สามารถชำระดอกเบี้ยและคืนเงินต้นได้ตามกำหนด อันดับเครดิตจาก AA ถึง C อาจมีเครื่องหมายบวก (+) หรือลบ (-) ต่อท้ายเพื่อจำแนกความแตกต่างของคุณภาพของอันดับเครดิตภายในระดับเดียวกัน

สำหรับการจัดอันดับเครดิตตราสารหนี้ระยะสั้น ทริสเรตติ้งจะเน้นการวิเคราะห์โอกาสที่จะเกิดการผิดนัดชำระหนี้ (Default Probability) เป็นสำคัญโดยมิได้คำนึงถึงระดับของการชดเชยความเสียหายที่จะเกิดขึ้นจากการผิดนัดชำระหนี้ (Recovery After Default) แต่อย่างไรก็ตาม โดยตราสารหนี้ระยะสั้นมีอายุต่ำกว่า 1 ปี สัญลักษณ์และนิยามอันดับเครดิตตราสารหนี้ระยะสั้นจำแนกเป็น 5 ระดับ ดังนี้

- T1** ผู้ออกตราสารหนี้มีสถานะทั้งทางด้านการตลาดและการเงินที่แข็งแกร่งในระดับดีมาก มีสภาพคล่องที่ดีมาก และนักลงทุนจะได้รับความคุ้มครองจากการผิดนัดชำระหนี้ที่ต่ำกว่าอันดับเครดิตในระดับอื่น ผู้ออกตราสารหนี้ที่ได้รับอันดับเครดิตในระดับดังกล่าว ซึ่งมีเครื่องหมาย “+” ด้วยจะได้รับความคุ้มครองด้านการผิดนัดชำระหนี้ที่สูงยิ่งขึ้น
- T2** ผู้ออกตราสารหนี้มีสถานะทั้งทางด้านการตลาดและการเงินที่แข็งแกร่งในระดับดี และมีความสามารถในการชำระหนี้ระยะสั้นในระดับที่น่าพอใจ
- T3** ผู้ออกตราสารหนี้มีความสามารถในการชำระหนี้ระยะสั้นในระดับที่ยอมรับได้
- T4** ผู้ออกตราสารหนี้มีความสามารถในการชำระหนี้ระยะสั้นที่ค่อนข้างอ่อนแอ
- D** เป็นระดับที่อยู่ในสถานะผิดนัดชำระหนี้ โดยผู้ออกตราสารหนี้ไม่สามารถชำระดอกเบี้ยและคืนเงินต้นได้ตามกำหนด

อันดับเครดิตทุกประเภทที่จัดโดยทริสเรตติ้งเป็นอันดับเครดิตตราสารหนี้ในสกุลเงินบาท ซึ่งสะท้อนความสามารถในการชำระหนี้ของผู้ออกตราสารหนี้โดยไม่รวมความเสี่ยงจากการแปลงค่าเงินสกุลเงินบาทเป็นสกุลเงินตราต่างประเทศ

นอกจากนี้ทริสเรตติ้งยังใช้เครื่องหมาย “(sf)” ต่อท้ายสัญลักษณ์อันดับเครดิตตราสารหนี้เพื่อระบุว่าตราสารหนี้ที่มีเครื่องหมายดังกล่าวเป็นตราสารที่มีโครงสร้างซับซ้อน (Structured Finance Product) ตามเกณฑ์ของคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ (ก.ล.ต.) ด้วย โดยที่ความหมายของสัญลักษณ์อันดับเครดิตยังคงเหมือนเดิมตามนิยามข้างต้น

ทริสเรตติ้งยังกำหนด “แนวโน้มอันดับเครดิต” (Rating Outlook) เพื่อสะท้อนความเป็นไปได้ของการเปลี่ยนแปลงอันดับเครดิตของผู้ออกตราสารหนี้ในระยะปานกลางหรือระยะยาว โดยทริสเรตติ้งจะพิจารณาถึงโอกาสที่จะเกิดการเปลี่ยนแปลงของภาวะอุตสาหกรรมและสภาพแวดล้อมทางธุรกิจในอนาคตของผู้ออกตราสารหนี้ที่อาจกระทบต่อความสามารถในการชำระหนี้ ส่วนแนวโน้มอันดับเครดิตของตราสารหนี้โดยส่วนใหญ่จะเท่ากับแนวโน้มอันดับเครดิตขององค์กรผู้ออกตราสารหนี้ๆ หรือองค์กรซึ่งรับภาระผูกพันในการชำระหนี้ของตราสารหนี้ๆ ทั้งนี้ แนวโน้มอันดับเครดิตแบ่งออกเป็น 4 ระดับ ได้แก่

Positive หมายถึง อันดับเครดิตอาจปรับขึ้น

Stable หมายถึง อันดับเครดิตอาจไม่เปลี่ยนแปลง

Negative หมายถึง อันดับเครดิตอาจปรับลดลง

Developing หมายถึง อันดับเครดิตอาจปรับขึ้น ปรับลดลง หรือไม่เปลี่ยนแปลง

ทริสเรตติ้งอาจประกาศ “**เครดิตพินิจ**” (CreditAlert) ซึ่งเป็นขั้นตอนหนึ่งของการทบทวนอันดับเครดิตที่ทริสเรตติ้งประกาศผลต่อสาธารณะไปแล้วในกรณีเมื่อเกิดเหตุการณ์สำคัญซึ่งทริสเรตติ้งพิจารณาแล้วเห็นว่าอาจส่งผลกระทบต่อธุรกิจหรือการเงินขององค์กรที่ทริสเรตติ้งจัดอันดับ แต่ข้อมูลดังกล่าวยังไม่ชัดเจน หรืออาจจะยังสรุปผลไม่ได้ เช่น การควบรวมกิจการ การลงทุนใหม่ การเปลี่ยนแปลงโครงสร้างเงินทุน หรือแผนงานต่างๆ ฯลฯ โดยจะยังไม่มีการเปลี่ยนแปลงผลอันดับเครดิตเดิมแต่อย่างใด ทั้งนี้ เพื่อเตือนให้นักลงทุนระมัดระวังในการที่จะลงทุนในตราสารหนี้ขององค์กรนั้นๆ รายงานเครดิตพินิจประกอบด้วย เหตุผล (Rationale) ที่แจ้งเหตุในการออกประกาศเตือนพร้อมระบุ “**เครดิตพินิจ**” (CreditAlert Designation) ไว้พร้อมกับอันดับเครดิตปัจจุบัน โดยงดการระบุ “แนวโน้มอันดับเครดิต” (Rating Outlook)

เครดิตพินิจ เป็นการบอกทิศทางของการเปลี่ยนแปลงอันดับเครดิตในระยะอันใกล้ ซึ่งมี 3 รูปแบบ คือ (1) Positive (*บวก*) (2) Negative (*ลบ*) และ (3) Developing (*ยังไม่ชัดเจน*)

สถาบันการจัดอันดับความน่าเชื่อถือ Fitch Rating

คำอธิบายการจัดอันดับความน่าเชื่อถือระยะยาว สำหรับประเทศไทย

AAA (tha) แสดงถึงระดับความน่าเชื่อถือขั้นสูงสุดของอันดับความน่าเชื่อถือภายในประเทศไทยซึ่งกำหนดโดย Fitch โดยอันดับความน่าเชื่อถือนี้จะมอบให้กับอันดับความน่าเชื่อถือที่มีความเสี่ยง “น้อยที่สุด” เมื่อเปรียบเทียบกับผู้ออกตราสารหรือตราสารอื่นในประเทศไทย และโดยปกติแล้วจะกำหนดให้แก่ตราสารทางการเงินที่ออกหรือค้ำประกันโดยรัฐบาล

AA (tha) แสดงถึงระดับความน่าเชื่อถือขั้นสูงมากเปรียบเทียบกับผู้ออกตราสารหรือตราสารอื่นในประเทศไทยโดยระดับความน่าเชื่อถือของตราสารทางการเงินขั้นนี้ต่างจากผู้ออกตราสารหรือตราสารอื่นที่ได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือขั้นสูงสุดของประเทศไทยเพียงเล็กน้อย

BBB (tha) แสดงถึงระดับความน่าเชื่อถือขั้นปานกลางเมื่อเปรียบเทียบกับผู้ออกตราสารอื่นในประเทศไทย อย่างไรก็ตามก็มีความเป็นไปได้มากกว่าการเปลี่ยนแปลงของสถานการณ์หรือสภาพทางเศรษฐกิจจะมีผลกระทบต่อความสามารถในการชำระหนี้ได้ตรงตามกำหนดเวลาของตราสารทางการเงินเหล่านี้มากกว่าตราสารหนี้อื่นที่ได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือในประเภทที่สูงกว่า

- BB (tha)** แสดงถึงระดับความน่าเชื่อถือค่อนข้างต่ำเมื่อเปรียบเทียบกับผู้ออกตราสารอื่นในประเทศไทย การชำระหนี้ตามเงื่อนไขของตราสารเหล่านี้ภายในประเทศนั้นๆ มีความไม่แน่นอนในระดับหนึ่งและความสามารถในการชำระหนี้ขึ้นอยู่กับกำหนดเวลาจะมีความไม่แน่นอนมากขึ้นตามการเปลี่ยนแปลงของเศรษฐกิจในทางลบ
- B (tha)** แสดงถึงระดับความน่าเชื่อถือค่อนข้างต่ำอย่างมีนัยสำคัญเมื่อเปรียบเทียบกับผู้ออกตราสารหนี้อื่นๆ ในประเทศไทยการปฏิบัติตามเงื่อนไขของตราสารหนี้และข้อผูกพันทางการเงินยังคงเป็นไปได้ในปัจจุบัน แต่ความมั่นคงยังจำกัดอยู่ในระดับหนึ่งเท่านั้น และความสามารถในการชำระหนี้ตามกำหนดอย่างต่อเนื่องเท่านั้น และความสามารถในการชำระหนี้ตามกำหนดอย่างต่อเนื่องนั้น ไม่แน่นอนขึ้นอยู่กับสถานะที่เอื้อต่อการดำเนินธุรกิจและสภาพทางเศรษฐกิจ
- CCC (tha), CC (tha), C (tha)** แสดงถึงระดับความน่าเชื่อถือค่อนข้างต่ำมากเมื่อเปรียบเทียบกับผู้ออกตราสารหรือตราสารอื่นในประเทศไทยความสามารถในการปฏิบัติตามข้อผูกพันทางการเงินขึ้นอยู่กับสถานะที่เอื้อต่อการดำเนินธุรกิจและการพัฒนาทางเศรษฐกิจเพียงอย่างเดียว
- D (tha)** อันดับความน่าเชื่อถือเหล่านี้ จะถูกกำหนดให้สำหรับองค์กรหรือตราสารหนี้ซึ่งกำลังอยู่ในภาวะผิดนัดชำระหนี้ในปัจจุบัน

คำอธิบายการจัดอันดับความน่าเชื่อถือระยะสั้น สำหรับประเทศไทย

- F1 (tha)** แสดงถึงระดับความสามารถขั้นสูงสุดในการชำระหนี้ตามเงื่อนไขของตราสารตรงตามกำหนดเมื่อเปรียบเทียบกับผู้ออกตราสารหรือตราสารอื่นๆ ในประเทศไทยภายใต้อันดับความน่าเชื่อถือนี้จะมอบให้สำหรับอันดับความน่าเชื่อถือที่มีความเสี่ยง “น้อยที่สุด” เมื่อเปรียบเทียบกับผู้ออกตราสารอื่นในประเทศเดียวกัน และโดยปกติแล้วจะกำหนดให้กับตราสารทางการเงินที่ออกหรือค้ำประกันโดยรัฐบาล ในกรณีที่มิระดับความน่าเชื่อถือสูงเป็นพิเศษจะมีสัญลักษณ์ “+” แสดงไว้เพิ่มเติมจากอันดับความน่าเชื่อถือที่กำหนด
- F2 (tha)** แสดงถึงระดับความสามารถในการชำระหนี้ตามเงื่อนไขทางการเงินตามกำหนดเวลาในระดับที่น่าพอใจเมื่อเปรียบเทียบกับผู้ออกตราสารหนี้อื่นในประเทศเดียวกัน อย่างไรก็ตาม ระดับของความน่าเชื่อถือดังกล่าวจะไม่อาจเทียบเท่ากับกรณีที่ได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือที่สูงกว่า
- F3 (tha)** แสดงถึงระดับความสามารถในการชำระหนี้ตามเงื่อนไขของตราสารการเงินตามกำหนดเวลาในระดับปานกลางเมื่อเปรียบเทียบกับผู้ออกตราสารอื่นหรือตราสารอื่นในประเทศเดียวกัน อย่างไรก็ตาม ความสามารถในการชำระหนี้ดังกล่าวจะมีความไม่แน่นอนมากขึ้นไปตามการเปลี่ยนแปลงในทางลบในระยะสั้นมากกว่าตราสารที่ได้รับการจัดอันดับที่สูงกว่า
- B (tha)** แสดงถึงระดับความสามารถในการชำระหนี้ตามเงื่อนไขของตราสารการเงินตามกำหนดเวลาที่ไม่แน่นอน เมื่อเปรียบเทียบกับผู้ออกตราสารอื่นในประเทศไทย ความสามารถในการชำระหนี้ดังกล่าวจะไม่แน่นอนมากขึ้นตามการเปลี่ยนแปลงทางเศรษฐกิจและการเงินในทางลบระยะสั้น
- C (tha)** แสดงถึงระดับความสามารถในการชำระหนี้ตามเงื่อนไขของตราสารการเงินตามกำหนดเวลาที่ไม่แน่นอนสูง เมื่อเปรียบเทียบกับผู้ออกตราสารอื่นในประเทศไทยความสามารถในการปฏิบัติตามข้อผูกพันทางการเงินขึ้นอยู่กับสถานะที่เอื้อต่อการดำเนินธุรกิจและสภาพการณ์ทางเศรษฐกิจเท่านั้น
- D (tha)** แสดงถึงการผิดนัดชำระหนี้ที่ได้เกิดขึ้นแล้วหรือกำลังจะเกิดขึ้น

หมายเหตุประกอบการจัดอันดับความน่าเชื่อถือในระยะยาว ในระยะสั้น สำหรับประเทศไทย

เครื่องบ่งชี้พิเศษสำหรับประเทศไทย “tha” จะถูกระบุไว้ต่อจากอันดับความน่าเชื่อถือทุกระดับ เพื่อแยกความแตกต่างออกจากการจัดอันดับความน่าเชื่อถือระดับสากล เครื่องหมาย “+” หรือ “-” อาจจะถูกระบุไว้เพิ่มเติมต่อจากอันดับความน่าเชื่อถือสำหรับประเทศหนึ่งๆ เพื่อแสดงถึงสถานะย่อยโดยเปรียบเทียบกับกันภายในอันดับความน่าเชื่อถือชั้นหลัก ทั้งนี้ จะไม่มีการระบุสัญลักษณ์ต่อท้ายดังกล่าวสำหรับอันดับความน่าเชื่อถืออันดับ “AAA (tha)” หรืออันดับที่ต่ำกว่า “CCC (tha)”

สำหรับอันดับความน่าเชื่อถือในระยะยาวและจะไม่มีการระบุสัญลักษณ์ต่อท้ายดังกล่าวสำหรับอันดับความน่าเชื่อถือในระยะสั้น นอกเหนือจาก “F1(tha)”

สัญญาณการปรับอันดับความน่าเชื่อถือ (Rating Watch) : สัญญาณการปรับอันดับความน่าเชื่อถือจะถูกใช้เพื่อแจ้งให้นักลงทุนทราบว่ามีความเป็นไปได้ที่จะมีการเปลี่ยนแปลงอันดับความน่าเชื่อถือและแจ้งแนวโน้มทิศทางของการเปลี่ยนแปลงดังกล่าว สัญญาณดังกล่าวอาจระบุเป็น “สัญญาณบวก” ซึ่งบ่งชี้แนวโน้มในการปรับอันดับความน่าเชื่อถือให้สูงขึ้น “สัญญาณลบ” จะบ่งชี้แนวโน้มในการปรับอันดับความน่าเชื่อถือให้ต่ำลง หรือ “สัญญาณวิวัฒน์” ในกรณีที่อันดับความน่าเชื่อถืออาจจะได้รับการปรับขึ้นปรับลงหรือคงที่โดยปกติ สัญญาณการปรับอันดับความน่าเชื่อถือมักจะถูกระบุไว้สำหรับช่วงระยะเวลาสั้นๆ

กองทุนเปิดเคแธม ธีมเมติก ทริกเกอร์ ฟันด์6

งบแสดงฐานะการเงิน

วันที่ 30 พฤศจิกายน 2566

| | (บาท) |
|--|----------------------|
| สินทรัพย์ | |
| เงินลงทุนตามราคายุติธรรม (ราคาทุน 55,544,740.00 บาท) | 57,253,628.73 |
| เงินสดและเงินฝากธนาคาร | 3,252,352.02 |
| ลูกหนี้ | |
| จากเงินปันผลและดอกเบี๋ย | 3,557.89 |
| จากการขายเงินลงทุน | 1,871,899.68 |
| ค่าใช้จ่ายรอการตัดบัญชี | 24,015.75 |
| ปรับมูลค่าเงินที่ต้องจ่ายสัญญาขายเงินตราต่างประเทศล่วงหน้า | 269,734.19 |
| รวมสินทรัพย์ | <u>62,675,188.26</u> |
| หนี้สิน | |
| เจ้าหนี้ | |
| จากการซื้อเงินลงทุน | 1,805,601.55 |
| ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย | 81,819.99 |
| หนี้สินรวม | <u>1,887,421.54</u> |
| สินทรัพย์สุทธิ | <u>60,787,766.72</u> |
| สินทรัพย์สุทธิ : | |
| ทุนที่ได้รับจากผู้ถือหน่วยลงทุน | 72,029,075.97 |
| กำไรสะสม | (14,355,425.66) |
| บัญชีปรับสมดุลย์ | 3,114,116.41 |
| สินทรัพย์สุทธิ | <u>60,787,766.72</u> |
| จำนวนหน่วยลงทุนที่ออกจำหน่ายแล้วทั้งหมด(หน่วย) | 7,202,907.5830 |
| สินทรัพย์สุทธิต่อหน่วยลงทุน (บาท) | 8.4393 |

กองทุนเปิดเคแอม ธีมเมติก ทริกเกอร์ ฟันด์6

งบกำไรขาดทุนเบ็ดเสร็จ

สำหรับปีรอบระยะเวลาบัญชีตั้งแต่วันที่ 1 มิถุนายน 2566 ถึงวันที่ 30 พฤศจิกายน 2566

| | (บาท) |
|--|-----------------------------------|
| รายได้จากการลงทุน | |
| รายได้เงินปันผล | 563,102.03 |
| รายได้ดอกเบี้ย | 3,911.32 |
| รายได้อื่น | 2,127.25 |
| รายได้ทั้งสิ้น | <u>569,140.60</u> |
| ค่าใช้จ่าย | |
| ค่าธรรมเนียมการจัดการ | 364,756.51 |
| ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ | 8,086.60 |
| ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน | 34,410.99 |
| ค่าธรรมเนียมวิชาชีพ | |
| ค่าธรรมเนียมการสอบบัญชี | 17,499.71 |
| ค่าใช้จ่ายในการดำเนินโครงการ | 300,070.34 |
| ค่าใช้จ่ายทั้งสิ้น | <u>724,824.15</u> |
| รายได้จากการลงทุนสุทธิ | <u><u>(155,683.55)</u></u> |
| รายการกำไรหรือขาดทุนสุทธิจากเงินลงทุน | |
| รายการกำไรหรือขาดทุนสุทธิที่เกิดขึ้นทั้งสิ้น | 2,489,971.62 |
| รายการกำไรหรือขาดทุนสุทธิที่เกิดขึ้นทั้งสิ้น (จากอัตราแลกเปลี่ยน) | 2,421,396.20 |
| กำไรหรือขาดทุนที่ยังไม่เกิดขึ้นจากอัตราแลกเปลี่ยน | (3,697,867.29) |
| รายการกำไรหรือขาดทุนสุทธิที่ยังไม่เกิดขึ้นจากเงินลงทุนทั้งสิ้น (ระหว่างปี) | 330,517.39 |
| รวมรายการกำไรหรือขาดทุนจากการลงทุนที่เกิดขึ้นและที่ยังไม่เกิดขึ้น | <u>1,544,017.92</u> |
| การเพิ่มขึ้นในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงานก่อนหักเงินปันผลจ่าย | <u><u>1,388,334.37</u></u> |

กองทุนเปิดเคแอม ธีมเมติก ทริกเกอร์ ฟันด์6

งบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน

ณ วันที่ 30 พฤศจิกายน 2566

จัดการโดย บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงเทพ จำกัด (มหาชน)

(หน่วย : บาท)

| | มูลค่าที่ตราไว้/ จำนวนหน่วย | ราคาทุน | ดอกเบี้ย / เงินปันผล ค้างรับ | มูลค่ายุติธรรม | อัตราส่วน ของมูลค่า ยุติธรรม | อัตรา ดอกเบี้ย (%) | วันครบ กำหนด |
|---|--------------------------------|----------------------|------------------------------------|----------------------|------------------------------------|--------------------------|-----------------|
| ตราสารแสดงสิทธิในหน่วยลงทุนและใบสำคัญแสดงสิทธิที่จะซื้อหน่วยลงทุน | | | | | | | |
| หน่วยลงทุน | | | | | | | |
| <u>Blackrock International Management (BLACKROC)</u> | | | | | | | |
| 1329JP - iShares Core Nikkei 225 ETF | 813.00 | 6,460,886.10 | 0.00 | 6,773,203.77 | 11.83% | | |
| IJRUS - IJRUS : iShares Core S&P Small-Cap ETF | 716.00 | 2,441,181.81 | 0.00 | 2,426,934.12 | 4.24% | | |
| IWQULN - iShares Edge MSCI World Quality Factor UCITS ETF | 8,990.00 | 17,524,234.03 | 0.00 | 17,810,313.75 | 31.11% | | |
| รวม Blackrock International Management (BLACKROC) | 10,519.00 | 26,426,301.94 | 0.00 | 27,010,451.64 | 47.18% | | |
| <u>ETF MANAGERS GROUP (ETFMGR)</u> | | | | | | | |
| MJUS - MJ US EQUITY : ETFMG Alternative Harvest ETF | 26,556.00 | 3,010,578.65 | 0.00 | 2,908,790.22 | 5.08% | | |
| รวม ETF MANAGERS GROUP (ETFMGR) | 26,556.00 | 3,010,578.65 | 0.00 | 2,908,790.22 | 5.08% | | |
| <u>INVESCO POWERSHARES (INVESPCS)</u> | | | | | | | |
| QQQUS - QQQ US EQUITY : Invesco QQQ Trust Series 1 | 472.00 | 6,090,163.04 | 0.00 | 6,463,847.71 | 11.29% | | |
| รวม INVESCO POWERSHARES (INVESPCS) | 472.00 | 6,090,163.04 | 0.00 | 6,463,847.71 | 11.29% | | |
| <u>SPDR S&P 500 ETF TRUST (SPY)</u> | | | | | | | |
| SPY - SPDR S&P 500 ETF TRUST XLKUS - Technology Select Sector SPDR Fund | 261.00 | 3,992,453.58 | 0.00 | 4,195,420.49 | 7.33% | | |
| 905.00 | 5,688,018.30 | 0.00 | 5,901,808.36 | 10.31% | | | |
| รวม SPDR S&P 500 ETF TRUST (SPY) | 1,166.00 | 9,680,471.88 | 0.00 | 10,097,228.85 | 17.64% | | |
| <u>The Vanguard Group. (VANGRP)</u> | | | | | | | |
| VGK - Vanguard FTSE Europe ETF | 1,594.00 | 3,432,952.30 | 0.00 | 3,459,388.70 | 6.04% | | |
| รวม The Vanguard Group. (VANGRP) | 1,594.00 | 3,432,952.30 | 0.00 | 3,459,388.70 | 6.04% | | |
| รวม หน่วยลงทุน | 40,307.00 | 48,640,467.81 | 0.00 | 49,939,707.12 | 87.23% | | |

กองทุนเปิดเคแอม อิมเมติก ทริกเกอร์ ฟันด์6

งบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน (ต่อ)

ณ วันที่ 30 พฤศจิกายน 2566

จัดการโดย บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงไทย จำกัด (มหาชน)

(หน่วย : บาท)

| | มูลค่าที่ตราไว้/ จำนวนหน่วย | ราคาทุน | ดอกเบี้ยย / เงินปันผล ค้างรับ | มูลค่ายุติธรรม | อัตราส่วน ของมูลค่า ยุติธรรม | อัตรา ดอกเบี้ย (%) | วันครบ กำหนด |
|--|--------------------------------|----------------------|-------------------------------------|----------------------|------------------------------------|--------------------------|-----------------|
| หุ้นสามัญ | | | | | | | |
| Mitsubishi UFJ Financial Group INC. (MUFG) | | | | | | | |
| 8306JP - Mitsubishi UFJ Financial Group Inc | 10,607.00 | 3,335,916.13 | 0.00 | 3,185,927.34 | 5.56% | | |
| รวม Mitsubishi UFJ Financial Group INC. (MUFG) | 10,607.00 | 3,335,916.13 | 0.00 | 3,185,927.34 | 5.56% | | |
| Pinduoduo Inc. (PDD) | | | | | | | |
| PDDUS - Pinduoduo Inc. | 448.00 | 1,784,269.22 | 0.00 | 2,326,390.89 | 4.06% | | |
| รวม Pinduoduo Inc. (PDD) | 448.00 | 1,784,269.22 | 0.00 | 2,326,390.89 | 4.06% | | |
| รวม หุ้นสามัญ | 11,055.00 | 5,120,185.35 | 0.00 | 5,512,318.23 | 9.63% | | |
| รวม ตราสารแสดงสิทธิในหน่วยลงทุนและ ใบสำคัญแสดงสิทธิที่จะซื้อหน่วยลงทุน หุ้นและใบสำคัญแสดงสิทธิที่จะซื้อหุ้น หุ้นสามัญ | 51,362.00 | 53,760,653.16 | 0.00 | 55,452,025.35 | 96.85% | | |
| หมวดเทคโนโลยี (S3) | | | | | | | |
| MSFTUS - Microsoft Corp | 135.00 | 1,784,086.84 | 0.00 | 1,801,603.38 | 3.15% | | |
| รวม หมวดเทคโนโลยี (S3) | 135.00 | 1,784,086.84 | 0.00 | 1,801,603.38 | 3.15% | | |
| รวม หุ้นสามัญ | 135.00 | 1,784,086.84 | 0.00 | 1,801,603.38 | 3.15% | | |
| รวม หุ้นและใบสำคัญแสดงสิทธิที่จะซื้อหุ้น รวมเงินลงทุน | 51,497.00 | 55,544,740.00 | 0.00 | 57,253,628.73 | 100.00% | | |

ความเห็นของบริษัทจัดการกองทุนรวมเกี่ยวกับการลงทุน
เพื่อเป็นทรัพย์สินของ
กองทุนเปิดเคแทม อิมเมติก ทริกเกอร์ ฟันด์6

1. สภาพตลาดในช่วงรอบปีบัญชี ระหว่างวันที่ 1 มิถุนายน 2566 ถึงวันที่ 30 พฤศจิกายน 2566

กองทุนเปิดเคแทม อิมเมติก ทริกเกอร์ ฟันด์6 โดยกองทุนจะลงทุนในกองทุนใดกองทุนหนึ่งโดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่เกินร้อยละ 79 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน ซึ่งสามารถปรับเปลี่ยนสัดส่วนการลงทุนได้ตามดุลยพินิจของผู้จัดการกองทุน ทั้งนี้ กองทุนจะลงทุนในต่างประเทศซึ่งจะส่งผลให้มี net exposure ที่เกี่ยวข้องกับความเสี่ยงต่างประเทศโดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุนหรือตามอัตราส่วนที่สำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ต. ประกาศกำหนด นอกจากนี้กองทุนอาจลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมอื่น กองทุนรวมอสังหาริมทรัพย์ทรัสต์เพื่อการลงทุนในอสังหาริมทรัพย์ (REITs) กองทุนรวมโครงสร้างพื้นฐาน ซึ่งอยู่ภายใต้การจัดการของบริษัทจัดการ ในสัดส่วนโดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่เกินร้อยละ 20 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน

สำหรับช่วงครึ่งปีแรกของปี 2566 ตลาดหุ้นโลกสามารถปรับตัวสูงขึ้นได้ดี ซึ่งตลาดได้คลายความกังวลต่อการเกิดภาวะเศรษฐกิจถดถอยของเศรษฐกิจโลก เป็นอย่างมาก โดยในสหรัฐฯ แม้ Yield Curve จะยังอยู่ในภาวะ Inverted แต่ตัวเลขเศรษฐกิจที่ออกมาแสดงถึง Positive Sentiment สะท้อนจาก Economic Surprise Index ที่ออกมาเป็นบวกต่อเนื่อง รวมถึงภาคการจ้างงานที่ยังคงแข็งแกร่ง ในขณะที่เงินเฟ้อเริ่มส่งสัญญาณชะลอตัวลง ทำให้ตลาดมีมุมมองว่า FED จะเข้าใกล้จุดสิ้นสุดการ Tightening Policy และมีโอกาสที่จะลดดอกเบี้ยลงในปีนี้ นอกจากนี้ผลประกอบการบริษัทจดทะเบียนไตรมาส 1 ที่ออกมาดีกว่าคาด ประกอบกับเม็ดเงินที่ไหลเข้ามาลงทุนในหุ้นกลุ่มเทคโนโลยี AI ก็เป็นปัจจัยบวกที่หนุนให้ตลาดหุ้นให้ผลตอบแทนดีเมื่อเทียบกับสินทรัพย์อื่น ๆ ในช่วงครึ่งปีแรกเช่นกัน แม้ตลาดจะเผชิญกับปัจจัยกดดันเป็นระยะ ทั้งปัญหา Regional Bank ในสหรัฐฯ ล้ม, Geopolitical risks ระหว่างสหรัฐฯ กับจีน หรือระหว่างรัสเซียกับยูเครน และปัญหาเพดานหนี้สหรัฐฯ ก็ตาม ในขณะที่ผลการประชุม FOMC ในเดือนมิถุนายน FED ได้ทำการคงอัตราดอกเบี้ยนโยบายอยู่ที่ 5.00-5.25% ตามคาด แต่ Dot Plot มีการปรับคาดการณ์การขึ้นดอกเบี้ยใหม่ ซึ่งอาจจะขึ้นอีก 0.25% 2 ครั้งในปีนี้ สู่ระดับ 5.6% (จากเดิม 5.1%) และกรรมการ FED ที่ยังออกมาให้สัมภาษณ์ในโทน Hawkish ต่อไป ทำให้ตลาดมีการปรับตัวลดลงมาเกือบ 3% จากความไม่แน่นอนและการ Reprice ต่อมุมมองการขึ้นดอกเบี้ยใหม่ ก่อนตลาดจะปรับตัวสูงขึ้นไปสู่ระดับใกล้เคียงก่อนการประชุม หลังตัวเลขเศรษฐกิจยังออกมาดีกว่าคาด ไม่ว่าจะเป็นยอดสั่งซื้อสินค้าคงทน, ยอดขายบ้านใหม่ และดัชนีความเชื่อมั่นผู้บริโภคที่สูงสุดในรอบ 17 เดือน อีกทั้งยังได้รับปัจจัยหนุนจากการผ่าน Stress test ของธนาคารในสหรัฐฯ ในขณะที่ตัวเลขเงินเฟ้อที่ออกมาต่ำกว่าตลาดคาด ทั้ง Headline PCE และ Core PCE รวมถึงตัวเลขการจ้างงานภาคเอกชน และตำแหน่งงานเปิดใหม่ในสหรัฐฯ ที่ปรับตัวลดลง ยังลดแรงกดดันของตลาดต่อการขึ้นดอกเบี้ยของ FED อย่างไรก็ดี ตลาดยังคงมีความเสี่ยงจากอัตราผลตอบแทนสหรัฐฯ โดยเฉพาะอายุ 10 ปี ที่พุ่งสูงขึ้นต่อเนื่องในช่วงไตรมาส 3/2566 ประกอบกับช่วงเวลาดังกล่าวมักเป็นช่วงที่ตลาดมักจะถูกเทขายตาม Seasonal effect ทำให้ตลาดปรับตัวลดลงในช่วงเวลาดังกล่าว

2. การเปลี่ยนแปลงที่เกิดขึ้นในรอบบัญชีที่ผ่านมาเมื่อเทียบกับรอบปีบัญชีก่อนหน้า

สัดส่วนการลงทุน ณ วันที่ 1 มิถุนายน 2566 ถึงวันที่ 30 พฤศจิกายน 2566 กองทุนฯ มีการลงทุนในหน่วยลงทุนต่างประเทศเพิ่มขึ้นจากร้อยละ 92.29 เป็นร้อยละ 94.19 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิ และถือครองเงินสดเพื่อสภาพคล่องและสินทรัพย์อื่น ๆ ลดลงจากร้อยละ 7.71 เป็นร้อยละ 5.81 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิ

รายงานข้อมูลการทำธุรกรรมกับบุคคลที่เกี่ยวข้องของ
กองทุนเปิดเคแธม ธีมเมติก ทริกเกอร์ ฟันด์ 6
รอบระยะเวลาบัญชีระหว่าง วันที่ 1 มิถุนายน 2566 ถึงวันที่ 30 พฤศจิกายน 2566

| ลำดับ | รายชื่อบุคคลที่เกี่ยวข้องที่ทำธุรกรรม |
|-------|---------------------------------------|
| 1 | ธนาคาร กรุงไทย จำกัด (มหาชน) |

ผู้ลงทุนสามารถตรวจสอบรายละเอียดการทำธุรกรรมกับบุคคลที่เกี่ยวข้องกับกองทุนรวมได้ที่บริษัทจัดการโดยตรง
หรือที่ website ของบลจ.ที่ <http://www.ktam.co.th>
หรือที่ website ของสำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ต. ที่ <http://www.sec.or.th>

รายงานการลงทุนไม่เป็นไปตามนโยบายการลงทุนเฉลี่ยในรอบปีบัญชี
กองทุนเปิดเคแธม ธีมเมติก ทริกเกอร์ ฟันด์ 6
รอบปีบัญชีระหว่างวันที่ 1 มิถุนายน 2566 ถึงวันที่ 30 พฤศจิกายน 2566

| วันที่ | รายละเอียด | การดำเนินการแก้ไข |
|--------|--|-------------------|
| | การลงทุนเป็นไปตามนโยบายการลงทุน | |

เงื่อนไขการรับผลประโยชน์ตอบแทน

เพื่อกองทุนจากบุคคลที่เป็นผู้ให้บริการในการจัดการกองทุน (Soft/hard dollar)

(1) บริษัทจัดการจะรับผลประโยชน์ตอบแทนจากการที่กองทุนใช้บริการบุคคลอื่น โดยเฉพาะบริษัทนายหน้าได้ โดยผลประโยชน์นั้นต้องเป็นทรัพย์สินที่มีมูลค่าทางเศรษฐกิจและเป็นประโยชน์โดยตรงต่อกองทุน เช่น บทวิเคราะห์ บทวิจัยต่างๆ ที่ใช้ในการประกอบการตัดสินใจลงทุนของกองทุน อุปกรณ์อิเล็กทรอนิกส์ หรือซอฟต์แวร์ เพื่ออำนวยความสะดวกในการรับบทวิเคราะห์ บทวิจัย ดังกล่าว บริษัทไม่มีเจตนาในการใช้บริการจากบุคคลดังกล่าวที่บ่อนทำลายความจำเป็นเพื่อจุดประสงค์ในการรับผลประโยชน์จากผู้ให้บริการ บริษัทจัดการจะจัดสรรการรับผลประโยชน์ตอบแทนด้วยความเป็นธรรม โดยคำนึงถึงประโยชน์ของกองทุนเป็นหลัก

(2) บริษัทจัดการไม่สามารถรับ (soft/hard dollar) เพื่อประโยชน์ของบริษัทจัดการได้ เนื่องจากเป็นข้อห้ามตามกฎหมาย และโดยวิชาชีพเป็นสิ่งที่ไม่พึงกระทำ เว้นแต่ เป็นการรับผลประโยชน์ที่ผู้ให้บริการจัดให้แก่บริษัทจัดการหรือพนักงานของบริษัทจัดการตามเทศกาลที่เป็นประเพณีนิยมตามแนวทางปฏิบัติที่บริษัทประกาศไว้ภายในบริษัท ซึ่งกองทุนอาจขอดูแนวทางนี้ได้ที่ website ของบริษัท



รายงานความเห็นของผู้ดูแลผลประโยชน์

เสนอ ผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุนกองทุนเปิดเคแอม อีเอ็มเทค ทริกเกอร์ ฟันด์ 6

ตามที่ธนาคารไทยพาณิชย์ จำกัด (มหาชน) ในฐานะผู้ดูแลผลประโยชน์กองทุนเปิดเคแอม อีเอ็มเทค ทริกเกอร์ ฟันด์ 6 ซึ่งมีบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงไทย จำกัด (มหาชน) เป็นผู้จัดการกองทุนได้ปฏิบัติหน้าที่ดูแลผลประโยชน์ของกองทุนดังกล่าว สำหรับระยะเวลาตั้งแต่วันที่ 1 มิถุนายน 2566 ถึงวันที่ 30 พฤศจิกายน 2566 แล้วนั้น

ธนาคารฯ เห็นว่าบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงไทย จำกัด (มหาชน) ได้ปฏิบัติหน้าที่ในการจัดการกองทุนเปิดเคแอม อีเอ็มเทค ทริกเกอร์ ฟันด์ 6 โดยถูกต้องตามที่ควรตามวัตถุประสงค์ที่กำหนดไว้ในโครงการจัดการที่ได้รับอนุมัติจากสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์และภายใต้พระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535

ขอแสดงความนับถือ

ธนาคารไทยพาณิชย์ จำกัด (มหาชน)



(นางสาวกรงจิต ชำนาญธรรม)

ผู้จัดการบริการหลักทรัพย์

