

รายงานรอบระยะเวลาหกเดือน

กองทุนเปิดชนชาติ Small Medium Cap

(T-SM Cap)

สำหรับรอบระยะเวลาบัญชี

ตั้งแต่วันที่ 4 พฤศจิกายน 2565 ถึง วันที่ 3 พฤษภาคม 2566

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน อีสท์สปริง (ประเทศไทย) จำกัด

สาส์นจาก บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน อีสท์สปริง (ประเทศไทย) จำกัด

เรียน ท่านผู้ถือหุ้นฯ

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน อีสท์สปริง (ประเทศไทย) จำกัด (บลจ.อีสท์สปริง (ประเทศไทย)) โคร์ขอรายงาน การดำเนินงานของกองทุนเปิดธนชาติ Small Medium Cap สำหรับรอบระยะเวลาระหว่างวันที่ 4 พฤศจิกายน 2565 ถึง วันที่ 3 พฤษภาคม 2566 ให้ท่านผู้ถือหุ้นฯได้ทราบดังนี้

เศรษฐกิจไทยปี 2565 ขยายตัวได้ร้อยละ 2.6 เร่งตัวจากปีก่อนที่ร้อยละ 1.6 อย่างไรก็ดีสภาวะตลาดการเงินและเศรษฐกิจโลก ปี 2565 เผชิญความท้าทายอย่างมาก โดยธนาคารกลางประเทศต่างๆ โดยเฉพาะ สหรัฐอเมริกา เริ่มใช้นโยบายทางการเงินแบบเข้มงวด และส่งสัญญาณการปรับขึ้นอัตราดอกเบี้ยที่เร็วและแรงกว่าที่ตลาดคาด เพื่อรับมืออัตราเงินเฟ้อที่เร่งตัว ซึ่งเกิดจากทั้งปัจจัยด้านอุปสงค์ ทั่วโลกที่เพิ่มมากขึ้นจากการฟื้นตัวทางเศรษฐกิจโลกตั้งแต่ช่วงปีก่อนหน้า ขณะที่ด้านอุปทาน เผชิญปัญหาห่วงโซ่อุปทาน และความขัดแย้งเชิงภูมิศาสตร์การเมือง โดยเฉพาะสงครามระหว่าง รัสเซีย - ยูเครน จากประเด็นข้างต้น ส่งผลให้สภาพคล่องในระบบ การเงินโลกเริ่มลดลง และเศรษฐกิจโลกเริ่มส่งสัญญาณชะลอตัว และนำไปสู่การหดตัวของภาคการส่งออกในช่วงไตรมาส 4/65 โดยมูลค่า ส่งออกหดตัวร้อยละ 7.5 ในช่วงไตรมาสดังกล่าว ส่งผลให้การปรับขึ้นของตลาดหุ้นเป็นไปได้อย่างจำกัด ทำให้ SET index ปิดสิ้นปี ที่ 1668.66 จุด ปรับตัวขึ้นเพียง 11.46 จุดหรือร้อยละ 0.69 เมื่อเทียบกับปีก่อน ขณะที่ระหว่างปีสามารถทำจุดสูงสุดได้ที่ 1711.58 จุด

แนวโน้มเศรษฐกิจปี 2566 นั้น การเติบโตทางเศรษฐกิจโลกคาดว่าจะยังชะลอตัวและมีแนวโน้มเข้าสู่ภาวะถดถอยในช่วงปลายปี 2566 - ต้นปี 2567 อันเป็นผลกระทบจากนโยบายการเงินแบบเข้มงวดแบบต่อเนื่อง อย่างไรก็ตามยังคงมีมุมมองเชิงบวกต่อเศรษฐกิจไทยเมื่อเทียบกับเศรษฐกิจโลก นำโดยการฟื้นตัวจากภาคการท่องเที่ยวอย่างต่อเนื่อง และการส่งออกที่คาดว่าจะเริ่มฟื้นตัว ในช่วงไตรมาส 4/66 หลังจากผลกระทบของการเร่งตัวในช่วงปีก่อนหน้าทำให้ฐานสูงหมดไป ทั้งนี้แม้ว่าธนาคารแห่งประเทศไทยจะปรับลดประมาณการการเติบโตทางเศรษฐกิจไทยในปี 2566 จากที่จะมีการเติบโตอยู่ที่ร้อยละ 3.7 เป็นร้อยละ 3.6 เมื่อเทียบกับปีก่อน แต่อัตรา การเติบโตยังคงเร่งตัวจากร้อยละ 2.6 ในปีก่อน

ด้านตลาดการเงิน โลกเองได้รับความผันผวนจากทั้งความกังวลต่อการชะลอตัวเศรษฐกิจที่คาดว่าจะเห็นการหดตัวในช่วงครึ่ง ปีหลัง โดยในช่วงที่ผ่านมาเริ่มเห็นสัญญาณจากผลกระทบของการปรับขึ้นอัตราดอกเบี้ย ต่อการดำเนินกิจการของบริษัทจดทะเบียนต่างๆ ทั่วโลก โดยเฉพาะภาคการเงินการธนาคารที่เริ่มเห็นผลกระทบจากต้นทุนทางการเงินที่สูงขึ้น นำไปสู่การขาดสภาพคล่องและ ความเชื่อมั่นต่อ Silicon Valley Bank และ The First Republic Bank ในสหรัฐอเมริกา และ Credit Suisse ในสวิตเซอร์แลนด์ อย่างไรก็ตาม ธนาคารกลางทั้ง Fed และ SNB (Swiss National Bank) ต่างออกมาตรการรับมือช่วยเหลือ อย่างเด็ดขาดและรวดเร็ว ช่วยสร้างความมั่นใจให้กับตลาดอีกครั้ง

สำหรับตลาดหุ้นไทยนั้น มีการปรับตัวลดลงต่อเนื่องตั้งแต่ช่วงต้นปี 2566 ตามการปรับประมาณการกำไรตลาดปี 2566 ลง อย่างต่อเนื่องตั้งแต่การประกาศผลประกอบการไตรมาส 4/65 ตลอดจนผลประกอบการ 1/66 ที่ออกมาต่ำกว่าคาดและส่งสัญญาณอ่อนแอ อย่างต่อเนื่อง นอกจากนี้ผลการเลือกตั้งทั่วไปอย่างไม่เป็นทางการในวันที่ 14 พ.ค. 2566 ที่ผ่านมา พรรคก้าวไกลมีโอกาสได้จำนวน สส. มากที่สุด จึงมีสิทธิ์เป็นผู้นำพรรคแรกในการจัดตั้งรัฐบาล ซึ่งผลดังกล่าวสร้างความประหลาดใจและผิดหวังที่หลายฝ่ายคาดไว้ในตอนแรก ส่งผลให้นักลงทุน โดยเฉพาะนักลงทุนต่างชาติมีความกังวลต่อความเสี่ยงทางการเมืองที่อาจเพิ่มสูงขึ้น ทั้งความไม่แน่นอนในการจัดตั้ง รัฐบาล ความไม่แน่นอนจากประเด็นเชิงนโยบาย ที่อาจจะเกิดขึ้นตามมา อย่างไรก็ตามประเมินว่าประเด็นดังกล่าวเป็นแค่ความกังวล ในระยะสั้น และคาดว่าตลาดหุ้นไทยยังสามารถฟื้นตัวได้ ตามการฟื้นตัวเศรษฐกิจทั้งการท่องเที่ยว และส่งออกในช่วงครึ่งปีหลัง

สำหรับกองทุนเปิดธนชาติ Small Medium Cap ในรอบ 6 เดือนที่ผ่านมา กองทุนยังรักษาการลงทุนตามนโยบายการลงทุน โดยน้ำหนักการลงทุนส่วนมากอยู่ใน กลุ่มอาหารและเครื่องดื่ม กลุ่มพัฒนาอสังหาริมทรัพย์ และ กลุ่มพาณิชย์

ท้ายที่สุดนี้ บลจ.อีสท์สปริง (ประเทศไทย) ขอให้คำมั่นว่าบริษัทจะพิจารณาการลงทุนอย่างรอบคอบ เพื่อผลประโยชน์สูงสุด ของผู้ถือหุ้นฯทุกท่าน

ขอแสดงความนับถือ

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน อีสท์สปริง (ประเทศไทย) จำกัด

ตารางเปรียบเทียบผลการดำเนินงาน								
	ตั้งแต่ ต้นปี 30 ธ.ค. 65 ถึง 3 พ.ค. 66	ย้อนหลัง 3 เดือน 3 ก.พ. 66 ถึง 3 พ.ค. 66	ย้อนหลัง 6 เดือน 3 พ.ย. 65 ถึง 3 พ.ค. 66	ย้อนหลัง 1 ปี ¹ 3 พ.ค. 65 ถึง 3 พ.ค. 66	ย้อนหลัง 3 ปี ¹ 3 พ.ค. 63 ถึง 3 พ.ค. 66	ย้อนหลัง 5 ปี ¹ 3 พ.ค. 61 ถึง 3 พ.ค. 66	ย้อนหลัง 10 ปี ¹ - ถึง 3 พ.ค. 66	ตั้งแต่จัดตั้ง กองทุน ¹ 4 พ.ย. 57 ถึง 3 พ.ค. 66
T-SM Cap	-10.29	-13.79	-9.02	-12.77	12.18	0.36	-	4.23
Benchmark	-6.67	-7.79	-4.05	-4.37	8.57	-0.07	-	2.75
ความผันผวนของ ผลการดำเนินงาน	15.01	16.61	13.71	14.87	15.97	19.06	-	16.98
ความผันผวนของ Benchmark	11.51	12.77	10.58	11.16	13.62	16.72	-	14.95

ผลการดำเนินงาน 3 เดือน และ 6 เดือน ไม่ได้คำนวณเป็น % ต่อปี

1 ผลการดำเนินงานย้อนหลัง 1 ปีขึ้นไป คิดเป็น % ต่อปี

2 Information Ratio แสดงความสามารถของผู้จัดการกองทุน ในการสร้างผลตอบแทนเมื่อเทียบกับความเสี่ยง Benchmark คำนวณจาก

1. ดัชนีผลตอบแทนรวมตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET TRD) สัดส่วน 100%

สำหรับผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด ผลการดำเนินงานน้อยกว่า 1 ปี คำนวณตามระยะเวลาจริง

การเปิดเผยอัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน

ข้อมูลอัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุนของกองทุนรวม (Portfolio Turnover Ratio : “PTR”) เท่ากับ 1.90 รอบของ
กองทุนรวมในรอบระยะเวลาบัญชี

การใช้สิทธิออกเสียงในที่ประชุมผู้ถือหุ้นบริษัทจัดการ

ท่านผู้ถือหุ้นรายละสามารถค้นหารายละเอียดการเข้าร่วมประชุมสามัญประจำปีและประชุมวิสามัญของบริษัท
จัดการที่กองทุนถือลงทุนได้ผ่านทางเว็บไซต์ของ บลจ.อีสท์สปริง (ประเทศไทย) www.eastspring.co.th
ในเมนูหัวข้อ “เกี่ยวกับเรา/การกำกับดูแลกิจการ/นโยบายการใช้สิทธิออกเสียง”

ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวม มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต
ผู้ลงทุนควรศึกษาข้อมูลกองทุนรวม เงื่อนไขผลตอบแทนและความเสี่ยง ก่อนตัดสินใจลงทุน
เอกสารการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวมฉบับนี้ได้จัดทำขึ้นตามมาตรฐานการวัดและนำเสนอ
ผลการดำเนินงานของกองทุนรวมของสมาคมบริษัทจัดการลงทุน

รายงานค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุน

ของรอบบัญชีตั้งแต่วันที่ 04 พฤศจิกายน 2565 ถึงวันที่ 03 พฤษภาคม 2566

ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (fund's direct expense)	จำนวนเงิน (บาท)	ร้อยละของ มูลค่า
ค่าธรรมเนียมการจัดการ (management fee)	692,444.44	1.062%
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน (registrar fee)	43,277.84	0.066%
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ (trustee fee)	7,790.03	0.012%
ค่าที่ปรึกษาการลงทุน (advisory fee)	ไม่มี	ไม่มี
ค่าสอบบัญชี	20,735.44	0.032%
ค่าใช้จ่ายอื่นๆ	720.14	0.001%
รวมค่าใช้จ่ายทั้งหมด	764,967.89	1.173%

- ค่าธรรมเนียม ค่าใช้จ่าย รวมภาษีมูลค่าเพิ่มแล้ว
- ค่าใช้จ่ายทั้งหมดไม่รวมค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ และค่าธรรมเนียมต่างๆ ที่เกิดขึ้นจากการซื้อขายหลักทรัพย์
- ค่าใช้จ่ายดังกล่าวไม่รวมค่าใช้จ่ายภาษีตราสารหนี้

รายงานข้อมูลการทำธุรกรรมกับบุคคลที่เกี่ยวข้อง

ของรอบระยะเวลาบัญชี ตั้งแต่วันที่ 4 พฤศจิกายน 2565 ถึงวันที่ 3 พฤษภาคม 2566

รายชื่อบุคคลที่เกี่ยวข้องที่กองทุนมีการทำธุรกรรม

กองทุนภายใต้การจัดการของบริษัท

ผู้ลงทุนสามารถตรวจสอบการทำธุรกรรมกับบุคคลที่เกี่ยวข้องและรายชื่อผู้จัดการกองทุนได้ที่ บลจ.อีสท์สปริง (ประเทศไทย) โดยตรง หรือที่เว็บไซต์ของ บลจ.อีสท์สปริง (ประเทศไทย) (www.eastspring.co.th) และ สำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ต. (<http://www.sec.or.th>)

กองทุนเปิดธนชาติ Small Medium Cap

สำหรับรอบบัญชี 04 พฤศจิกายน 2565 ถึง 03 พฤษภาคม 2566

ค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์

ลำดับ	ชื่อบริษัทนายหน้า	ค่านายหน้า (พันบาท)	อัตราส่วนค่านายหน้า แต่ละรายต่อ ค่านายหน้าทั้งหมด
1	บริษัทหลักทรัพย์ ภัทร จำกัด (มหาชน)	134.86	29.57%
2	บริษัทหลักทรัพย์ ธนชาติ จำกัด (มหาชน)	112.09	24.57%
3	บริษัทหลักทรัพย์ อินโนเวสต์ เอกซ์ จำกัด	72.64	15.92%
4	บริษัทหลักทรัพย์ ซีจีเอส-ซีไอเอ็มบี (ประเทศไทย) จำกัด	64.25	14.08%
5	บริษัท หลักทรัพย์ ซี แอล เอส เอ (ประเทศไทย) จำกัด	58.42	12.81%
6	บริษัทหลักทรัพย์ โนมูระ พัฒนสิน จำกัด (มหาชน)	8.91	1.95%
7	บริษัทหลักทรัพย์ กรุงศรี พัฒนสิน จำกัด (มหาชน)	4.95	1.08%
8	บริษัทหลักทรัพย์เครดิต สวิส (ประเทศไทย) จำกัด	0.02	0.01%
9	บริษัทหลักทรัพย์ ทีเอสโก้ จำกัด	0.01	0.01%
รวมค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์		456.15	100.00%

รายงานความเห็นผู้ดูแลผลประโยชน์

เสนอ ผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุน
กองทุนเปิดธนาชาติ Small Medium Cap

ตามที่ ธนาคารกรุงศรีอยุธยา จำกัด (มหาชน) (“ธนาคารฯ”) ในฐานะผู้ดูแลผลประโยชน์ กองทุนเปิดธนาชาติ Small Medium Cap (“กองทุน”) ซึ่งมี บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน อีสท์สปริง (ประเทศไทย) จำกัด เป็นผู้จัดตั้งและจัดการกองทุน ได้ปฏิบัติหน้าที่ดูแลผลประโยชน์ของกองทุนดังกล่าว สำหรับรอบระยะเวลาหกเดือนของกองทุน ตั้งแต่วันที่ 4 พฤศจิกายน 2565 ถึงวันที่ 3 พฤษภาคม 2566

ธนาคารฯ เห็นว่า บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน อีสท์สปริง (ประเทศไทย) จำกัด ได้ปฏิบัติหน้าที่ในการจัดการโดยถูกต้องตามที่ควรตามวัตถุประสงค์ที่ได้กำหนดไว้ในโครงการจัดการที่ได้รับอนุมัติจากสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ และภายใต้พระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535

ผู้ดูแลผลประโยชน์

ธนาคารกรุงศรีอยุธยา จำกัด (มหาชน)



(นายจตุภูมิ ปรัชญาภิศปรีชา)

ผู้อำนวยการ ผู้บริหารฝ่าย

ฝ่ายพัฒนาผลิตภัณฑ์และควบคุมดูแลผลประโยชน์

ฝ่ายพัฒนาผลิตภัณฑ์และควบคุมดูแลผลประโยชน์

วันที่ 2 มิถุนายน 2566

ตารางการรับผลประโยชน์ตอบแทนเนื่องจากการที่กองทุนใช้บริการบุคคลอื่น

บริษัทคู่ค้าตราสารหนี้	รายการผลประโยชน์ตอบแทนของกองทุน
Bank of America The Bank of Nova Scotia ธนาคารกรุงเทพ จำกัด (มหาชน) ธนาคารกรุงไทย จำกัด (มหาชน) ธนาคารกรุงศรีอยุธยา จำกัด (มหาชน) ธนาคารกสิกรไทย จำกัด (มหาชน) ธนาคารเจฟิเมอร์แกน เซส ธนาคารซีทีแบงก์ ธนาคารซีไอเอ็มบี ไทย จำกัด (มหาชน) ธนาคารดอยซ์แบงก์ ธนาคารเดอระรอยัลแบงก์ออสเตรีย จำกัด (มหาชน) ธนาคารทหารไทยธนชาติ จำกัด (มหาชน) ธนาคารทีสโก้ จำกัด (มหาชน) ธนาคารไทยพาณิชย์ จำกัด (มหาชน) ธนาคารบีเอ็นพี พารีบาส์ ธนาคารยูโอบี จำกัด (มหาชน) ธนาคารสแตนดาร์ดชาร์เตอร์ด (ไทย) จำกัด (มหาชน) ธนาคารฮ่องกงและเซี่ยงไฮ้แบงกิงคอร์ปอเรชั่น จำกัด บริษัทหลักทรัพย์ เคจีไอ (ประเทศไทย) จำกัด บริษัทหลักทรัพย์ เคที ซีมิโก้ จำกัด บริษัทหลักทรัพย์ ธนชาติ จำกัด (มหาชน) บริษัทหลักทรัพย์ พัฒนสิน จำกัด (มหาชน) บริษัทหลักทรัพย์ เอเชียพลัส จำกัด (มหาชน)	ข้อมูลวิจัย เพื่อใช้เป็นข้อมูลในการตัดสินใจลงทุน

ตารางการรับผลประโยชน์ตอบแทนเนื่องจากการที่กองทุนใช้บริการบุคคลอื่น

บริษัทนายหน้า	รายการผลประโยชน์ตอบแทนของกองทุน
บริษัทหลักทรัพย์ กสิกรไทย จำกัด (มหาชน) บริษัทหลักทรัพย์ เครดิต สวิส (ประเทศไทย) จำกัด บริษัทหลักทรัพย์ ซีไอเอ็มบี (ประเทศไทย) จำกัด บริษัทหลักทรัพย์ ดีบีเอส วิคเตอร์ส (ประเทศไทย) จำกัด บริษัทหลักทรัพย์ ไทยพาณิชย์ จำกัด บริษัทหลักทรัพย์ ธนชาติ จำกัด (มหาชน) บริษัทหลักทรัพย์ บัวหลวง จำกัด (มหาชน) บริษัทหลักทรัพย์ ภัทร จำกัด (มหาชน) บริษัทหลักทรัพย์ เมย์แบงก์ กิมเอ็ง (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) บริษัทหลักทรัพย์ ยูโอบี เคย์เฮียน (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)	ข้อมูลวิจัย เพื่อใช้เป็นข้อมูลในการตัดสินใจลงทุน

รายงานสรุปเงินลงทุนในตราสารหนี้ เงินฝาก

ณ วันที่ 3 พฤษภาคม 2566

กลุ่มของตราสาร	มูลค่าตามราคาตลาด (พันบาท)	%NAV
(ก) ตราสารภาครัฐไทยและตราสารภาครัฐต่างประเทศ	-	-
(ข) ตราสารที่ธนาคารที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้นธนาคารพาณิชย์ หรือบริษัทเงินทุนเป็นผู้ออก ผู้ส่งจ่าย ผู้รับรอง ผู้รับอ่าวัด ผู้สลับหลัง หรือผู้ค้ำประกัน	7,178.64	12.13%
(ค) ตราสารที่มีบริษัทที่ได้รับ rating ในระดับ investment grade เป็นผู้ออก ผู้รับรอง ผู้รับอ่าวัด ผู้สลับหลัง หรือผู้ค้ำประกัน	-	-
(ง) ตราสารที่มีบริษัทที่ได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือในระดับที่ต่ำกว่า investment grade หรือไม่มี rating เป็นผู้ออก ผู้รับรอง ผู้รับอ่าวัด ผู้สลับหลัง หรือผู้ค้ำประกัน	-	-

สัดส่วนสูงสุด (Upper Limit) ที่บริษัทจัดการคาดว่าจะลงทุนในกลุ่ม (ง) 15.00% ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิ

กองทุนเปิดธนาชาติ Small Medium Cap
รายงานการลงทุนในหลักทรัพย์และทรัพย์สินอื่น
ณ วันที่ 3 พฤษภาคม 2566

ชื่อหลักทรัพย์	อัตรา ดอกเบี้ย (%)	อันดับความน่าเชื่อถือ				วันครบ กำหนด	จำนวนหน่วย (พันหน่วย)/ มูลค่าหน่วย (ล้านบาท)	มูลค่าตาม ราคาตลาดโดยรวม ดอกเบี้ยค้างรับ (ล้านบาท)	ร้อยละของ เงินลงทุน	มูลค่าตาม ราคาตลาดรวม ดอกเบี้ยค้างรับ (ล้านบาท)	ร้อยละของ มูลค่า ทรัพย์สิน สุทธิ
		TRIS	FITCH	S&P	Moody's						
หุ้นสามัญ							50,688.81	100.00	50,688.81	85.69	
ที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย							46,718.18	92.17	46,718.18	78.99	
วัสดุก่อสร้าง							871.65	1.72	871.65	1.47	
TOA	บริษัท ทีโอเอ เพ้นท์ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)					29.80	871.65	1.72	871.65	1.47	
พาณิชย์							5,961.86	11.76	5,961.86	10.08	
MOSHI	บริษัท โมชิ โมชิ รีเทล คอร์ปอเรชั่น จำกัด (มหาชน)					42.00	1,795.50	3.54	1,795.50	3.03	
KAMART	บริษัท คาร์มาร์ท จำกัด (มหาชน)					180.00	1,521.00	3.00	1,521.00	2.57	
MC	บริษัท แม็คกรุ๊ป จำกัด (มหาชน)					116.00	1,206.40	2.38	1,206.40	2.04	
DOHOME	บริษัท ดูโฮม จำกัด (มหาชน)					44.05	577.06	1.14	577.06	0.98	
BEAUTY	บริษัท บิวตี้ คอมมูนิตี้ จำกัด (มหาชน)					383.40	448.58	0.88	448.58	0.76	
MEGA	บริษัท เมก้า โลฟี่ไซแอนซ์ จำกัด (มหาชน)					9.90	413.33	0.82	413.33	0.70	
เทคโนโลยีสารสนเทศและการสื่อสาร							3,365.16	6.64	3,365.16	5.69	
THCOM	บริษัท ไทยคม จำกัด (มหาชน)					72.00	914.40	1.80	914.40	1.55	
BBIK	บริษัท บลูบิค กรุ๊ป จำกัด (มหาชน)					9.50	897.75	1.77	897.75	1.52	
ITEL	บริษัท อินเทอร์เน็ต เทคโนโลยี จำกัด (มหาชน)					193.40	572.46	1.13	572.46	0.97	
DITTO	บริษัท ดิทโต (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)					19.00	527.25	1.04	527.25	0.89	
FORTH	บริษัท ฟอर्थ คอร์ปอเรชั่น จำกัด (มหาชน)					11.90	333.20	0.66	333.20	0.56	
INSET	บริษัท อินฟราเซท จำกัด (มหาชน)					39.00	95.16	0.19	95.16	0.16	
BE8	บริษัท เบรล 8 พลัส จำกัด (มหาชน)					0.58	24.94	0.05	24.94	0.04	
พลังงานและสาธารณูปโภค							1,598.80	3.15	1,598.80	2.70	
BCP	บริษัท บางจาก คอร์ปอเรชั่น จำกัด (มหาชน)					32.80	959.40	1.89	959.40	1.62	
PTG	บริษัท พีทีจี เอ็นเนอยี จำกัด (มหาชน)					46.00	639.40	1.26	639.40	1.08	
สื่อและสิ่งพิมพ์							2,560.56	5.05	2,560.56	4.33	
PLANB	บริษัท แพลน บี มีเดีย จำกัด (มหาชน)					209.00	1,755.60	3.46	1,755.60	2.97	
MAJOR	บริษัท เมเจอร์ ซินีเพล็กซ์ กรุ๊ป จำกัด (มหาชน)					51.60	804.96	1.59	804.96	1.36	
เงินทุนและหลักทรัพย์							836.29	1.65	836.29	1.42	
SAK	บริษัท ศักดิ์สยามสิริซิ่ง จำกัด (มหาชน)					124.90	655.73	1.29	655.73	1.11	
HENG	บริษัท เฮงสิริซิ่ง แอนด์ แคปปิตอล จำกัด (มหาชน)					74.00	180.56	0.36	180.56	0.31	
อาหารและเครื่องดื่ม							7,014.52	13.84	7,014.52	11.86	
SAPPE	บริษัท เซ็ปเป้ จำกัด (มหาชน)					25.00	1,525.00	3.01	1,525.00	2.58	
SNNP	บริษัท ศรีนาวพร มาร์เก็ตติ้ง จำกัด (มหาชน)					62.30	1,470.28	2.90	1,470.28	2.48	
TKN	บริษัท เท้าแกนนอย ฟู้ดแอนด์มาร์เก็ตติ้ง จำกัด (มหาชน)					161.60	1,446.32	2.85	1,446.32	2.44	

กองทุนเปิดธนาชาติ Small Medium Cap
รายงานการลงทุนในหลักทรัพย์และทรัพย์สินอื่น
ณ วันที่ 3 พฤษภาคม 2566

ชื่อหลักทรัพย์	อัตรา ดอกเบี้ย (%)	อันดับความน่าเชื่อถือ				วันครบ กำหนด	จำนวนหน่วย (พันหน่วย/ มูลค่าหน้าตัว มูลค่าบาท)	มูลค่าตาม ราคาตลาดโดยรวม ดอกเบี้ยข้างรับ (พันบาท)	ร้อยละของ เงินลงทุน	มูลค่าตาม ราคาตลาดรวม ดอกเบี้ยข้างรับ (พันบาท)	ร้อยละของ มูลค่า ทรัพย์สิน สุทธิ
		TRIS	FITCH	S&P	Moody's						
ZEN	บริษัท เซ็น คอร์ปอเรชั่น กรุ๊ป จำกัด (มหาชน)					96.00	1,334.40	2.63	1,334.40	2.26	
ICHI	บริษัท อิซิดัน กรุ๊ป จำกัด (มหาชน)					53.80	650.98	1.28	650.98	1.10	
TEGH	บริษัท ไทยอีสเทิร์น กรุ๊ป โฮลดิ้ง จำกัด (มหาชน)					78.80	305.74	0.60	305.74	0.52	
TFG	บริษัท ไทยฟู้ดส์ กรุ๊ป จำกัด (มหาชน)					59.20	281.79	0.56	281.79	0.48	
การแพทย์							3,601.16	7.10	3,601.16	6.09	
MASTER	บริษัท มาสเตอร์ สโตร์ จำกัด (มหาชน)					20.80	1,622.40	3.20	1,622.40	2.74	
PR9	บริษัท โรงพยาบาลพระ รามเกล้า จำกัด (มหาชน)					56.90	1,086.79	2.14	1,086.79	1.84	
CHG	บริษัท โรงพยาบาลจุฬา รัตน์ จำกัด (มหาชน)					169.60	583.42	1.15	583.42	0.99	
LPH	บริษัท โรงพยาบาล ลาดพร้าว จำกัด (มหาชน)					56.10	308.55	0.61	308.55	0.52	
การท่องเที่ยวและสันทนาการ							2,138.51	4.22	2,138.51	3.62	
ERW	บริษัท ดี เอราวัณ กรุ๊ป จำกัด (มหาชน)					328.40	1,602.59	3.16	1,602.59	2.71	
SHR	บริษัท เอส ไฮเทล แอนด์ รีสอร์ท จำกัด (มหาชน)					154.00	535.92	1.06	535.92	0.91	
อื่น ๆ							1,278.88	2.52	1,278.88	2.15	
HL	บริษัท เฮลท์ลีด จำกัด (มหาชน)					45.60	848.16	1.67	848.16	1.43	
D	บริษัท เดนทัล คอร์ปอเร ชั่น จำกัด (มหาชน)					59.61	321.91	0.64	321.91	0.54	
FSMART	บริษัท ฟอรัท สมาร์ท เซอร์วิส จำกัด (มหาชน)					11.70	108.81	0.21	108.81	0.18	
บริการเฉพาะกิจ							2,635.25	5.20	2,635.25	4.45	
SISB	บริษัท เอสไอเอสบี จำกัด (มหาชน)					83.00	2,635.25	5.20	2,635.25	4.45	
พัฒนาอสังหาริมทรัพย์							7,288.31	14.38	7,288.31	12.34	
SIRI	บริษัท แอสสิริ จำกัด (มหาชน)					715.20	1,358.88	2.68	1,358.88	2.30	
AP	บริษัท เอพี (ไทยแลนด์) จำกัด (มหาชน)					106.10	1,305.03	2.57	1,305.03	2.21	
SC	บริษัท เอสซี แอสเสท คอร์ ปอเรชั่น จำกัด (มหาชน)					265.80	1,111.04	2.19	1,111.04	1.88	
SPALI	บริษัท ศุภาลัย จำกัด (มหาชน)					42.40	903.12	1.78	903.12	1.53	
ORI	บริษัท ออริจิ้น พร็อพเพอร์ตี้ จำกัด (มหาชน)					76.30	885.08	1.75	885.08	1.50	
PSH	บริษัท พฤกษา โฮลดิ้ง จำกัด (มหาชน)					49.50	613.80	1.21	613.80	1.04	
AMATA	บริษัท อมตะ คอร์ปอเร ชั่น จำกัด (มหาชน)					27.00	607.50	1.20	607.50	1.03	
AMATAV	บริษัท อมตะ วิเฮ็น จำกัด (มหาชน)					52.90	343.85	0.68	343.85	0.58	
WHA	บริษัท ดับบลิวเอชเอ คอร์ ปอเรชั่น จำกัด (มหาชน)					36.20	160.00	0.32	160.00	0.27	
แฟชั่น							1,274.52	2.51	1,274.52	2.16	
AURA	บริษัท ออโรรา ดีไซน์ จำกัด (มหาชน)					60.43	1,063.62	2.10	1,063.62	1.80	
SABINA	บริษัท ซาบีน่า จำกัด (มหาชน)					7.40	210.90	0.42	210.90	0.36	
ขนส่งและโลจิสติกส์							3,218.86	6.35	3,218.86	5.45	
PRM	บริษัท พรีเมา มารีน จำกัด (มหาชน)					187.00	1,093.95	2.16	1,093.95	1.85	

กองทุนเปิดธนาชาติ Small Medium Cap
รายงานการลงทุนในหลักทรัพย์และทรัพย์สินอื่น

ณ วันที่ 3 พฤษภาคม 2566

ชื่อหลักทรัพย์	อัตรา ดอกเบี้ย (%)	อันดับความน่าเชื่อถือ				วันครบ กำหนด	จำนวนหน่วย (พันหน่วย)/ มูลค่าหน้าตั๋ว (ล้านบาท)	มูลค่าตาม ราคาตลาดโดยรวม ดอกเบี้ยค้างรับ (ล้านบาท)	ร้อยละของ เงินลงทุน	มูลค่าตาม ราคาตลาดรวม ดอกเบี้ยค้างรับ (ล้านบาท)	ร้อยละของ มูลค่า ทรัพย์สิน สุทธิ
		TRIS	FITCH	S&P	Moody's						
NYT	บริษัท นามยง เทอร์มินัล จำกัด (มหาชน)					260.20	869.07	1.71	869.07	1.47	
BA	บริษัท การบินกรุงเทพ จำกัด (มหาชน)					39.70	547.86	1.08	547.86	0.93	
III	บริษัท ทริเพิล โอ โลจิสติกส์ จำกัด (มหาชน)					45.00	544.50	1.07	544.50	0.92	
PSL	บริษัท พรีเมียม ซีพีบี จำกัด (มหาชน)					13.40	163.48	0.32	163.48	0.28	
ยานยนต์							492.85	0.97	492.85	0.83	
IHL	บริษัท อินเตอร์ ไฮด์ จำกัด (มหาชน)					183.90	492.85	0.97	492.85	0.83	
ชิ้นส่วนอิเล็กทรอนิกส์							126.00	0.25	126.00	0.21	
NEX	บริษัท เน็กซ์ พอยท์ จำกัด (มหาชน)					12.00	126.00	0.25	126.00	0.21	
บริการรับเหมาก่อสร้าง							2,455.00	4.84	2,455.00	4.14	
SEAFCO	บริษัท ซีพีโก้ จำกัด (มหาชน)					284.20	994.70	1.96	994.70	1.68	
STEC	บริษัท ซีโน-ไทย เอ็นจิเนียริง แอนด์ คอนสตรัคชั่น จำกัด (มหาชน)					51.00	586.50	1.16	586.50	0.99	
CK	บริษัท ซี. การช่าง จำกัด (มหาชน)					24.10	510.92	1.01	510.92	0.86	
PYLON	บริษัท ไพลอน จำกัด (มหาชน)					94.50	362.88	0.72	362.88	0.61	
ที่มีได้จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย							53.68	0.11	53.68	0.09	
เทคโนโลยีสารสนเทศและการสื่อสาร							53.68	0.11	53.68	0.09	
GABLE	บริษัท จีเอเบิล จำกัด (มหาชน)					8.40	53.68	0.11	53.68	0.09	
ที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ใหม่							3,916.96	7.73	3,916.96	6.61	
อาหารและเครื่องดื่ม							628.09	1.24	628.09	1.06	
AU	บริษัท อาฟเตอร์ ยู จำกัด (มหาชน)					58.70	628.09	1.24	628.09	1.06	
อื่น ๆ							1,914.00	3.78	1,914.00	3.23	
SPA	บริษัท สยามเวลเนสกรุ๊ป จำกัด (มหาชน)					174.00	1,914.00	3.78	1,914.00	3.23	
สินค้าอุปโภคบริโภค							1,374.87	2.71	1,374.87	2.32	
IP	บริษัท อินเตอร์ ฟาร์มา จำกัด (มหาชน)					69.80	795.72	1.57	795.72	1.34	
WARRIX	บริษัท วอริกซ์ สปอร์ต จำกัด (มหาชน)					59.40	579.15	1.14	579.15	0.98	
เงินฝากธนาคาร									7,178.64	12.10	
ประเภทออมทรัพย์									7,178.64	12.10	
BAY - S/A	ธนาคารกรุงศรีอยุธยา จำกัด (มหาชน)					7,166.21			7,178.64	12.10	
ประเภทกระแสรายวัน									2.00	0.00	
BAY - C/A	ธนาคารกรุงศรีอยุธยา จำกัด (มหาชน)					2.00			2.00	0.00	
สินทรัพย์อื่นและหนี้สินอื่น									1,300.12	2.21	
สินทรัพย์อื่น									2,755.56	4.65	
หนี้สินอื่น									(1,455.44)	(2.44)	
							50,688.81	100.00	59,167.57	100.00	

หมายเหตุ * อันดับความน่าเชื่อถือ (Rating) ของผู้ออกตราสาร

อันดับความน่าเชื่อถือของตราสารหนี้ระยะกลางและระยะยาว

บ.ทริสเรตติ้ง	บ.พีทซ์เรตติ้ง (ประเทศไทย)	ความหมายของเรตติ้ง	
AAA	AAA (tha)	ความน่าเชื่อถือสูงสุด และมีความเสี่ยงต่ำสุด	กลุ่มตราสารหนี้ระดับนำลงทุน (Investment Grade Bonds)
AA	AA (tha)	ความน่าเชื่อถือสูงมาก และมีความเสี่ยงต่ำมาก	
A	A (tha)	ความน่าเชื่อถือสูง และมีความเสี่ยงต่ำ	
BBB	BBB (tha)	ความน่าเชื่อถืออยู่ในเกณฑ์พอใช้	
BB	BB (tha)	ความน่าเชื่อถือต่ำกว่าระดับปานกลาง	กลุ่มตราสารหนี้ระดับเก็งกำไร (Speculative Grade Bonds)
B	B (tha)	ความน่าเชื่อถืออยู่ในเกณฑ์ต่ำมาก	
C	CCC, CC, C (tha)	ความน่าเชื่อถืออยู่ในเกณฑ์ต่ำมากที่สุด และเริ่มมีความเสี่ยงต่อการผิดนัดชำระหนี้	
D	DDD, DD, D (tha)	อยู่ในภาวะที่ผิดนัดชำระหนี้	

หมายเหตุ : บ.ทริสเรตติ้ง และ บ.พีทซ์เรตติ้ง ได้ใช้สัญลักษณ์ บวก (+) และ ลบ (-) ต่อท้ายอันดับเครดิตข้างต้น เพื่อใช้ขยายขอบเขตของคุณภาพเครดิตที่นิยามเอาไว้มากกว่าเล็กน้อย (+) และ น้อยกว่าเล็กน้อย (-) ตามลำดับ สำหรับ พีทซ์เรตติ้ง เป็นสถาบันจัดอันดับเครดิตนานาชาติ จึงมีคำว่า (tha) ต่อท้ายเพื่อแสดงถึงการให้อันดับเครดิตตามมาตรฐานวัดภายในประเทศไทย

Description	Standard and Poor's		Moody's		FITCH Ratings	
	Long-term	Short-term	Long-term	Short-term	Long-term	Short-term
	Investment Grade					
Highest Credit Quality - exceptionally strong capacity for payment of financial commitments	AAA		Aaa		AAA	
Very strong capacity for payment of financial commitments - a minimal difference compared With AAA	AA+	A1+	Aa1	P1	AA+	F1+
	AA		Aa2		AA	
	AA-		Aa3		AA-	
Strong capacity for payment of financial commitments - it may, nevertheless, be vulnerable to changes in economic cycle or circumstances	A+	A1	P2	A+	F1	
	A	A2	P3	A	F2	
	A-	A3		A-	F3	
Adequate capacity for payment of financial commitments - economic cycle and circumstances are, nevertheless, more likely to impair this capacity	BBB+		Baa1		BBB+	
	BBB		Baa2		BBB	
	BBB-		Baa3		BBB-	
	Speculative Grade					
This group involves speculative elements – capacity for continued payment of commitments is contingent upon a sustained business and economic environment	BB+	B	Ba1	NP	BB+	B
	BB		Ba2		BB	
	BB-		Ba3		BB-	
	B+		B1		B+	
	B		B2		B	
High default risk - debtor's capacity for meeting commitments may be troublesome	CCC+	C	Caa1	NP	CCC+	C
	CCC	D	Caa2		CCC	D
	CCC-		Caa3		CCC-	
Highly speculative obligations	CC		CC		CC	
Very low probability of timely and full payment of obligations	C		C		C	
	Default in payment of obligations - D					

กองทุนเปิดธนาชาติ Small Medium Cap

งบแสดงฐานะการเงิน

ณ วันที่ 03 พฤษภาคม 2566 และวันที่ 03 พฤศจิกายน 2565

(หน่วย:บาท)

	03 พฤษภาคม 2566 (ยังไม่ได้สอบทาน)	03 พฤศจิกายน 2565 (ตรวจสอบแล้ว)
สินทรัพย์		
เงินลงทุนแสดงด้วยมูลค่ายุติธรรม	50,688,814.00	69,552,901.30
เงินฝากธนาคาร	7,168,211.44	6,187,614.61
ลูกหนี้		
จากเงินปันผลและดอกเบี๋ย	640,518.38	6,240.50
จากการขายเงินลงทุน	2,125,420.67	1,367,549.84
สินทรัพย์อื่น	47.94	218.08
รวมสินทรัพย์	60,623,012.43	77,114,524.33
หนี้สิน		
เจ้าหนี้		
จากการซื้อเงินลงทุน	1,303,829.86	2,880,588.44
จากการรับซื้อคืนหน่วยลงทุน	-	100,000.00
ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย	149,871.97	198,805.18
ภาษีเงินได้ค้างจ่าย	1,563.84	936.08
หนี้สินอื่น	175.59	6,012.04
รวมหนี้สิน	1,455,441.26	3,186,341.74
สินทรัพย์สุทธิ	59,167,571.17	73,928,182.59
สินทรัพย์สุทธิ		
ทุนที่ได้รับจากผู้ถือหน่วยลงทุน	41,599,786.23	47,290,381.74
กำไร(ขาดทุน)สะสม		
บัญชีปรับสมดุล	(12,100,077.83)	(9,150,242.56)
กำไร(ขาดทุน)สะสมจากการดำเนินงาน	29,667,862.77	35,788,043.41
รวมสินทรัพย์สุทธิ	59,167,571.17	73,928,182.59
สินทรัพย์สุทธิต่อหน่วย	14.2230	15.6328
จำนวนหน่วยลงทุนที่จำหน่ายแล้วทั้งหมด ณ สิ้นงวด (หน่วย)	4,159,978.6227	4,729,038.1735

กองทุนเปิดขนาด Small Medium Cap

งบกำไรขาดทุนเบ็ดเสร็จ

สำหรับรอบระยะเวลา 6 เดือน สิ้นสุดวันที่ 03 พฤษภาคม 2566 และ 2565

(หน่วย:บาท)

	03 พฤษภาคม 2566	03 พฤษภาคม 2565
	ยังไม่ได้สอบทาน	ยังไม่ได้สอบทาน
รายได้		
รายได้เงินปันผล	943,163.13	737,177.80
รายได้ดอกเบี้ย	13,652.10	5,527.77
รวม รายได้	<u>956,815.23</u>	<u>742,705.57</u>
ค่าใช้จ่าย		
ค่าธรรมเนียมการจัดการ	692,444.44	811,785.33
ค่าธรรมเนียมดูแลผลประโยชน์	7,790.03	9,132.55
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน	43,277.84	50,736.60
ค่าธรรมเนียมวิชาชีพ	20,735.44	20,735.44
ค่าใช้จ่ายในการขายและรับซื้อคืนหน่วยลงทุน	-	1,375.00
ค่าใช้จ่ายในการดำเนินงาน	720.14	12,899.08
รวม ค่าใช้จ่าย	<u>764,967.89</u>	<u>906,664.00</u>
รายได้(ขาดทุน)สุทธิ	<u>191,847.34</u>	<u>(163,958.43)</u>
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิจากเงินลงทุน		
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิจากเงินลงทุน	(1,830,701.67)	7,919,961.27
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิที่ยังไม่เกิดขึ้นจากเงินลงทุน	(4,479,278.50)	(3,934,825.44)
รวม รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิจากเงินลงทุนที่เกิดขึ้นและยังไม่เกิดขึ้น	<u>(6,309,980.17)</u>	<u>3,985,135.83</u>
การเพิ่มขึ้น(ลดลง)ในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงานก่อนภาษีเงินได้	(6,118,132.83)	3,821,177.40
หัก ภาษีเงินได้	<u>(2,047.81)</u>	<u>(829.17)</u>
การเพิ่มขึ้น(ลดลง)ในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงานหลังหักภาษีเงินได้	<u>(6,120,180.64)</u>	<u>3,820,348.23</u>