

รายงานสถานะการลงทุน

รอบระยะเวลาบัญชี 6 เดือน

กองทุนเปิดซีไอเอ็มบี-พริ้นซิเพิล เดลี ตราสารรัฐระยะสั้น

ตั้งแต่วันที่ 1 มิถุนายน 2561 – 30 พฤศจิกายน 2561

เรียน ท่านผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุนทุกท่าน

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนซีไอเอ็มบี-พริ้นซิเพิล จำกัด ขอนำเสนอรายงานประจำรอบระยะเวลา 6 เดือน งวดวันที่ 1 มิถุนายน 2561 ถึง 30 พฤศจิกายน 2561 ของกองทุนเปิดซีไอเอ็มบี-พริ้นซิเพิล เดลี่ คราสาหรับระยะสั้น มายังผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุนทุกท่าน

สรุปภาพรวมภาวะเศรษฐกิจ

ภาพรวมเศรษฐกิจโลกโดยรวมยังคงขยายตัวได้สำหรับกลุ่มประเทศ Developed Market อย่างสหรัฐอเมริกา สหภาพยุโรป และญี่ปุ่น ขณะที่กลุ่มประเทศ Emerging Market เริ่มได้รับผลกระทบจากสงครามการค้ามากขึ้นในด้านของการส่งออกที่ชะลอตัวค่อนข้างชัดเจนทั้งภูมิภาค

ประเทศไทยภาคก็ได้รับผลกระทบเช่นกัน โดยชะลอตัวลงทั้งภาคการส่งออกจากประเด็นสงครามการค้า และภาคการท่องเที่ยวที่ชะลอตัวจากนักท่องเที่ยวจีนยังลดลงต่อเนื่อง แม้จะได้แรงส่งจากการลงทุนภาคเอกชนที่ขยายตัวอย่างต่อเนื่อง แต่เศรษฐกิจไทยไตรมาส 3 ก็โดนจุดให้โตเพียง 3.3% ต่ำกว่าที่ตลาดคาด และต่ำกว่าไตรมาส 2 ค่อนข้างมาก เนื่องจากประเทศไทยพึ่งพาการส่งออกค่อนข้างมาก

อย่างไรก็ตามในภาพรวมคาดว่าเศรษฐกิจไทยในไตรมาสสุดท้ายของปีนี้ยังมีโอกาสขยายตัวได้ ทำให้เศรษฐกิจไทยครึ่งปีหลังโตในกรอบ 4.0-4.3% ส่งผลให้ทั้งปียังมีโอกาสโตถึง 4% จากแรงหนุนการขยายตัวของการบิน โภคและการลงทุนภาคเอกชนที่ยังมีทิศทางเติบโตได้โดยเฉพาะภาคการผลิต ทั้งนี้ รายได้ทั้งภาคการเกษตรชะลอตัวชั่วคราวจากปัจจัยฤดูกาลที่ทำให้ปริมาณสินค้าเกษตรล้นตลาดและกดดันให้ราคาสินค้าเกษตรปรับตัวลดลง ขณะที่รายได้นอกภาคการเกษตรปรับตัวดีขึ้นต่อเนื่อง ในส่วนของการบริโภคและการลงทุนของภาครัฐด้านโครงการต่าง ๆ ยังคงขยายตัวแบบค่อยเป็นค่อยไป เนื่องจากการเบิกจ่ายที่ล่าช้ากว่าแผนการ อย่างไรก็ตามการส่งออกยังคงมีแนวโน้มชะลอตัวมากขึ้นจากประเด็นสงครามการค้า ขณะที่การท่องเที่ยวจะยังคงโดนกดดันจากการชะลอตัวของนักท่องเที่ยวจีน แม้ว่าจะมีจำนวนนักท่องเที่ยวจากชาติอื่นที่เข้ามาเที่ยวไทยชดเชยก็ตาม แต่ในแง่ของการมูลค่าการใช้จ่ายต่อหัวยังน้อยกว่าเมื่อเทียบกับนักท่องเที่ยวจีน

สำหรับอัตราเงินเฟ้อในเดือนตุลาคมที่ผ่านมาขยายตัวที่ 1.23%YoY ชะลอตัวลงจากเดือนกันยายนที่ 1.33%YoY และต่ำกว่าที่ตลาดคาดเล็กน้อย โดยถูกจุดจากราคาอาหารสดที่ปรับตัวลงค่อนข้างมาก แต่ยังได้แรงหนุนจากราคาน้ำมันที่ยังทรงตัวในระดับสูงและคาดว่าราคาน้ำมันจะเป็นปัจจัยหลักที่จะผลักดันให้เงินเฟ้อไทยขยายตัวได้เกิน 1% ในปีนี้

อย่างไรก็ตาม ยังมีความเสี่ยงด้านภูมิรัฐศาสตร์ (Geopolitical risk) ที่ยังคงติดตามอย่างต่อเนื่อง ได้แก่ สงครามการค้าที่คู่มือทำที่รุนแรงขึ้นและอาจขยายวงกว้าง ความเสี่ยงในกลุ่มประเทศ EM ที่มีปัจจัยพื้นฐานเศรษฐกิจเปราะบางอย่างอาร์เจนตินา ตุรกี เวเนซุเอลา อิตาลี เป็นต้น ซึ่งความเสี่ยงเหล่านี้นอกจากจะสร้างความผันผวนต่อการลงทุนแล้ว ยังส่งผลต่อเศรษฐกิจทั่วโลกในระยะต่อไปอีกด้วย

ภาวะตลาดเงินและตลาดตราสารหนี้

ด้านนโยบายการเงิน ธนาคารกลางสหรัฐฯ ยังคงส่งสัญญาณ Hawkish ในการดำเนินนโยบายการเงิน โดยล่าสุดได้ปรับอัตราดอกเบี้ยเพิ่มขึ้นอีก 0.25% สู่ระดับ 2.00 - 2.25% และพร้อมที่จะดำเนินตามแผนด้วยการปรับขึ้นดอกเบี้ยอีก 1 ครั้งในช่วงสิ้นปี 2561 ขณะที่ทางด้านธนาคารกลางยุโรปแม้จะไม่ได้ส่งสัญญาณที่ Hawkish มาก แต่ค่อนข้างแน่นอนที่จะหยุดการทำ Quantitative Easing ช่วงสิ้นปี 2561 และส่งสัญญาณการปรับขึ้นดอกเบี้ยอย่างรวดเร็วสุดในช่วงปลายปี 2562 ขณะที่ธนาคารกลางญี่ปุ่นยืนยันที่จะดำเนินนโยบายผ่อนคลายทางการเงินต่อไปอย่างน้อยจนถึงปี 2563

สำหรับธนาคารแห่งประเทศไทยล่าสุดยังคงคงอัตราดอกเบี้ยนโยบายอยู่ที่ 1.5% ต่อปี แต่เริ่มมีท่าที Hawkish ชัดเจนมากขึ้น จากผลการโหวดที่ 5:2 เสียง โดยกรรมการที่โหวดให้ปรับขึ้นอัตราดอกเบี้ยมีความกังวลต่อสภาพแวดล้อมดอกเบี้ยต่ำที่นานเกินไปจะสร้างช่องโหว่ให้เกิดความเสี่ยงต่อระบบการเงินและเศรษฐกิจได้ ทั้งนี้ยังต้องติดตามจากตัวเลขเศรษฐกิจในระยะต่อไป ซึ่งตลาดเองก็ได้รับรู้ถึงโอกาสที่ธนาคารแห่งประเทศไทยมีแนวโน้มจะปรับอัตราดอกเบี้ยนโยบายขึ้นอย่างน้อย 1 ครั้งในช่วงสิ้นปี 2561 ถึงช่วงไตรมาส 1 ปี 2562

ภาวะตลาดตราสารหนี้ในช่วงหนึ่งปีที่ผ่านมามีความผันผวนสูง โดยในช่วงตั้งแต่กลางปี 2560 ถึงต้นปี 2561 แนวโน้มเส้นอัตราผลตอบแทนมีทิศทางปรับตัวลดลง จนกระทั่งช่วงมีนาคม 2561 ที่โดนัลด์ ทรัมป์ เปิดฉากสงครามการค้ากับสหภาพยุโรป แคนาดา และเกาหลี ตลาดการเงินก็เริ่มกลับทิศทางและเริ่มปรับตัวสูงขึ้นจากความกังวลดังกล่าวซึ่งอาจส่งผลกระทบต่อเศรษฐกิจทั่วโลก โดยอัตราผลตอบแทนพันธบัตรระยะกลางและระยะยาวของไทยเคลื่อนไหวตามทิศทางของอัตราผลตอบแทน US Treasury ที่ทยอยปรับตัวสูงขึ้นตั้งแต่ต้นปี 2561 ขณะที่อัตราผลตอบแทนพันธบัตรระยะสั้นได้รับแรงหนุนจากนักลงทุนต่างชาติที่ก่อนหน้านี้ไหลเข้ามาจำนวนมาก รวมถึงเงินทุนที่เริ่มไหลออกจาก Emerging Markets อีกทั้งตลาดเริ่ม priced-in การขึ้นดอกเบี้ยนโยบายของกนง. ส่งผลให้อัตราผลตอบแทนพันธบัตรระยะสั้นทยอยปรับตัวขึ้นมาเทียบเท่าอัตราดอกเบี้ยนโยบายระดับปัจจุบันที่ 1.5%

การลงทุนของกองทุน

กองทุนเน้นการลงทุนในตราสารภาครัฐ พันธบัตรรัฐบาล และพันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย เพื่อเน้นให้ได้รับอัตราผลตอบแทนในจำนวนเงินที่ค่อนข้างแน่นอนและมีสภาพคล่องสูง

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

ขอแสดงความนับถือ

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ซีไอเอ็มบี-พริ้นซิเพิล จำกัด



ความเห็นผู้ดูแลผลประโยชน์

12 ธันวาคม 2561

เรียน ผู้ถือหน่วยลงทุน กองทุนเปิดซีไอเอ็มบี-พริ้นซิเพิล เดลี ตราสารรัฐระยะสั้น


ตามที่ ธนาคารธนชาติ จำกัด (มหาชน) ในฐานะผู้รับดูแลผลประโยชน์ของกองทุนเปิดซีไอเอ็มบี-พริ้นซิเพิล เดลี ตราสารรัฐระยะสั้น อันมีบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ซีไอเอ็มบี-พริ้นซิเพิล จำกัด เป็นผู้จัดตั้งและจัดการกองทุน สำหรับระยะเวลาตั้งแต่วันที่ 1 มิถุนายน 2561 ถึง วันที่ 30 พฤศจิกายน 2561 แล้วนั้น

ธนาคาร เห็นว่าบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ซีไอเอ็มบี-พริ้นซิเพิล จำกัด ได้ปฏิบัติหน้าที่ในการจัดการกองทุนเปิด ซีไอเอ็มบี-พริ้นซิเพิล เดลี ตราสารรัฐระยะสั้น เหมาะสมตามสมควรแห่งวัตถุประสงค์ที่ได้กำหนดไว้ในโครงการที่ได้รับอนุมัติจากสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ภายใต้พระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535

ผู้ดูแลผลประโยชน์
ธนาคารธนชาติ จำกัด (มหาชน)



นางอรุมา ฉายยะ
ผู้มีอำนาจลงนาม
กลุ่มบริการธุรกิจหลักทรัพย์และผู้ดูแลผลประโยชน์

ธนาคารธนชาติ จำกัด (มหาชน)
ส่วนผู้ดูแลผลประโยชน์ 
โทรศัพท์ 02-208-5012, 02-208-5000 ต่อ 4500-2 โทรสาร 02-651-7808

ฉบับท. 0266/2561-014

ธนาคารธนชาติ จำกัด (มหาชน)
Thanachart Bank Public Company Limited

444 อาคารเอ็มบีเค ทาวเวอร์ ถนนพญาไท แขวงวังใหม่ เขตปทุมวัน กรุงเทพมหานคร 10330
444 MBK Tower, Phayathai Road, Wangmai, Pathumwan, Bangkok 10330 THAILAND
Tel. (662) 217-8000 Fax: (662) 217-8333 www.thanachartbank.co.th ทะเบียนเลขที่ 0107536001401

Fund Name: **CIMB-P TREASURY**
 Balance Date: **ต. 30 พ.ย. 2018**
 Inception: **อ. 23 มิ.ย. 2009**

ผลการดำเนินงาน ณ วันที่ 30 พฤศจิกายน 2561
 มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ (บาท) 724,040,151.89
 มูลค่าหน่วยลงทุน (บาท) 11.5558

ผลตอบแทนย้อนหลัง	ผลตอบแทนของ กองทุน	เกณฑ์ มาตรฐาน*	ค่าเบี่ยงเบน มาตรฐาน	Information Ratio
3 เดือน	0.23%	0.36%	0.04%	-11.21
6 เดือน	0.47%	0.71%	0.04%	-10.34
1 ปี ¹	0.84%	1.25%	0.04%	-10.17
3 ปี ¹	0.92%	1.22%	0.05%	-10.40
5 ปี ¹	1.19%	1.44%	0.06%	-1.12
10 ปี ¹	n/a	n/a	n/a	n/a
YTD	0.76%	1.15%	0.04%	-10.25
ตั้งแต่จัดตั้งกองทุน ²	1.54%	1.60%	0.09%	-0.35

¹ % ต่อปี (Annualized Return)

² % ต่อปี (Annualized Return) หากกองทุนจัดตั้งมาแล้ว 1 ปีขึ้นไป

*เกณฑ์มาตรฐานที่ใช้ปัจจุบัน STGovBond Index 100.00%

**เกณฑ์มาตรฐานที่ใช้ในอดีต

ตั้งแต่ 23 มิถุนายน 2552 ถึง 29 กันยายน 2561 ใช้เกณฑ์มาตรฐาน ZRR3M Index 50.00% + Avg3MFixed 50.00%

กองทุนเปิดซีไอเอ็มบี-พริ้นซิเพิล เดลต้า ตราสารรัฐระยะสั้น

งบดุล

ณ วันที่ 30 พฤศจิกายน 2561

	หมายเหตุ	บาท	
		2561	2560
สินทรัพย์			
เงินลงทุนตามมูลค่ายุติธรรม	2	697,570,325.62	1,023,934,717.13
(ราคาทุน ปี 2561 : 697,470,926.81 บาท			
ปี 2560 : 1,023,963,001.24 บาท)			
เงินฝากธนาคาร		23,947,585.98	27,906,929.02
ลูกหนี้			
จากดอกเบี้ย		62,485.79	28,402.35
จากการขายเงินลงทุน		2,980,545.00	19,996,055.60
รวมสินทรัพย์		<u>724,560,942.39</u>	<u>1,071,866,104.10</u>
หนี้สิน			
เจ้าหนี้จากการรับซื้อคืนหน่วยลงทุน		212,173.60	1,185,250.00
ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย		299,969.92	482,453.11
หนี้สินอื่น		<u>8,646.98</u>	<u>12,418.08</u>
รวมหนี้สิน		<u>520,790.50</u>	<u>1,680,121.19</u>
สินทรัพย์สุทธิ		<u>724,040,151.89</u>	<u>1,070,185,982.91</u>
สินทรัพย์สุทธิ :			
ทุนที่ได้รับจากผู้ถือหน่วยลงทุน		<u>626,559,646.57</u>	<u>933,936,704.26</u>
กำไร (ขาดทุน) สะสม			
บัญชีปรับสมดุล		(109,543,102.08)	(63,076,040.24)
กำไรสะสมจากการดำเนินงาน		<u>207,023,607.40</u>	<u>199,325,318.89</u>
สินทรัพย์สุทธิ		<u>724,040,151.89</u>	<u>1,070,185,982.91</u>
สินทรัพย์สุทธิต่อหน่วย		11.5558	11.4588
(จำนวนหน่วยลงทุนที่จำหน่ายแล้วทั้งหมด ณ วันสิ้นงวด (หน่วย)		62,655,964.7097	93,393,670.4821

หมายเหตุประกอบงบการเงินเป็นส่วนหนึ่งของงบการเงินนี้

กองทุนเปิดซีไอเอ็มบี-พริ้นซิเพิล เดลต้า ตราสารรัฐระยะสั้น

งบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน

ณ วันที่ 30 พฤศจิกายน 2561

การแสดงรายละเอียดเงินลงทุนใช้การจัดกลุ่มตามประเภทของเงินลงทุน

ชื่อหลักทรัพย์	วันครบกำหนด	อัตราดอกเบี้ย (%)	จำนวนหน่วย/เงินต้น (หน่วย / บาท)	มูลค่ายุติธรรม (บาท)	ร้อยละของมูลค่าเงินลงทุน
เงินลงทุนในประเทศ					
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย ระยะสั้น อายุไม่เกิน 1 ปี					
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 38/91/61	20/12/2561		26,000.00	25,983,025.64	3.73
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 39/91/61	27/12/2561		74,800.00	74,726,542.66	10.71
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 27/182/61	03/01/2562		25,200.00	25,168,143.42	3.61
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 28/182/61	10/01/2562		21,700.00	21,663,439.19	3.11
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 41/91/61	10/01/2562		31,300.00	31,247,264.82	4.48
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 29/182/61	17/01/2562		25,200.00	25,150,126.93	3.61
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 42/91/61	17/01/2562		3,000.00	2,994,620.76	0.43
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 30/182/61	24/01/2562		97,200.00	96,994,215.94	13.91
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 43/91/61	24/01/2562		11,200.00	11,174,045.57	1.60
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 31/182/61	31/01/2562		26,800.00	26,734,098.53	3.83
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 44/91/61	31/01/2562		73,000.00	72,820,492.27	10.44
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 32/182/61	07/02/2562		16,900.00	16,855,096.19	2.42
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 45/91/61	07/02/2562		18,100.00	18,051,572.36	2.59
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 33/182/61	14/02/2562		16,900.00	16,850,832.49	2.42
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 46/91/61	14/02/2562		11,300.00	11,267,240.17	1.62
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 34/182/61	21/02/2562		13,000.00	12,959,821.03	1.86
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 47/91/61	21/02/2562		58,600.00	58,423,792.14	8.38
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 35/182/61	28/02/2562		16,800.00	16,740,805.54	2.40
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 48/91/61	28/02/2562		13,000.00	12,956,245.12	1.86
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 36/182/61	07/03/2562		8,600.00	8,567,040.16	1.23
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 39/182/61	28/03/2562		16,100.00	16,026,025.65	2.30
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 40/182/61	04/04/2562		14,000.00	13,928,832.54	2.00
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 42/182/61	18/04/2562		15,900.00	15,813,308.43	2.27
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 43/182/61	25/04/2562		31,600.00	31,408,490.10	4.50
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 45/182/61	09/05/2562		14,200.00	11,126,448.82	1.60
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 47/182/61	23/05/2562		7,400.00	7,347,414.64	1.05
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 48/182/61	30/05/2562		14,700.00	14,591,344.51	2.09
รวม พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย ระยะสั้น อายุไม่เกิน 1 ปี				697,570,325.62	100.00
รวมเงินลงทุนในประเทศ				697,570,325.62	100.00
ยอดรวมเงินลงทุน (ราคาทุน 697,470,926.81 บาท)				697,570,325.62	100.00

กองทุนเปิดซีไอเอ็มบี-พริ้นซิเพิล เดลี ตราสารรัฐระยะสั้น

งบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน

ณ วันที่ 30 พฤศจิกายน 2560

การแสดงรายละเอียดเงินลงทุน ใช้การจัดกลุ่มตามประเภทของเงินลงทุน

ชื่อหลักทรัพย์	วันครบกำหนด	อัตราดอกเบี้ย (%)	จำนวนหน่วย/เงินต้น (หน่วย / บาท)	มูลค่ายุติธรรม (บาท)	ร้อยละของมูลค่าเงินลงทุน
เงินลงทุนในประเทศ					
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย ระยะสั้น อายุไม่เกิน 1 ปี					
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 5/364/59	07/12/2560		181,000.00	160,967,523.08	15.72
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 23/182/60	07/12/2560		500.00	499,897.69	0.05
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 36/91/60	07/12/2560		10,000.00	9,998,208.50	0.98
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 24/182/60	14/12/2560		128,400.00	128,346,059.16	12.54
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 37/91/60	14/12/2560		7,800.00	7,796,623.77	0.76
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 38/91/60	21/12/2560		277,800.00	277,647,846.16	27.12
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 26/182/60	28/12/2560		10,100.00	10,090,991.51	0.99
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 40/91/60	04/01/2561		43,900.00	43,848,942.98	4.28
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 41/91/60	11/01/2561		36,300.00	36,249,915.44	3.54
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 29/182/60	18/01/2561		16,100.00	16,076,215.95	1.57
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 30/182/60	25/01/2561		6,600.00	6,588,102.64	0.64
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 31/182/60	01/02/2561		18,900.00	18,866,670.61	1.84
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 44/91/60	01/02/2561		7,400.00	7,387,013.00	0.72
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 36/182/60	08/03/2561		25,600.00	25,516,592.13	2.49
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 1/364/60	15/03/2561		20,000.00	19,928,737.00	1.95
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 38/182/60	22/03/2561		800.00	796,970.42	0.08
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 39/182/60	29/03/2561		25,000.00	24,897,775.75	2.43
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 40/182/60	05/04/2561		28,600.00	28,474,691.96	2.78
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 41/182/60	12/04/2561		24,200.00	24,086,325.82	2.35
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 42/182/60	19/04/2561		23,600.00	23,480,771.15	2.29
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 43/181/60	26/04/2561		22,800.00	22,676,639.00	2.22
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 44/182/60	03/05/2561		17,400.00	17,301,565.24	1.69
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 45/182/60	10/05/2561		85,100.00	84,592,272.98	8.26
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 46/182/60	17/05/2561		21,000.00	20,864,443.95	2.04
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 47/182/60	24/05/2561		7,000.00	6,953,921.24	0.68
รวม พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย ระยะสั้น อายุไม่เกิน 1 ปี				1,023,934,717.13	100.00
รวมเงินลงทุนในประเทศ				1,023,934,717.13	100.00
ยอดรวมเงินลงทุน (ราคาทุน 1,023,963,001.24 บาท)				1,023,934,717.13	100.00

กองทุนเปิดซีไอเอ็มบี-พริ้นซิเพิล เคสึ่ ตราสารรัฐระยะสั้น
งบกำไรขาดทุน
สำหรับงวดหกเดือน สิ้นสุดวันที่ 30 พฤศจิกายน 2561

	บาท	
	2561	2560
รายได้จากการลงทุน		
รายได้ดอกเบี้ย	5,458,325.34	7,910,969.50
รวมรายได้	5,458,325.34	7,910,969.50
ค่าใช้จ่าย		
ค่าธรรมเนียมการจัดการ	1,330,287.44	2,031,547.11
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์	104,205.87	159,137.92
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียนหน่วยลงทุน	310,400.37	474,027.61
ค่าธรรมเนียมวิชาชีพ	30,082.84	31,784.16
ค่าใช้จ่ายอื่น	54,565.18	86,716.72
รวมค่าใช้จ่าย	1,829,541.70	2,783,213.52
รายได้จากการลงทุนสุทธิ	3,628,783.64	5,127,755.98
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิจากเงินลงทุน		
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิที่เกิดขึ้นจากเงินลงทุน	8,219.21	146,148.50
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิที่ยังไม่เกิดขึ้นจากเงินลงทุน	93,248.19	(70,999.85)
รวมรายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิจากเงินลงทุนที่เกิดขึ้นและที่ยังไม่เกิดขึ้น	101,467.40	75,148.65
การเพิ่มขึ้นในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงาน	3,730,251.04	5,202,904.63

หมายเหตุประกอบงบการเงินเป็นส่วนหนึ่งของงบการเงินนี้

กองทุนเปิดซีไอเอ็มบี-พริ้นซิเพิล เคลี ตราสารรัฐระยะสั้น
หมายเหตุประกอบงบการเงิน
สำหรับงวดหกเดือน สิ้นสุดวันที่ 30 พฤศจิกายน 2561

1. ลักษณะของกองทุนเปิดซีไอเอ็มบี-พริ้นซิเพิล เคลี ตราสารรัฐระยะสั้น

กองทุนเปิดซีไอเอ็มบี-พริ้นซิเพิล เคลี ตราสารรัฐระยะสั้น (“กองทุน”) จัดทะเบียนเป็นกองทุนร่วมกับสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ (ก.ล.ต.) เมื่อวันที่ 23 มิถุนายน 2552 ปัจจุบันมีจำนวนเงินลงทุนจดทะเบียน 10,000 ล้านบาท (แบ่งเป็น 1,000 ล้านหน่วย มูลค่าหน่วยลงทุนละ 10 บาท) บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนซีไอเอ็มบี-พริ้นซิเพิล จำกัด (“บริษัทจัดการ”) เป็นผู้จัดการกองทุนและนายทะเบียนหน่วยลงทุน โดยมีธนาคารธนชาต จำกัด (มหาชน) เป็นผู้ดูแลผลประโยชน์ของกองทุน

กองทุนเป็นกองทุนประเภทรับซื้อคืนหน่วยลงทุน ซึ่งไม่มีกำหนดระยะเวลาสิ้นสุดของโครงการ โดยมีนโยบายที่จะลงทุนในตราสารหนี้

กองทุนมีนโยบายที่จะไม่จ่ายเงินปันผลให้แก่ผู้ถือหน่วยลงทุน

นโยบายการลงทุน

กองทุนมีนโยบายการลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งตราสารภาครัฐ ตัวเงินคลัง พันธบัตรรัฐบาล พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย หรือพันธบัตรหรือตราสารหนี้ที่กองทุนฟื้นฟูและพัฒนาระบบสถาบันการเงินเป็นผู้ออก ผู้รับรอง ผู้รับอวัล หรือผู้ค้ำประกัน หรือพันธบัตรหรือตราสารแห่งหนึ่งที่กระทรวงการคลังเป็นผู้ออก ผู้รับรอง ผู้รับอวัล หรือผู้ค้ำประกัน และอาจลงทุนในหลักทรัพย์หรือตราสารภาครัฐ และ/หรือตราสารแห่งอื่นใดที่รัฐบาลต่างประเทศเป็นผู้ออก ผู้รับรอง ผู้รับอวัล หรือผู้ค้ำประกัน ที่ได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถืออยู่ในอันดับที่สามารถลงทุนได้ (investment grade) โดยสถาบันการจัดอันดับความน่าเชื่อถือที่ได้รับการยอมรับจากสำนักงาน เพื่อเป็นทรัพย์สินของกองทุนรวม มีมูลค่ารวมกันทั้งสิ้นโดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน

ส่วนที่เหลือจะพิจารณาการลงทุนในเงินฝาก ตัวสัญญาใช้เงิน หรือบัตรเงินฝากที่ออกโดยสถาบันการเงินหรือธนาคารที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้น หรือหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินอื่นหรือการขาดอกผลโดยวิธีอื่นตามที่สำนักงานคณะกรรมการก.ล.ต. อนุญาตหรือเห็นชอบให้กองทุนลงทุนได้

ทั้งนี้ กองทุนจะลงทุนในเงินฝาก ตราสารหนี้ ธุรกิจทางการเงิน หรือตราสารทางการเงินอื่นใดที่มีกำหนดชำระคืนเมื่อทวงถาม หรืออายุของสัญญา หรือจะครบกำหนดชำระคืนไม่เกิน 1 ปี นับแต่วันที่ลงทุน หรือเข้าทำสัญญานั้นภายใต้หลักเกณฑ์ที่สำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ต. กำหนด

กองทุนอาจเข้าทำสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) โดยมีวัตถุประสงค์เพื่อลดความเสี่ยง (Hedging) และจะไม่ลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งตราสารหนี้ที่มีลักษณะของสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแปง (structured note) และสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) เพื่อแสวงหาผลประโยชน์ตอบแทน

กองทุนเปิดซีไอเอ็มบี-พรินซิเพิล เคสึ ตราสารรัฐระยะสั้น
หมายเหตุประกอบงบการเงิน (ต่อ)
สำหรับงวดหกเดือน สิ้นสุดวันที่ 30 พฤศจิกายน 2561

2. สรุปนโยบายการบัญชีที่สำคัญ

การวัดค่าเงินลงทุน

เงินลงทุนจะรับรู้เป็นสินทรัพย์ด้วยจำนวนต้นทุนของเงินลงทุน ณ วันที่กองทุนมีสิทธิในเงินลงทุน ต้นทุนของเงินลงทุนประกอบด้วยรายจ่ายซื้อเงินลงทุนและค่าใช้จ่ายโดยตรงทั้งสิ้นที่กองทุนจ่ายเพื่อให้ได้มาซึ่งเงินลงทุนนั้น

หลักทรัพย์ที่เป็นตราสารหนี้ที่มีอายุไม่เกิน 90 วัน ประเภทมีดอกเบี้ย บริษัทจัดการจะคำนวณโดยใช้มูลค่าเงินต้นบวกดอกเบี้ยค้างรับจนถึงวันคำนวณมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุนรวม กรณีเป็นตราสารประเภทมีส่วนลด ให้ใช้ราคาทุนตัดจำหน่าย (Amortized Cost) เป็นมูลค่าเงินต้น โดยวิธีการตัดจำหน่ายให้ใช้วิธีอัตราดอกเบี้ยที่แท้จริงหรือวิธีอื่นที่ให้ผล ไม่ต่างจากวิธีอัตราดอกเบี้ยที่แท้จริงอย่างมีนัยสำคัญ

กำไรหรือขาดทุนสุทธิที่ยังไม่เกิดขึ้นจากการปรับมูลค่าของเงินลงทุนให้เป็นมูลค่ายุติธรรมจะรับรู้ในงบกำไรขาดทุน ณ วันที่วัดค่าเงินลงทุน

ราคาทุนของเงินลงทุนที่จำหน่ายใช้วิธีถัวเฉลี่ยถ่วงน้ำหนัก

การรับรู้รายได้และรายจ่าย

ดอกเบี้ยรับรู้เป็นรายได้ตามระยะเวลาที่พึงรับ

เงินปันผลรับรู้เป็นรายได้นับแต่วันที่มีสิทธิจะได้รับ

ค่าใช้จ่ายรับรู้ตามเกณฑ์คงค้าง

บัญชีส่วนเกินและส่วนลดมูลค่าของตราสารหนี้ตัดจำหน่ายตามวิธีอัตราดอกเบี้ยที่แท้จริง ซึ่งยอดที่ตัดจำหน่ายนี้แสดงเป็นรายการปรับปรุงกับดอกเบี้ยรับ

กำไร (ขาดทุน) จากการค้าหลักทรัพย์รับรู้เป็นรายได้หรือค่าใช้จ่าย ณ วันที่จำหน่ายเงินลงทุน

ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนเปิดซีไอเอ็มบี-พริ้นซิเพิล เดลี ตราสารรัฐระยะสั้น
สำหรับงวดหกเดือน สิ้นสุดวันที่ 30 พฤศจิกายน 2561

ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุน * (Fund's Direct Expenses)	จำนวนเงิน (ล้านบาท)	% ของมูลค่า ทรัพย์สินสุทธิ
ค่าธรรมเนียมจัดการกองทุน (Management Fee)	1,330.28	0.105
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ (Trustee Fee)	104.21	0.008
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียนหน่วยลงทุน (Registrar Fee)	310.40	0.025
ค่าที่ปรึกษาการลงทุน (Advisory Fee)	ไม่มี	ไม่มี
ค่าสอบบัญชี	30.08	0.002
ค่าวารสารและสิ่งพิมพ์	43.92	0.003
ค่าใช้จ่ายอื่นๆ	10.65	0.001
ค่าโฆษณา ประชาสัมพันธ์และส่งเสริมการขาย		
ในช่วงเสนอขายหน่วยลงทุนครั้งแรก		
ภายหลังเสนอขายหน่วยลงทุนครั้งแรก	-	-
รวมค่าใช้จ่ายทั้งหมด **	1,829.54	0.144

หมายเหตุ * ค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายต่างๆ ได้รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดในทำนองเดียวกัน (ถ้ามี) ไว้แล้ว

**ไม่รวมค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์และค่าธรรมเนียมต่าง ๆ ที่เกิดขึ้นจากการซื้อขายหลักทรัพย์

กองทุนเปิดซีไอเอ็มบี-พริ้นซิเพิล เดลี ตราสารรัฐระยะสั้น
ข้อมูลอัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุนของกองทุนรวม
สำหรับงวดหกเดือน สิ้นสุดวันที่ 30 พฤศจิกายน 2561

	(ร้อยละ)
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุนของกองทุนรวม	117.00

1. รายชื่อบุคคลที่เกี่ยวข้องที่มีการทำธุรกรรมกับกองทุนรวม

รายชื่อบุคคลที่เกี่ยวข้องที่มีการทำธุรกรรมกับกองทุนรวม กองทุนเปิดซีไอเอ็มบี-พริ้นซิเพิล เดลี่ ตราสารรัฐระยะสั้น ตั้งแต่วันที่ 1 มิถุนายน 2561 ถึงวันที่ 30 พฤศจิกายน 2561
-ไม่มี-
หมายเหตุ : ผู้ลงทุนสามารถตรวจสอบการทำธุรกรรมกับบุคคลที่เกี่ยวข้องกับกองทุนรวมได้ที่ บริษัทจัดการโดยตรง 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. คำนำหน้าทั้งหมดจากการที่บริษัทสั่งซื้อขายหลักทรัพย์

- ไม่มี - (กองทุนตราสารหนี้)

4. รายละเอียดการลงทุน การกู้ยืมเงิน และการก่อภาระผูกพัน

รายละเอียดการลงทุน การกู้ยืมเงิน และการก่อภาระผูกพัน

ณ วันที่ 30 พฤศจิกายน 2561

รายละเอียดการลงทุน

กองทุนเปิดซีไอเอ็มบี-พริ้นซิเพิล เดลี่ ตราสารรัฐระยะสั้น

	มูลค่าตามราคาตลาด (บาท)	% NAV
หลักทรัพย์หรือทรัพย์สินในประเทศ		
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย อายุคงเหลือน้อยกว่า 1 ปี	697,570,325.62	96.34
เงินฝากธนาคาร	24,010,071.77	3.32
อื่น ๆ		
ทรัพย์สินอื่น	2,980,545.00	0.41
หนี้สินอื่น	(520,790.50)	(0.07)
มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ	724,040,151.89	100.00

หมายเหตุ : มูลค่าตามราคาตลาดที่รวมดอกเบี้ยค้างรับแล้ว

รายงานสรุปจำนวนเงินลงทุนในตราสารแห่งหนึ่ง เงินฝากหรือตราสารกึ่งหนึ่งกึ่งทุน ของกองทุนรวม
 รายงานสรุปเงินลงทุน
 กองทุนเปิดซีไอเอ็มบี-พริ้นซิเพิล เดลี่ ตราสารรัฐระยะสั้น

กลุ่มของตราสาร	มูลค่าตาม ราคาตลาด (บาท)*	% NAV
(ก) ตราสารภาครัฐไทยและตราสารภาครัฐต่างประเทศ		
- ตราสารภาครัฐไทย	697,570,325.62	96.34
- ตราสารภาครัฐต่างประเทศ	- ไม่มี -	- ไม่มี -
(ข) ตราสารที่ธนาคารที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้น ธนาคารพาณิชย์ หรือบริษัทเงินทุน เป็นผู้ออก ผู้ส่งจ่าย ผู้รับรอง ผู้รับอวัล ผู้สลักหลัง หรือ ผู้ค้ำประกัน	24,010,071.77	3.32
(ค) ตราสารที่มีอันดับความน่าเชื่อถืออยู่ในอันดับที่สามารถลงทุนได้ (investment grade)	- ไม่มี -	- ไม่มี -
(ง) ตราสารที่มีอันดับความน่าเชื่อถืออยู่ในอันดับต่ำกว่าอันดับที่สามารถลงทุนได้ (investment grade) หรือตราสารที่ไม่ได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือ	- ไม่มี -	- ไม่มี -

สัดส่วนเงินลงทุนขั้นสูง (upper limit) ที่บริษัทจัดการคาดว่าจะลงทุนในตราสารกลุ่ม (ง) = 0 % ของ NAV
 หมายเหตุ : * มูลค่าตามราคาตลาดที่รวมดอกเบี้ยค้างรับแล้ว

รายละเอียดตัวตราสารและอันดับความน่าเชื่อถือของตราสารทุกตัวใน Port
 กองทุนเปิดซีไอเอ็มบี-พริ้นซิเพิล เดลี่ ตราสารรัฐระยะสั้น

ประเภท	ผู้ออก	ผู้ค้ำ/ ผู้ รับรอง/ ผู้สลัก หลัง	วันครบ กำหนด	อันดับ ความ น่าเชื่อถือ	จำนวนเงิน ต้น/ มูลค่าหน้าตัว	มูลค่าตาม ราคาตลาด ¹	
1	พันธบัตร	ธนาคารแห่งประเทศไทย	-	20/12/2018	N/A	26,000,000.00	25,983,025.64
2	พันธบัตร	ธนาคารแห่งประเทศไทย	-	27/12/2018	N/A	74,800,000.00	74,726,542.66
3	พันธบัตร	ธนาคารแห่งประเทศไทย	-	03/01/2019	N/A	25,200,000.00	25,168,143.42
4	พันธบัตร	ธนาคารแห่งประเทศไทย	-	10/01/2019	N/A	21,700,000.00	21,663,439.19
5	พันธบัตร	ธนาคารแห่งประเทศไทย	-	10/01/2019	N/A	31,300,000.00	31,247,264.82
6	พันธบัตร	ธนาคารแห่งประเทศไทย	-	17/01/2019	N/A	25,200,000.00	25,150,126.93
7	พันธบัตร	ธนาคารแห่งประเทศไทย	-	17/01/2019	N/A	3,000,000.00	2,994,620.76
8	พันธบัตร	ธนาคารแห่งประเทศไทย	-	24/01/2019	N/A	97,200,000.00	96,994,215.94
9	พันธบัตร	ธนาคารแห่งประเทศไทย	-	24/01/2019	N/A	11,200,000.00	11,174,045.57
10	พันธบัตร	ธนาคารแห่งประเทศไทย	-	31/01/2019	N/A	26,800,000.00	26,734,098.53
11	พันธบัตร	ธนาคารแห่งประเทศไทย	-	31/01/2019	N/A	73,000,000.00	72,820,492.27
12	พันธบัตร	ธนาคารแห่งประเทศไทย	-	07/02/2019	N/A	16,900,000.00	16,855,096.19
13	พันธบัตร	ธนาคารแห่งประเทศไทย	-	07/02/2019	N/A	18,100,000.00	18,051,572.36
14	พันธบัตร	ธนาคารแห่งประเทศไทย	-	14/02/2019	N/A	16,900,000.00	16,850,832.49
15	พันธบัตร	ธนาคารแห่งประเทศไทย	-	14/02/2019	N/A	11,300,000.00	11,267,240.17

ประเภท	ผู้ออก	ผู้ค้า/ ผู้ รับรอง/ ผู้หลัก หลัง	วันครบ กำหนด	อันดับ ความ น่าเชื่อถือ	จำนวนเงิน ต้น/ มูลค่าหน้าตัว	มูลค่าตาม ราคาตลาด ¹	
16	พันธบัตร	ธนาคารแห่งประเทศไทย	-	21/02/2019	N/A	13,000,000.00	12,959,821.03
17	พันธบัตร	ธนาคารแห่งประเทศไทย	-	21/02/2019	N/A	58,600,000.00	58,423,792.14
18	พันธบัตร	ธนาคารแห่งประเทศไทย	-	28/02/2019	N/A	16,800,000.00	16,740,805.54
19	พันธบัตร	ธนาคารแห่งประเทศไทย	-	28/02/2019	N/A	13,000,000.00	12,956,245.12
20	พันธบัตร	ธนาคารแห่งประเทศไทย	-	07/03/2019	N/A	8,600,000.00	8,567,040.16
21	พันธบัตร	ธนาคารแห่งประเทศไทย	-	28/03/2019	N/A	16,100,000.00	16,026,025.65
22	พันธบัตร	ธนาคารแห่งประเทศไทย	-	04/04/2019	N/A	14,000,000.00	13,928,832.54
23	พันธบัตร	ธนาคารแห่งประเทศไทย	-	18/04/2019	N/A	15,900,000.00	15,813,308.43
24	พันธบัตร	ธนาคารแห่งประเทศไทย	-	25/04/2019	N/A	31,600,000.00	31,408,490.10
25	พันธบัตร	ธนาคารแห่งประเทศไทย	-	09/05/2019	N/A	11,200,000.00	11,126,448.82
26	พันธบัตร	ธนาคารแห่งประเทศไทย	-	23/05/2019	N/A	7,400,000.00	7,347,414.64
27	พันธบัตร	ธนาคารแห่งประเทศไทย	-	30/05/2019	N/A	14,700,000.00	14,591,344.51
28	เงินฝาก ธนาคาร	ธนาคารกรุงไทย จำกัด (มหาชน)	-	-	AA+	459,896.10	460,618.69
29	เงินฝาก ธนาคาร	ธนาคารทีสโก้ จำกัด (มหาชน)	-	-	A	22,010,219.73	22,066,655.10
30	เงินฝาก ธนาคาร	ธนาคารชนชาติ จำกัด (มหาชน)	-	-	AA-	1,477,368.75	1,482,696.58
31	เงินฝาก ธนาคาร	ธนาคารออมสิน จำกัด	-	-	AAA	101.40	101.40

หมายเหตุ : ¹ มูลค่าตามราคาตลาดที่รวมดอกเบี้ยค้างรับแล้ว

5.สัดส่วนผู้ถือหน่วยเกิน 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