



krungsri

Asset
Management

Make Life
Simple

A member of  MUFJ
a global financial group

รายงานประจำปีแรก 2567

รอบระยะเวลาตั้งแต่วันที่ 30 สิงหาคม 2566 – 31 มกราคม 2567

กองทุนรวม

KFNDQ

กองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นดีคิวอินเด็กซ์

Krungsri NDQ Index Fund

กองทุนนี้มีการแบ่งชนิดหน่วยลงทุนเป็น 3 ชนิด ได้แก่

1. หน่วยลงทุนชนิดสะสมมูลค่า :

กองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นดีคิวอินเด็กซ์-สะสมมูลค่า (KFNDQ-A)

2. หน่วยลงทุนชนิดผู้ลงทุนสถาบัน :

กองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นดีคิวอินเด็กซ์-ผู้ลงทุนสถาบัน (KFNDQ-I)

3. หน่วยลงทุนชนิดจ่ายเงินปันผล :

กองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นดีคิวอินเด็กซ์-ปันผล (KFNDQ-D)

(บริษัทจัดการยังไม่เปิดขายหน่วยลงทุนชนิดนี้)

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
อาคารเพลินจิตทาวเวอร์ 898 ถนนเพลินจิต แขวงลุมพินี
เขตปทุมวัน กรุงเทพฯ 10330
โทรศัพท์ +66 (0) 2657 5757 โทรสาร +66 (0) 2657 5777
www.krungsriasset.com

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด

รายงานประจำปีแรก 2567

กองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นดีคิวอินเด็กซ์

- สารบัญผู้จัดการ 3
- รายงานผู้ดูแลผลประโยชน์ 4
- งบแสดงฐานะการเงิน งบกำไรขาดทุนเบ็ดเสร็จ และงบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน 5
- รายละเอียดเงินลงทุน การกู้ยืมเงิน และการก่อภาระผูกพันของกองทุนรวม 8
- ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม 11
- คำนายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ 12
- ผลการดำเนินงาน 13
- ข้อมูลอื่นๆ ที่ผู้ถือหน่วยลงทุนควรทราบ 15
 - รายงานบุคคลที่เกี่ยวข้องที่มีการทำธุรกรรมในรอบเวลาที่ผ่านมา
 - รายชื่อผู้จัดการกองทุน
 - การเปิดเผยข้อมูลการถือหน่วยลงทุนเกิน 1 ใน 3
 - อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุนของกองทุน
 - ข้อมูลการลงทุน และผลการดำเนินงานของกองทุนหลัก

สารบริษัทจัดการ

เรียน ผู้ถือหน่วยลงทุน

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด (บริษัทฯ) ขอส่งรายงานสำหรับรอบระยะเวลา 6 เดือน ของกองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นดีคิว อินเด็กซ์ (KFNDQ) ตั้งแต่วันที่ 30 สิงหาคม 2566 ถึงวันที่ 31 มกราคม 2567 มายังผู้ถือหน่วยลงทุน โดยมีรายละเอียดดังนี้

ผลการดำเนินงาน

กองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นดีคิวอินเด็กซ์ มีมูลค่าทรัพย์สินสุทธิ ณ วันที่ 31 มกราคม 2567 ซึ่งแบ่งตามชนิดหน่วยลงทุน ดังนี้

- KFNDQ-A จำนวน 162.32 ล้านบาท คิดเป็นมูลค่าทรัพย์สินสุทธิต่อหน่วยลงทุน 10.9579 บาท

- KFNDQ-I จำนวน 17,533.45 บาท คิดเป็นมูลค่าทรัพย์สินสุทธิต่อหน่วยลงทุน 10.9584 บาท

และมีผลการดำเนินงานตั้งแต่จัดตั้งกองทุน โดยแบ่งตามชนิดหน่วยลงทุน ได้แก่

- KFNDQ-A เพิ่มขึ้นร้อยละ 9.58 น้อยกว่าเกณฑ์มาตรฐานการวัดผลการดำเนินงาน ที่เพิ่มขึ้นร้อยละ 12.72

- KFNDQ-I เพิ่มขึ้นร้อยละ 9.58 น้อยกว่าเกณฑ์มาตรฐานการวัดผลการดำเนินงาน ที่เพิ่มขึ้นร้อยละ 12.72

ภาวะการลงทุนในช่วงที่ผ่านมา

ในรอบครึ่งปีบัญชีที่ผ่านมา กองทุน Invesco NASDAQ 100 ETF (กองทุนหลัก) ปรับตัวเพิ่มขึ้นประมาณ 10.6% โดยในช่วงครึ่งหลังของปี 2566 ตลาดหุ้นสหรัฐฯ ทอยปรับตัวขึ้นต่อเนื่อง หลังภาพเงินเฟ้อส่งสัญญาณชะลอตัวลง ทำให้ตลาดคาดการณ์ว่าธนาคารกลางสหรัฐฯ (Fed) มีโอกาสลดอัตราดอกเบี้ยนโยบายลงมาได้เร็วกว่าที่คาดการณ์ โดยมองว่าอาจลดลงได้ในช่วงไตรมาส 2 ของปี 2567 นอกจากนี้ ตลาดยังคาดว่าเศรษฐกิจสหรัฐฯ จะไม่มีการหดตัวที่รุนแรง (Soft Landing) เนื่องจากการจ้างงานและการบริโภคยังคงแข็งแกร่ง โดยตลาดหุ้น Nasdaq ยังได้แรงส่งจากราคาหุ้นของกลุ่ม Big Tech ที่ปรับเพิ่มขึ้นมาต่อเนื่องและแรงส่งจากหุ้นในกลุ่ม AI ที่ในช่วงที่ผ่านมาขยายตัวได้ดีต่อเนื่อง หลังจากมีการพัฒนาและนำ AI มาใช้ในชีวิตประจำวันมากขึ้น อย่างไรก็ตาม ตลาด Nasdaq ยังคงมีความผันผวน โดยต้องจับตามองความเสี่ยงภูมิรัฐศาสตร์ใน Red Sea และความกังวลเรื่องสงครามระหว่าง Israel และกลุ่ม Hamas ที่ยืดเยื้อ ซึ่งอาจกดดันให้เงินเฟ้อปรับตัวขึ้นมาได้ อีกทั้ง Valuations ที่ปรับเพิ่มขึ้นต่อเนื่อง และความไม่แน่นอนของการดำเนินนโยบายการเงินของ Fed ที่ยังคงอาจคงอัตราดอกเบี้ยไว้ในระดับสูงกว่าที่ตลาดคาดการณ์

ณ สิ้นเดือนธันวาคม 2566 กองทุนหลักมีสัดส่วนการลงทุนหุ้นหมวดเทคโนโลยี 57.9% หมวด Consumer Discretionary 19.1% หมวด Healthcare 6.7% และหมวด Telecommunications 4.9% เป็นต้น

แนวโน้มการลงทุน

การลงทุนในตลาดสหรัฐฯ มีสัญญาณดีขึ้น โดย Fed มีการส่งสัญญาณการหยุดขึ้นอัตราดอกเบี้ยนโยบาย หลังตัวเลขเงินเฟ้อส่งสัญญาณชะลอตัว ทั้งนี้ ตลาดมองว่า Fed มีโอกาสการลดอัตราดอกเบี้ยนโยบายลงได้ในช่วงปี 2567 ประมาณ 4 ครั้ง ซึ่งอาจเป็นแรงส่งให้กับตลาดและหุ้นเทคโนโลยีเนื่องจากจะทำให้ต้นทุนการกู้ยืมปรับลดลงมา อย่างไรก็ตาม ตลาดสหรัฐฯ จะยังคงมีความผันผวน จากทิศทางอัตราดอกเบี้ยนโยบายและความกังวลเรื่องภูมิรัฐศาสตร์ โดยเฉพาะความตึงเครียดที่มากขึ้นในตะวันออกกลาง ประกอบกับต้องจับตามองการเลือกตั้งประธานาธิบดีสหรัฐฯ ในช่วงปลายปี ที่อาจทำให้ตลาดมีความผันผวนขึ้นมาอีกได้

บริษัทฯ ใคร่ขอขอบพระคุณท่านผู้ถือหน่วยลงทุนที่ได้มอบความไว้วางใจให้บริษัทฯ เป็นผู้บริหารเงินลงทุนของท่าน ทั้งนี้ บริษัทฯ จะพิจารณาดำเนินนโยบายการลงทุนที่เหมาะสมกับสถานการณ์ด้วยความระมัดระวัง และคำนึงถึงผลประโยชน์สูงสุดของผู้ถือหน่วยลงทุนเป็นสำคัญ

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด



ความเห็นของผู้ดูแลผลประโยชน์

วันที่ 20 กุมภาพันธ์ 2567

เรียน ผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุนกองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นดีคิวอินเด็กซ์

ธนาคารกรุงเทพ จำกัด (มหาชน) ในฐานะผู้ดูแลผลประโยชน์ ได้ดูแลการจัดการกองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นดีคิวอินเด็กซ์ ซึ่งจัดการโดยบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด สำหรับระยะเวลาตั้งแต่วันที่ 30 สิงหาคม 2566 ถึงวันที่ 31 มกราคม 2567 แล้ว

ธนาคารฯ เห็นว่าบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด ได้ปฏิบัติหน้าที่ในการจัดการกองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นดีคิวอินเด็กซ์ เหมาะสมตามสมควรแห่งวัตถุประสงค์ที่ได้กำหนดไว้ในโครงการและภายใต้พระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535

(นายถุที ลีโทชวลิต)

ธนาคารกรุงเทพ จำกัด (มหาชน)

ในฐานะผู้ดูแลผลประโยชน์

กองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นดีทีวอินเด็กซ์

งบแสดงฐานะการเงิน

ณ 31 มกราคม 2567

	Unaudited (บาท)
สินทรัพย์	
เงินลงทุนตามราคายุติธรรม (ราคาทุน 144,854,023.05 บาท)	159,505,617.28
เงินฝากธนาคาร	3,084,717.01
ลูกหนี้จากสัญญาอนุพันธ์	2,302,186.92
ลูกหนี้	
จากดอกเบี้ย	4,859.99
จากการขายเงินลงทุน	9,884,451.12
จากการขายหน่วยลงทุน	46,865.84
รวมสินทรัพย์	<u>174,828,698.16</u>
หนี้สิน	
เจ้าหนี้จากสัญญาอนุพันธ์	1,446,123.95
เจ้าหนี้	
จากการรับซื้อคืนหน่วยลงทุน	10,731,742.67
ค่าธรรมเนียมสับเปลี่ยนหน่วยลงทุน	103,313.97
ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย	201,082.08
ภาษีเงินได้ค้างจ่าย	729.00
หนี้สินอื่น	4,735.49
รวมหนี้สิน	<u>12,487,727.16</u>
สินทรัพย์สุทธิ	<u>162,340,971.00</u>
สินทรัพย์สุทธิ:	
หน่วยลงทุนจดทะเบียน 10,000 ล้านหน่วย มูลค่าที่ตราไว้หน่วยละ 10 บาท	
ทุนที่ได้รับจากผู้ถือหน่วยลงทุน	148,149,761.73
กำไรสะสม	18,828,143.00
บัญชีปรับสมดุล	(4,636,933.73)
สินทรัพย์สุทธิ	<u>162,340,971.00</u>
ชนิดสะสมมูลค่า	
สินทรัพย์สุทธิ	162,323,437.55
หน่วยลงทุนที่ออกจำหน่ายแล้ว ณ วันสิ้นปี (หน่วย)	14,813,376.1734
สินทรัพย์สุทธิต่อหน่วย	10.9579
ชนิดผู้ลงทุนสถาบัน	
สินทรัพย์สุทธิ	17,533.45
หน่วยลงทุนที่ออกจำหน่ายแล้ว ณ วันสิ้นปี (หน่วย)	1,600.0000
สินทรัพย์สุทธิต่อหน่วย	10.9584

กองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นดีคิวอินเด็กซ์
งบกำไรขาดทุนเบ็ดเสร็จ
สำหรับงวดบัญชีสิ้นสุดวันที่ 31 มกราคม 2567

	Unaudited (บาท)
รายได้จากการลงทุน	
รายได้ดอกเบี้ย	28,855.03
รายได้เงินปันผล	651,789.72
รวมรายได้	680,644.75
ค่าใช้จ่าย	
ค่าธรรมเนียมการจัดการ	657,357.66
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์	26,293.94
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน	131,471.07
ค่าธรรมเนียมวิชาชีพ	28,148.22
ค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์	44,215.81
รวมค่าใช้จ่าย	887,486.70
รายได้จากการลงทุนสุทธิ	(206,841.95)
รายการกำไร (ขาดทุน) สุทธิจากเงินลงทุน	
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิที่เกิดขึ้นจากเงินลงทุน	5,712,983.87
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิที่ยังไม่เกิดขึ้นจากเงินลงทุน	14,651,594.23
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิที่ยังไม่เกิดขึ้นจากสัญญาอนุพันธ์	29,146,952.59
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิจากอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ	(30,472,217.48)
รวมรายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิจากเงินลงทุนที่เกิดขึ้นและยัง ไม่เกิดขึ้น	19,039,313.21
หัก ภาษีเงินได้	(4,328.26)
การเพิ่มขึ้นในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงานหลังหักภาษีเงินได้	18,828,143.00
การเพิ่มขึ้นในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงานแยกตามชนิดหน่วยลงทุน มีดังนี้	
ชนิดสะสมมูลค่า	18,826,609.55
ชนิดผู้ลงทุนสถาบัน	1,533.45
รวม	18,828,143.00

กองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นดีคิวอินเด็กซ์

งบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน

ณ 31 มกราคม 2567

การแสดงรายละเอียดเงินลงทุนใช้การจัดกลุ่มตามประเภทของเงินลงทุนและประเภทของอุตสาหกรรม

ประเภทเงินลงทุน/ผู้ออกตราสาร/ผู้ออกหลักทรัพย์	หมายเลขตราสาร	อัตรา ดอกเบี้ย (%)	วันครบอายุ	เงินต้น (บาท) / จำนวนหุ้น	มูลค่ายุติธรรม (บาท)	Unaudited ร้อยละของ มูลค่าเงิน ลงทุน
หลักทรัพย์ต่างประเทศ						
เงินฝากออมทรัพย์						
						3.89
			เมื่อทวงถาม	6,208,189.02	6,208,189.02	3.89
						จำนวนเงิน 175,135.10 USD
หน่วยลงทุน						
						96.11
	Invesco NASDAQ 100 ETF			138,645,834.03	153,297,428.26	96.11
						จำนวน 25,200.000000 หน่วย
						มูลค่าหน่วยละ 171.6100 USD
						รวมเป็นเงิน 4,324,572.00 USD
					159,505,617.28	100.00

กองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นดีคิวอินเด็กซ์

รายละเอียดการลงทุน ณ 31 มกราคม 2567

	มูลค่าตามราคาตลาด	% NAV
หลักทรัพย์หรือทรัพย์สินในประเทศ	3,089,577.00	1.90
เงินฝากธนาคาร		
FITCH_TH-LONG		
Rate BBB	3,089,577.00	1.90
หลักทรัพย์หรือทรัพย์สินต่างประเทศ	159,505,617.28	98.25
หน่วยลงทุน		
จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์	153,297,428.26	94.43
เงินฝากธนาคาร		
FITCH_TH-LONG		
Rate BBB	6,208,189.02	3.82
สัญญาซื้อขายล่วงหน้า	856,062.97	0.52
สัญญาที่อ้างอิงกับอัตราแลกเปลี่ยน-สัญญาแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ		
TRIS		
Rate A+	969,511.35	0.60
Rate A	(144,872.00)	(0.09)
FITCH-LONG		
Rate AA+	4,383.26	0.00
Rate AA	71,203.40	0.04
Rate AA-	(44,163.04)	(0.03)
อื่นๆ	(1,110,286.25)	(0.67)
ลูกหนี้	9,931,316.96	6.12
เจ้าหนี้	(10,840,521.13)	(6.67)
ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย	(201,082.08)	(0.12)
มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ	162,340,971.00	100.00

กองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นดีคิวอินเด็กซ์

รายละเอียดการลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ณ 31 มกราคม 2567

ประเภทสัญญา	คู่สัญญา	วัตถุประสงค์	มูลค่าสัญญา (Notional Amount)	% NAV	วันครบกำหนด	กำไร/ขาดทุน (net gain/loss)
สัญญาที่อ้างอิงกับอัตราแลกเปลี่ยน						
สัญญาฟอว์เวิร์ด	บมจ.ศ.กรุงศรีอยุธยา	ป้องกันความเสี่ยง	10,516,718.00	(0.0253)	9 ก.พ. 2567	(41,094.80)
สัญญาฟอว์เวิร์ด	บมจ.ศ.กรุงศรีอยุธยา	ป้องกันความเสี่ยง	8,364,312.00	(0.0019)	9 ก.พ. 2567	(3,068.24)
สัญญาฟอว์เวิร์ด	บมจ.ศ.กสิกรไทย	ป้องกันความเสี่ยง	7,235,760.00	(0.1247)	9 ก.พ. 2567	(202,479.06)
สัญญาฟอว์เวิร์ด	บมจ.ศ.กสิกรไทย	ป้องกันความเสี่ยง	7,217,055.00	(0.0708)	9 ก.พ. 2567	(114,983.12)
สัญญาฟอว์เวิร์ด	บมจ.ศ.กสิกรไทย	ป้องกันความเสี่ยง	23,746,632.00	0.1873	22 มี.ค. 2567	304,056.22
สัญญาฟอว์เวิร์ด	บมจ.ศ.กสิกรไทย	ป้องกันความเสี่ยง	32,120,038.00	(0.0254)	22 มี.ค. 2567	(41,260.10)
สัญญาฟอว์เวิร์ด	บมจ.ศ.เกียรตินาคิน	ป้องกันความเสี่ยง	9,036,300.00	(0.0892)	22 มี.ค. 2567	(144,872.00)
สัญญาฟอว์เวิร์ด	บมจ.ศ.กรุงไทย	ป้องกันความเสี่ยง	6,219,491.73	0.0027	2 ก.พ. 2567	4,383.26
สัญญาฟอว์เวิร์ด	บมจ.ธนาคารไทยพาณิชย์	ป้องกันความเสี่ยง	8,468,378.50	(0.0431)	9 ก.พ. 2567	(70,010.50)
สัญญาฟอว์เวิร์ด	บมจ.ธนาคารไทยพาณิชย์	ป้องกันความเสี่ยง	32,013,906.50	0.0968	22 มี.ค. 2567	157,121.99
สัญญาฟอว์เวิร์ด	บมจ.ธนาคารไทยพาณิชย์	ป้องกันความเสี่ยง	10,967,502.00	(0.1616)	22 มี.ค. 2567	(262,341.10)
สัญญาฟอว์เวิร์ด	บมจ.ธนาคารไทยพาณิชย์	ป้องกันความเสี่ยง	43,450,524.00	0.1198	12 เม.ย. 2567	194,425.51
สัญญาฟอว์เวิร์ด	บมจ.ธนาคารไทยพาณิชย์	ป้องกันความเสี่ยง	39,969,024.00	0.0379	24 พ.ค. 2567	61,543.94
สัญญาฟอว์เวิร์ด	บมจ.ธนาคารไทยพาณิชย์	ป้องกันความเสี่ยง	5,165,334.00	0.0278	14 มิ.ย. 2567	45,129.62
สัญญาฟอว์เวิร์ด	บมจ.ศ.ทหารไทยชนชาติ	ป้องกันความเสี่ยง	6,194,178.22	(0.0086)	1 ก.พ. 2567	(14,010.80)
สัญญาฟอว์เวิร์ด	บมจ.ศ.ทหารไทยชนชาติ	ป้องกันความเสี่ยง	7,357,380.30	(0.0145)	9 ก.พ. 2567	(23,577.30)
สัญญาฟอว์เวิร์ด	บมจ.ศ.ทหารไทยชนชาติ	ป้องกันความเสี่ยง	17,642,636.80	0.2189	9 ก.พ. 2567	355,295.20
สัญญาฟอว์เวิร์ด	บมจ.ศ.ทหารไทยชนชาติ	ป้องกันความเสี่ยง	17,898,364.00	(0.0613)	9 ก.พ. 2567	(99,568.00)
สัญญาฟอว์เวิร์ด	บมจ.ศ.ทหารไทยชนชาติ	ป้องกันความเสี่ยง	8,442,664.00	0.0502	9 ก.พ. 2567	81,420.00
สัญญาฟอว์เวิร์ด	บมจ.ศ.ทหารไทยชนชาติ	ป้องกันความเสี่ยง	31,757,609.40	(0.2642)	12 เม.ย. 2567	(428,858.93)
สัญญาฟอว์เวิร์ด	บมจ.ศ.ทหารไทยชนชาติ	ป้องกันความเสี่ยง	23,532,844.00	0.5313	12 เม.ย. 2567	862,595.30
สัญญาฟอว์เวิร์ด	บมจ.ศ.ทหารไทยชนชาติ	ป้องกันความเสี่ยง	18,624,420.00	0.1455	12 เม.ย. 2567	236,215.88

คำอธิบายการจัดอันดับตราสารของสถาบันจัดอันดับความน่าเชื่อถือ

• ตราสารหนี้ระยะกลางและระยะยาว

Moody's	S&P	TRIS	Fitch	คำอธิบาย	
Aaa	AAA	AAA	AAA	ความน่าเชื่อถือสูงสุด 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

- (1) เครื่องหมายบวก (+) หรือ ลบ (-) หรือเลข 1 ถึง 3 ต่อท้ายนั้น เพื่อจำแนกความแตกต่างของคุณภาพของอันดับเครดิตภายในระดับเดียวกัน
- (2) คำเสริมท้าย (tha) จะระบุไว้ต่อจากอันดับเครดิตเพื่อบอกถึงอันดับเครดิตภายในประเทศสำหรับประเทศไทย

ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (Fund's Direct Expenses)

กองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นดีคิวอินเด็กซ์

ตั้งแต่วันที่ 30 สิงหาคม 2566 ถึงวันที่ 31 มกราคม 2567

ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (Fund's Direct Expenses)	จำนวนเงิน (หน่วย: พันบาท)	ร้อยละของมูลค่า ทรัพย์สิน* (ต่อปี) 1/
ค่าธรรมเนียมการจัดการ (Management Fee)	657.36	0.8025
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ (Trustee Fee)	26.29	0.0321
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน (Registrar Fee)	131.47	0.1605
ค่าที่ปรึกษาการลงทุน (Advisory Fee)	-	-
ค่าธรรมเนียมสอบบัญชี (Auditing Fee)	28.15	0.0343
ค่าใช้จ่ายอื่น ๆ (Others)	-	-
รวมค่าใช้จ่ายทั้งหมด 2/	843.27	1.0294

หมายเหตุ

1/ ค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวมข้างต้น เป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่มหรือภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว

2/ ไม่รวมค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ และค่าธรรมเนียมต่าง ๆ ที่เกิดขึ้นจากการซื้อขายหลักทรัพย์

* มูลค่าทรัพย์สิน ในที่นี้ หมายถึง มูลค่าทรัพย์สินทั้งหมด หักด้วย มูลค่าหนี้สินทั้งหมด

เว้นแต่ค่าธรรมเนียมการจัดการ ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ ค่าธรรมเนียมนายทะเบียนหน่วยลงทุน และค่าใช้จ่ายที่เกี่ยวข้องกับการปฏิบัติการกองทุน ณ วันที่คำนวณ

ค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์
กองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นดีคิวอินเด็กซ์ / Krungsri NDQ Index Fund
ตั้งแต่วันที่ 30 สิงหาคม 2566 ถึงวันที่ 31 มกราคม 2567

บริษัท	จำนวนเงิน (USD)	อัตราส่วน (%)
UOB Kay Hian Pte Ltd	2,043.28	100.00
รวม / Total	2,043.28	100.00

ผลการดำเนินงานของกองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นดีคิวอินเด็กซ์-สะสมมูลค่า

ผลการดำเนินงาน สิ้นสุด ณ วันที่ 31 มกราคม 2567	% ตามช่วงเวลา			% ต่อปี				นับจากวันเริ่ม โครงการ (30 สิงหาคม 2566)
	Year to Date	ย้อนหลัง 3 เดือน	ย้อนหลัง 6 เดือน	ย้อนหลัง 1 ปี	ย้อนหลัง 3 ปี	ย้อนหลัง 5 ปี	ย้อนหลัง 10 ปี	
KFNDQ-A	+1.29%	+17.68%	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	+9.58%
ดัชนีชี้วัด (Benchmark)*	+5.21%	+17.57%	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	+12.72%
ความผันผวนของผลการดำเนินงาน	+15.99%	+14.28%	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	+15.38%
ความผันผวนของดัชนีชี้วัด	+17.58%	+17.06%	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	+16.78%

หมายเหตุ : * ดัชนีชี้วัด (Benchmark) คือ

ผลการดำเนินงานของกองทุนหลัก สัดส่วน 100.00% ปรับด้วยอัตราแลกเปลี่ยนเพื่อเทียบเท่ากับค่าสกุลเงินบาท ณ วันที่คำนวณผลตอบแทน

** ผลตอบแทนที่มีอายุเกินหนึ่งปีจะแสดงเป็นผลตอบแทนต่อปี

เอกสารการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวมฉบับนี้ ได้จัดทำตามมาตรฐานการวัดผลดำเนินงานของ
กองทุนรวมของสมาคมบริษัทจัดการลงทุน

ผลการดำเนินงานของกองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นดีคิวอินเด็กซ์-ผู้ลงทุนสถาบัน

ผลการดำเนินงาน สิ้นสุด ณ วันที่ 31 มกราคม 2567	% ตามช่วงเวลา			% ต่อปี				นับจากวันเริ่ม โครงการ (30 สิงหาคม 2566)
	Year to Date	ย้อนหลัง 3 เดือน	ย้อนหลัง 6 เดือน	ย้อนหลัง 1 ปี	ย้อนหลัง 3 ปี	ย้อนหลัง 5 ปี	ย้อนหลัง 10 ปี	
KFNDQ-I	+1.29%	+17.68%	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	+9.58%
ดัชนีชี้วัด (Benchmark)*	+5.21%	+17.57%	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	+12.72%
ความผันผวนของผลการดำเนินงาน	+15.99%	+14.28%	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	+15.38%
ความผันผวนของดัชนีชี้วัด	+17.58%	+17.06%	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	+16.78%

หมายเหตุ : * ดัชนีชี้วัด (Benchmark) คือ

ผลการดำเนินงานของกองทุนหลัก สัดส่วน 100.00% ปรับด้วยอัตราแลกเปลี่ยนเพื่อเทียบเท่ากับค่าสกุลเงินบาท ณ วันที่คำนวณผลตอบแทน

** ผลตอบแทนที่มีอายุเกินหนึ่งปีจะแสดงเป็นผลตอบแทนต่อปี

เอกสารการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวมฉบับนี้ ได้จัดทำตามมาตราฐานการวัดผลดำเนินงานของ
กองทุนรวมของสมาคมบริษัทจัดการลงทุน

ข้อมูลอื่นๆ ที่ผู้ถือหน่วยลงทุนควรทราบ

(1) รายงานบุคคลที่เกี่ยวข้องที่มีการทำธุรกรรมในรอบเวลาที่ผ่านมา (วันที่ 30 สิงหาคม 2566 ถึงวันที่ 31 มกราคม 2567)

ชื่อกองทุน	รายชื่อบุคคลที่เกี่ยวข้อง
กองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นดีคิวอินเด็กซ์	1. ธนาคารกรุงศรีอยุธยา จำกัด (มหาชน) 2. บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด

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

(2) รายชื่อผู้จัดการกองทุน ณ วันที่ 31 มกราคม 2567

1. นายชลิต โสคติย์พัฒนา
2. นายสาธิต บัวชู
3. นางสาวสาวิณี สุขศรีวงศ์
4. นายปีติ ประดิพัทธ์พงษ์
5. นายกวิพ เจริญเสาวภาคย์
6. นายเอกชัย บุญยะพงศ์ไชย
7. นายจตุรันต์ สอนไว
8. นายชูศักดิ์ อวยพรชัยสกุล
9. นายพงศ์สัมพันธ์ อนุรัตน์
10. นางสาววรรดา คันดิสุนทร
11. นายวัชรินทร์ ค้วงสังข์

(3) การเปิดเผยข้อมูลการถือหน่วยลงทุนเกิน 1 ใน 3 ณ วันที่ 31 มกราคม 2567

ไม่มีการถือหน่วยลงทุนเกิน 1 ใน 3 ของบุคคลใดบุคคลหนึ่ง

ผู้ถือหน่วยลงทุนสามารถตรวจสอบข้อมูลสัดส่วนการถือหน่วยลงทุนโดยตรงได้ที่ www.krungsriasset.com

(4) อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุนของกองทุน (portfolio turnover ratio) ในรอบระยะเวลาที่ผ่านมา

- KFNDQ-A (portfolio turnover ratio) เท่ากับ 107.64%
- KFNDQ-I (portfolio turnover ratio) เท่ากับ 107.64%

(5) ผลการดำเนินงานและข้อมูลการลงทุนของกองทุนหลัก (ข้อมูล ณ วันที่ 31/12/2023)

Performance as at December 31, 2023

Performance (%)	YTD	1Y	3Y	5Y	10Y	Fund Inception
ETF - NAV	54.92	54.92	10.04	-	-	11.59
ETF - Market Price	55.04	55.04	10.04	-	-	11.56
Underlying Index	55.13	55.13	10.18	22.66	17.91	11.74
Benchmark ¹	44.64	44.64	6.04	18.75	14.80	8.43
Benchmark ²	25.96	25.96	8.54	15.16	11.48	10.93

Calendar year performance (%)

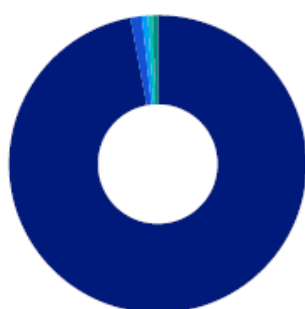
	2023	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015	2014
ETF - NAV	54.92	-32.45	27.33	-	-	-	-	-	-	-
Underlying Index	55.13	-32.38	27.51	-	-	-	-	-	-	-
Benchmark ¹	44.64	-32.54	22.18	-	-	-	-	-	-	-
Benchmark ²	25.96	-19.21	25.66	-	-	-	-	-	-	-

Returns less than one year are cumulative. Performance data quoted represents past performance. Past performance is not a guarantee of future results; current performance may be higher or lower than performance quoted. Investment returns and principal value will fluctuate and Shares, when redeemed, may be worth more or less than their original cost. See [invesco.com](https://www.invesco.com) to find the most recent month-end performance numbers. Market returns are based on the midpoint of the bid/ask spread at 4 p.m. ET and do not represent the returns an investor would receive if shares were traded at other times.

Top ETF holdings (%)	(Total holdings: 101)
Name	Weight
Apple	9.22
Microsoft	8.61
Amazon	4.83
Broadcom	4.15
Meta Platforms 'A'	3.85
Nvidia	3.77
Tesla	3.68
Alphabet 'A'	2.55
Alphabet 'C'	2.48
Costco Wholesale	2.32

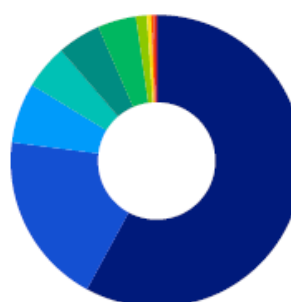
Please see the website for complete holdings information. Holdings are subject to change.

Geographic allocation (%)



United States	97.04
China	1.25
Brazil	0.63
United Kingdom	0.55
Netherlands	0.53

Sector allocation (%)



Technology	57.93
Consumer Discretionary	19.11
Health Care	6.67
Telecommunications	4.97
Industrials	4.80
Consumer Staples	4.27
Utilities	1.19
Energy	0.49
Basic Materials	0.29
Real Estate	0.28