



krungsri

Asset
Management

Make Life
Simple

A member of  MUFG
a global financial group

รายงานประจำปีครั้งแรก 2567

รอบระยะเวลาตั้งแต่วันที่ 20 ธันวาคม 2566 – 31 พฤษภาคม 2567

กองทุนรวม

KFTHAIESG

กองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นแฮนซ์เซ็กไทยเพื่อความยั่งยืน

Krungsri Enhanced SET Thailand ESG Fund

กองทุนนี้มีการแบ่งชนิดหน่วยลงทุนเป็น 2 ชนิด ได้แก่

1. หน่วยลงทุนชนิดสะสมมูลค่า :

กองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นแฮนซ์เซ็กไทยเพื่อความยั่งยืน-ไทยเพื่อความยั่งยืนสะสมมูลค่า (KFTHAIESGA)

2. หน่วยลงทุนชนิดจ่ายเงินปันผล :

กองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นแฮนซ์เซ็กไทยเพื่อความยั่งยืน-ไทยเพื่อความยั่งยืนปันผล (KFTHAIESGD)

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

รายงานประจำปีครั้งแรก 2567

กองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นแอสส์เซ็ทไทยเพื่อความยั่งยืน

- สารบัญผู้จัดการ 3
- รายงานผู้ดูแลผลประโยชน์ 5
- งบแสดงฐานะการเงิน งบกำไรขาดทุนเบ็ดเสร็จ และงบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน 6
- รายละเอียดเงินลงทุน การกู้ยืมเงิน และการก่อภาวะผูกพันของกองทุนรวม 12
- ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม 15
- คำนายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ 16
- ผลการดำเนินงาน 17
- ข้อมูลอื่นๆ ที่ผู้ถือหน่วยลงทุนควรทราบ 19
 - รายงานบุคคลที่เกี่ยวข้องที่มีการทำธุรกรรมในรอบเวลาที่ผ่านมา
 - การรับผลประโยชน์ตอบแทนเนื่องจากการใช้บริการบุคคลอื่นๆ
 - รายชื่อผู้จัดการกองทุน
 - การเปิดเผยข้อมูลการถือหน่วยลงทุนเกิน 1 ใน 3
 - อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุนของกองทุน
- รายงานการบริหารจัดการกองทุนรวมเพื่อความยั่งยืน 21

สารบริษัทจัดการ

เรียน ผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุน

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด (บริษัท) ขอนำส่งรายงานสำหรับรอบระยะเวลา 6 เดือน ของกองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นแชนซ์ เซ็ทไทยเพื่อความยั่งยืน (KFTHAIESG) ตั้งแต่วันที่ 20 ธันวาคม 2566 ถึงวันที่ 31 พฤษภาคม 2567 มายังผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุน โดยมีรายละเอียดดังนี้

ผลการดำเนินงาน

กองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นแชนซ์เซ็ทไทยเพื่อความยั่งยืน มีมูลค่าทรัพย์สินสุทธิ ณ วันที่ 31 พฤษภาคม 2567 ซึ่งแบ่งตามชนิดหน่วยลงทุน ดังนี้

- KFTHAIESGA จำนวน 209.68 ล้านบาท คิดเป็นมูลค่าทรัพย์สินสุทธิต่อหน่วยลงทุน 9.6608 บาท

- KFTHAIESGD จำนวน 264.96 ล้านบาท คิดเป็นมูลค่าทรัพย์สินสุทธิต่อหน่วยลงทุน 9.6608 บาท

และมีผลการดำเนินงานตั้งแต่จัดตั้งกองทุน โดยแบ่งตามชนิดหน่วยลงทุน ได้แก่

- KFTHAIESGA ลดลงร้อยละ 3.39 ลดลงมากกว่าดัชนีผลตอบแทนรวม SET ESG (SET ESG TRI) ที่ลดลงร้อยละ 2.35

- KFTHAIESGD ลดลงร้อยละ 3.39 ลดลงมากกว่าดัชนีผลตอบแทนรวม SET ESG (SET ESG TRI) ที่ลดลงร้อยละ 2.35

ภาวะการลงทุนในช่วงที่ผ่านมา

ในรอบครึ่งปีบัญชีที่ผ่านมาดัชนีผลตอบแทนรวมตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (ตลาดหลักทรัพย์ฯ) SET ปรับตัวอยู่ระหว่าง 1,330.24 – 1,438.10 จุด ก่อนปิดที่ 1,345.66 จุด ณ วันที่ 31 พฤษภาคม 2567 โดยในช่วงเวลาดังกล่าว ดัชนีปรับตัวลดลงร้อยละ 0.27

ในเดือนธันวาคม 2566 ดัชนีปรับตัวเพิ่มขึ้น บรรยากาศการลงทุนเดือนธันวาคมเป็นไปในเชิงบวกสำหรับสินทรัพย์เสี่ยง เนื่องจากอัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลสหรัฐฯ ปรับตัวลดลงอย่างรวดเร็ว สำหรับปัจจัยภายในประเทศ กองทุนไทยเพื่อความยั่งยืน (Thai ESG) ซึ่งเป็นกองทุนลดหย่อนภาษี สามารถระดมเงินทุนได้เพียงครึ่งหนึ่งของที่รัฐบาลคาดการณ์ และมีได้ส่งผลกระทบต่อดัชนีโดยรวม ในด้านปัจจัยทางการเมือง ร่างงบประมาณประจำปี 2567 จะเข้าสู่การพิจารณาสภาผู้แทนราษฎรในวาระแรกระหว่างวันที่ 3 – 5 มกราคม 2567 ซึ่งจะเป็นปัจจัยหลักที่ตลาดให้ความสนใจ นอกจากนี้การที่ DELTA ยังคงเป็นองค์ประกอบของดัชนี SET50 ในช่วงครึ่งแรกของปี 2567 ก็เป็นปัจจัยสำคัญที่ช่วยพยุงตลาด

ในเดือนมกราคม 2567 ดัชนีไม่สามารถรักษาแรงส่งเชิงบวกที่เกิดขึ้นในเดือนธันวาคมที่ผ่านมา ในช่วงสองสัปดาห์แรกของการซื้อขายตลาดหุ้นไทยสามารถยืนได้ เนื่องจากนักลงทุนคาดว่าโครงการลดหย่อนภาษี E-Receipt จะเป็นแรงกระตุ้นการบริโภคในขณะที่ภาคการท่องเที่ยวยังคงมีแรงดึงดูดจากการยกเว้นวีซ่าเป็นการถาวรให้แก่นักท่องเที่ยวจีน ตลาดปรับตัวผันผวนในช่วงครึ่งหลังของเดือน หมวดธนาคารรายงานผลกำไรสุทธิไตรมาส 4/66 อย่างน่าผิดหวังและมีมุมมองต่อการชะลอตัวของผลกำไรสุทธิในปี 2567 ในขณะที่โครงการกระเป๋าเงินดิจิทัล (Digital Wallet) ยังคงไม่มีความชัดเจนรวมถึงเรื่องระยะเวลา ในช่วงวันทำการสุดท้ายของเดือนพรรคก้าวไกลถูกศาลรัฐธรรมนูญวินิจฉัยว่าการรณรงค์หาเสียงในการแก้ไขประมวลกฎหมายอาญามาตรา 112 เป็นการฝ่าฝืนรัฐธรรมนูญ ตลาดตอบสนองในเชิงลบจากความกังวลเกี่ยวกับความเป็นไปได้ในการประท้วงส่งผลให้ดัชนีปรับตัวลดลงในช่วงสิ้นเดือนใกล้ถึงระดับต่ำที่สุดนับจากต้นปีจนถึงปัจจุบัน

ในเดือนกุมภาพันธ์ 2567 ดัชนีปรับตัวเพิ่มขึ้นแต่ยังคงปรับตัวอ่อนแอกว่าตลาดหุ้นในภูมิภาค บริษัทจดทะเบียนของไทยเสร็จสิ้นการรายงานผลกำไรสุทธิไตรมาส 4/66 ผลกำไรสุทธิปรับตัวเพิ่มขึ้นร้อยละ 4.1 Y-Y ในขณะที่ผลกำไรสุทธิต่อหุ้นโดยรวมของดัชนีเต็มปี 2566 ปรับตัวลดลงร้อยละ 6.0 Y-Y การประกาศ จัดพีทีไตรมาส 4/66 ในเดือนกุมภาพันธ์อยู่ที่ระดับร้อยละ 1.7 ซึ่งเป็นระดับเดียวกับที่มีเอกสารหลุดออกมาในช่วงก่อนหน้าส่งผลให้จีดีพีเต็มปี 2566 เติบโตร้อยละ 1.9 ทั้งนี้ กนง. ลงมติ 5:2 ในการคงอัตราดอกเบี้ย แสดงให้เห็นถึงโอกาสในการปรับลดอัตราดอกเบี้ยเร็วกว่าที่คาดไว้ในปี 2567

ในเดือนมีนาคม ดัชนีปรับตัวเพิ่มขึ้น ทว่ายังคงปรับตัวอ่อนแอกว่าตลาดหุ้นในภูมิภาค ไม่มีข่าวสารภายในประเทศที่ส่งผลกระทบต่อทิศทางของตลาดหุ้นมากนัก นอกจากนี้ การขึ้นเครื่องหมาย XD ของบริษัทขนาดใหญ่ในตลาดฯ ส่งผลกดดันกับดัชนีพอสมควร บรรยากาศการลงทุนโดยรวมยังคงเป็นไปอย่างซบเซาและมูลค่าซื้อขายเฉลี่ยต่อวันปรับตัวอ่อนแอลง สวนทางกับตลาดหุ้นต่างประเทศที่ปรับตัวเพิ่มขึ้น ทำสถิติสูงสุดใหม่จากความคาดหวังในการปรับลดอัตราดอกเบี้ยของ Fed และตัวเลขเศรษฐกิจที่ออกมาแข็งแกร่ง

ในเดือนเมษายน 2567 ดัชนีปรับตัวแทบจะไม่เปลี่ยนแปลงในเดือนที่การซื้อขายชะลอตัว แรงขับเคลื่อนมาจากการปรับตัวเพิ่มขึ้นอย่างแข็งแกร่งของตลาดหุ้นจีนและฮ่องกง อัตราเงินเฟ้อเดือนมีนาคม 2567 ของสหรัฐมีระดับสูงกว่าที่คาดไว้เป็นเดือนที่ 3 ติดต่อกัน ส่งผลให้นักลงทุนคาดการณ์การปรับลดอัตราดอกเบี้ยเหลือเพียง 1 ครั้งในปี 2567 ตลาดหุ้นไทยปรับตัวลดลงสู่ระดับต่ำที่สุดในรอบ 3 ปีครึ่ง เป็นระยะเวลาสั้นๆ จากความขัดแย้งระหว่างอิสราเอล-อิหร่านก่อนที่จะฟื้นตัวขึ้นตามตลาดหุ้นโลกหลังจากที่ความตึงเครียดมิได้ปรับตัวเพิ่มขึ้น อย่างไรก็ตามบรรยากาศการลงทุนยังคงอ่อนแอ เนื่องจากการความไม่แน่นอนของโครงการ Digital Wallet

ในเดือนพฤษภาคม 2567 ดัชนีปรับตัวลดลงอยู่ในกรอบแคบ ในขณะที่ดัชนีตลาดหุ้นของประเทศตะวันตกยังคงปรับตัวเพิ่มขึ้น ปัจจัยสนับสนุนมาจากการคาดการณ์ปรับลดอัตราดอกเบี้ยของ Fed สู่ระดับต่ำกว่าร้อยละ 4.5 จากเดิมที่ร้อยละ 4.7 ในช่วงปลายเดือนเมษายนที่ผ่านมา ตลาดหุ้นไทยถูกปกคลุมด้วยความไม่แน่นอนของนโยบายกระตุ้นเศรษฐกิจ และปัจจัยการเมืองหลังจากที่วุฒิสมาชิก 40 รายยื่นถอดถอนนายรัฐมนตรีจากประเด็นเกี่ยวกับการแต่งตั้งคณะรัฐมนตรี ในด้านปัจจัยบวกบริษัทจดทะเบียนรายงานผลกำไรสุทธิไตรมาส 1/67 ในระดับดีกว่าที่คาดไว้

แนวโน้มการลงทุน

บริษัทฯ มีมุมมองว่าตลาดหุ้นไทยยังคงถูกกดดันจากปัจจัยการเมืองภายในประเทศ จากประเด็นเรื่องการยุบพรรคก้าวไกล และการตัดสินใจของนายรัฐมนตรี เศรษฐสา ทวีสิน และอดีตนายกทักษิณ ซึ่งส่งผลกระทบต่อความเชื่อมั่นของนักลงทุน และความต่อเนื่องของนโยบายภาครัฐซึ่งเป็นปัจจัยสำคัญในการสนับสนุนเศรษฐกิจ ในขณะที่ปัจจัยภายนอกประเทศจะเริ่มกลับมาในทางบวกมากขึ้น

แนวทางการบริหารกองทุนตราสารทุนยังคงเป็นการคัดเลือกหลักทรัพย์ที่จะลงทุนรายตัว จากข้อมูลที่ได้รับจากการพบกับผู้บริหารบริษัทจดทะเบียน การวิเคราะห์บริษัทจดทะเบียน ทั้งในเชิงคุณภาพ และเชิงปริมาณ รวมถึงการติดตามผลการดำเนินงานของบริษัทจดทะเบียนอย่างสม่ำเสมอ โดยบริษัทฯ เชื่อว่าแนวทางการบริหารกองทุนตราสารทุนดังกล่าวจะเป็นสิ่งที่ส่งเสริมให้กองทุนสามารถสร้างผลตอบแทนจากการลงทุนในตลาดหลักทรัพย์ฯ ที่ดีในระยะกลาง และระยะยาว

บริษัทฯ ใคร่ขอขอบพระคุณท่านผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุนที่ได้มอบความไว้วางใจให้บริษัทฯ เป็นผู้บริหารเงินลงทุนของท่าน ทั้งนี้ บริษัทฯ จะพิจารณาดำเนินนโยบายการลงทุนที่เหมาะสมกับสถานการณ์ด้วยความระมัดระวัง และคำนึงถึงผลประโยชน์สูงสุดของผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุนเป็นสำคัญ

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด



ความเห็นของผู้ดูแลผลประโยชน์

วันที่ 20 มิถุนายน 2567

เรียน ผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุนกองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นแฮนซ์เซีทไทยเพื่อความยั่งยืน

ธนาคารกรุงเทพ จำกัด (มหาชน) ในฐานะผู้ดูแลผลประโยชน์ ได้ดูแลการจัดการกองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นแฮนซ์เซีทไทยเพื่อความยั่งยืน ซึ่งจัดการโดยบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด สำหรับระยะเวลาตั้งแต่วันที่ 20 ธันวาคม 2566 ถึงวันที่ 31 พฤษภาคม 2567 แล้ว

ธนาคารฯ เห็นว่าบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด ได้ปฏิบัติหน้าที่ในการจัดการกองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นแฮนซ์เซีทไทยเพื่อความยั่งยืน เหมาะสมตามสมควรแห่งวัตถุประสงค์ที่ได้กำหนดไว้ในโครงการ และภายใต้พระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535

(นฤฤดี สีโทชวลิต)

ธนาคารกรุงเทพ จำกัด (มหาชน)

ในฐานะผู้ดูแลผลประโยชน์

กองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นแอสส์เซ่ไทยเพื่อความยั่งยืน

งบแสดงฐานะการเงิน

ณ 31 พฤษภาคม 2567

	Unaudited (บาท)
สินทรัพย์	
เงินลงทุนตามราคายุติธรรม (ราคาทุน 486,107,626.29 บาท)	462,258,522.20
เงินฝากธนาคาร	9,956,886.19
ลูกหนี้	
จากดอกเบี้ย	34,928.95
จากการขายเงินลงทุน	2,858,431.93
จากการขายหน่วยลงทุน	333,750.00
จากเงินปันผล	83,430.00
รวมสินทรัพย์	<u>475,525,949.27</u>
หนี้สิน	
เจ้าหนี้	
จากการซื้อเงินลงทุน	479,281.38
ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย	388,733.19
ภาษีเงินได้ค้างจ่าย	5,239.34
หนี้สินอื่น	11,142.35
รวมหนี้สิน	<u>884,396.26</u>
สินทรัพย์สุทธิ	<u>474,641,553.01</u>
สินทรัพย์สุทธิ:	
หน่วยลงทุนจดทะเบียน 300 ล้านหน่วย มูลค่าที่ตราไว้หน่วยละ 10 บาท	
ทุนที่ได้รับจากผู้ถือหน่วยลงทุน	491,303,911.10
กำไรสะสม	(16,241,837.55)
บัญชีปรับสมดุล	(420,520.54)
สินทรัพย์สุทธิ	<u>474,641,553.01</u>
ชนิดไทยเพื่อความยั่งยืนสะสมมูลค่า (KFTHAIESGA)	
สินทรัพย์สุทธิ	209,679,019.02
หน่วยลงทุนที่ออกจำหน่ายแล้ว ณ วันสิ้นปี (หน่วย)	21,703,979.8852
สินทรัพย์สุทธิต่อหน่วย	9.6608
ชนิดไทยเพื่อความยั่งยืนปันผล (KFTHAIESGD)	
สินทรัพย์สุทธิ	264,962,533.99
หน่วยลงทุนที่ออกจำหน่ายแล้ว ณ วันสิ้นปี (หน่วย)	27,426,411.2283
สินทรัพย์สุทธิต่อหน่วย	9.6608

กองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นแอสส์เซ่ทไทยเพื่อความยั่งยืน
งบกำไรขาดทุนเบ็ดเสร็จ
สำหรับงวดบัญชีสิ้นสุดวันที่ 31 พฤษภาคม 2567

	Unaudited (บาท)
รายได้จากการลงทุน	
รายได้ดอกเบี้ย	41,053.19
รายได้เงินปันผล	10,623,625.29
รวมรายได้	10,664,678.48
ค่าใช้จ่าย	
ค่าธรรมเนียมการจัดการ	1,414,330.36
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์	51,133.55
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน	326,383.98
ค่าธรรมเนียมวิชาชีพ	28,924.66
ค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์	369,389.71
รวมค่าใช้จ่าย	2,190,162.26
รายได้จากการลงทุนสุทธิ	8,474,516.22
รายการกำไร (ขาดทุน) สุทธิจากเงินลงทุน	
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิที่เกิดขึ้นจากเงินลงทุน	(861,091.70)
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิที่ยังไม่เกิดขึ้นจากเงินลงทุน	(23,849,104.09)
รวมรายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิจากเงินลงทุนที่เกิดขึ้นและยังไม่เกิดขึ้น	(24,710,195.79)
หัก ภาษีเงินได้	(6,157.98)
การเพิ่มขึ้นในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงานหลังหักภาษีเงินได้	(16,241,837.55)
การเพิ่มขึ้นในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงานแยกตามชนิดหน่วยลงทุน มีดังนี้	
ชนิดไทยเพื่อความยั่งยืนสะสมมูลค่า (KFTHAIESGA)	(7,062,980.29)
ชนิดไทยเพื่อความยั่งยืนปันผล (KFTHAIESGD)	(9,178,857.26)
รวม	(16,241,837.55)

กองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นแชนซ์เซ็ทไทยเพื่อความยั่งยืน

งบประมาณรายละเอียดเงินลงทุน

ณ 31 พฤษภาคม 2567

การแสดงรายละเอียดเงินลงทุนใช้การจัดกลุ่มตามประเภทของเงินลงทุนและประเภทของอุตสาหกรรม

ประเภทเงินลงทุน/ผู้ออกตราสาร/ผู้ออกหลักทรัพย์	หมายเลขตราสาร	อัตราดอกเบี้ย (%)	วันครบอายุ	เงินต้น (บาท) / จำนวนหุ้น	มูลค่ายุติธรรม (บาท)	Unaudited ร้อยละของมูลค่าเงินลงทุน
หลักทรัพย์ในประเทศ						
เงินฝากออมทรัพย์						
บมจ.ช.ยูโอบี		1.150000	เมื่อทวงถาม	5,000.00	5,000.00	0.00
หุ้นจดทะเบียน						
หุ้นสามัญ						
กลุ่มเกษตรและอุตสาหกรรมอาหาร						
หมวดธุรกิจการเกษตร						
บมจ.ศรีตรังแอกโรอินดัสทรี	STA			115,900.00	2,735,240.00	0.59
หมวดอาหารและเครื่องดื่ม						
บมจ.คาราบาวกรุ๊ป	CBG			97,600.00	6,856,400.00	1.48
บมจ.เจริญโภคภัณฑ์อาหาร	CPF			354,900.00	8,091,720.00	1.75
บมจ.ไอ-เทล คอร์ปอเรชั่น	ITC			117,300.00	2,709,630.00	0.59
บมจ. โอสดสภา	OSP			157,500.00	3,591,000.00	0.78
บมจ. อาร์ แอนด์ บี ฟู้ด ซัพพลาย	RBF			95,000.00	940,500.00	0.20
บมจ.เซ็ปเป้	SAPPE			14,600.00	1,518,400.00	0.33
บมจ.ไทยฟู้ดส์ กรุ๊ป	TFG			110,100.00	447,006.00	0.10
กลุ่มสินค้าอุปโภคบริโภค						
หมวดของผู้ใช้ส่วนตัวและเวชภัณฑ์						
บมจ.ศรีตรังโกลฟส์ (ประเทศไทย)	STGT			258,100.00	2,890,720.00	0.63
กลุ่มธุรกิจการเงิน						
หมวดธนาคาร						
บมจ.ช.กรุงเทพ	BBL			90,600.00	12,366,900.00	2.68
บมจ.ช.กสิกรไทย	KBANK			114,900.00	15,051,900.00	3.26
บมจ.ช.เกียรตินาคินภัทร	KKP			34,400.00	1,754,400.00	0.38
บมจ.ช.กรุงไทย	KTB			744,000.00	12,796,800.00	2.77
บมจ.เอสซีบี เอกซ์	SCB			159,800.00	16,938,800.00	3.66
บมจ.ช.ทหารไทยธนชาติ	TTB			4,349,100.00	7,349,979.00	1.59
หมวดเงินทุนและหลักทรัพย์						
บมจ.บริหารสินทรัพย์ กรุงเทพพาณิชย์	BAM			256,100.00	2,189,655.00	0.47
บมจ.บัวตองไทย	KTC			74,200.00	3,394,650.00	0.73
บมจ.เมืองไทย แคปปิตอล	MTC			137,700.00	6,127,650.00	1.33
บมจ.ศรีสวัสดิ์ คอร์ปอเรชั่น	SAWAD			163,940.00	6,803,510.00	1.47
บมจ.เงินดีดี	TIDLOR			115,922.00	2,306,847.80	0.50

กองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นแฮนซ์เซ็ทไทยเพื่อความยั่งยืน

งบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน

ณ 31 พฤษภาคม 2567

การแสดงรายละเอียดเงินลงทุนใช้การจัดกลุ่มตามประเภทของเงินลงทุนและประเภทของอุตสาหกรรม

ประเภทเงินลงทุน/ผู้ออกตราสาร/ผู้ออกหลักทรัพย์	หมายเลขตราสาร	อัตราดอกเบี้ย (%)	วันครบอายุ	เงินต้น (บาท) / จำนวนหุ้น	มูลค่ายุติธรรม (บาท)	Unaudited ร้อยละของมูลค่าเงินลงทุน
หมวดประกันชีวิตและประกันภัย						0.49
บมจ.กรุงเทพประกันชีวิต	BLA			69,200.00	1,418,600.00	0.31
บมจ.ไทยประกันชีวิต	TLI			60,700.00	528,090.00	0.11
บมจ.ทีคิวเอ็ม อัลฟา	TQM			11,900.00	309,400.00	0.07
กลุ่มสินค้าอุตสาหกรรม						
หมวดบรรจุกัญชา						1.42
บมจ.เอสซีจี แพคเกจจิ้ง	SCGP			197,200.00	6,556,900.00	1.42
หมวดปิโตรเคมีและเคมีภัณฑ์						3.73
บมจ.อินโดรามา เวนเจอร์ส	IVL			341,800.00	7,895,580.00	1.71
บมจ.พีทีที โกลบอล เคมีคอล	PTTGC			269,300.00	9,358,175.00	2.02
กลุ่มอสังหาริมทรัพย์และก่อสร้าง						
หมวดวัสดุก่อสร้าง						2.40
บมจ.อีสเทิร์น โพลีเมอร์ กรุ๊ป	EPG			79,900.00	535,330.00	0.12
บมจ.ปูนซิเมนต์ไทย	SCC			44,600.00	10,525,600.00	2.28
หมวดธุรกิจบริการรับเหมาก่อสร้าง						0.53
บมจ.ช.การช่าง	CK			108,900.00	2,428,470.00	0.53
หมวดพัฒนาอสังหาริมทรัพย์						6.44
บมจ.อมตะ คอร์ปอเรชัน	AMATA			59,500.00	1,368,500.00	0.30
บมจ.เอพี (ไทยแลนด์)	AP			146,700.00	1,349,640.00	0.29
บมจ.แอสเสท เวิร์ด คอร์ป	AWC			1,940,800.00	7,375,040.00	1.60
บมจ.เซ็นทรัลพัฒนา	CPN			192,500.00	11,020,625.00	2.38
บมจ.แลนด์ แอนด์ เฮาส์	LH			240,300.00	1,585,980.00	0.34
บมจ.แสนสิริ	SIRI			1,345,100.00	2,138,709.00	0.46
บมจ.ศุภกัลยา	SPALI			59,300.00	1,097,050.00	0.24
บมจ.ดับเบิลยูเอชเอ คอร์ปอเรชั่น	WHA			702,100.00	3,826,445.00	0.83
กลุ่มทรัพยากร						
หมวดพลังงานและสาธารณูปโภค						25.11
บมจ.บ้านปู	BANPU			678,800.00	3,665,520.00	0.79
บมจ.บางจาก คอร์ปอเรชั่น	BCP			70,000.00	2,677,500.00	0.58
บมจ.บี.กริม เพาเวอร์	BGRIM			202,200.00	5,034,780.00	1.09
บมจ.บางจาก ศรีราชา	BSRC			53,200.00	476,140.00	0.10
บมจ.ซีเค พาวเวอร์	CKP			245,300.00	976,294.00	0.21
บมจ.พลังงานบริสุทธิ์	EA			333,600.00	7,639,440.00	1.65
บมจ.ผลิตไฟฟ้า	EGCO			26,800.00	2,787,200.00	0.60

กองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นแอสซ์เซ็ทไทยเพื่อความยั่งยืน

งประกอบรายละเอียดเงินลงทุน

ณ 31 พฤษภาคม 2567

การแสดงรายละเอียดเงินลงทุนใช้การจัดกลุ่มตามประเภทของเงินลงทุนและประเภทของอุตสาหกรรม

ประเภทเงินลงทุน/ผู้ออกตราสาร/ผู้ออกหลักทรัพย์	หมายเลขตราสาร	อัตราดอกเบี้ย (%)	วันครบอายุ	เงินต้น (บาท) / จำนวนหุ้น	มูลค่ายุติธรรม (บาท)	Unaudited ร้อยละของมูลค่าเงินลงทุน
บมจ. โกลบอล เพาเวอร์ ซินเนอร์ซี	GPSC			184,000.00	8,648,000.00	1.87
บมจ. กัลฟ์ เอ็นเนอร์จี ดีเวลลอปเมนท์	GULF			533,500.00	21,606,750.00	4.67
บมจ. ไออาร์พีซี	IRPC			905,200.00	1,719,880.00	0.37
บมจ. ปตท. น้ำมันและการค้าปลีก	OR			511,600.00	9,259,960.00	2.00
บมจ. ปตท.	PTT			594,000.00	19,453,500.00	4.21
บมจ. ปตท.สำรวจ และผลิตปิโตรเลียม	PTTEP			155,300.00	23,916,200.00	5.17
บมจ. ราช กรุ๊ป	RATCH			85,100.00	2,425,350.00	0.52
บมจ. ไทยออยล์	TOP			114,000.00	5,899,500.00	1.28
กลุ่มบริการ						
หมวดพาณิชย์						10.40
บมจ. คอมเซเว่น	COM7			151,700.00	2,685,090.00	0.58
บมจ. ซีพี ออลล์	CPALL			440,600.00	25,334,500.00	5.48
บมจ. ซีพี แอ็กซ์ตรา	CPAXT			117,300.00	3,372,375.00	0.73
บมจ. เซ็นทรัล รีเทล คอร์ปอเรชั่น	CRC			283,700.00	8,652,850.00	1.87
บมจ. สยามโกลบอลเฮาส์	GLOBAL			241,696.00	4,012,153.60	0.87
บมจ. โสม โปรดักส์ เซ็นเตอร์	HMPRO			426,900.00	3,970,170.00	0.86
บมจ. เมก้า ไลฟ์ไอเอ็นซี	MEGA			1,300.00	52,000.00	0.01
หมวดการแพทย์						4.53
บมจ. บางกอก เซน ฮอสปิเทล	BCH			149,100.00	2,817,990.00	0.61
บมจ. กรุงเทพดุสิตเวชการ	BDMS			623,900.00	16,845,300.00	3.64
บมจ. โรงพยาบาลจุฬารัตน์	CHG			447,000.00	1,314,180.00	0.28
หมวดสื่อและสิ่งพิมพ์						0.45
บมจ. วีจีไอ	VGI			1,387,100.00	2,080,650.00	0.45
หมวดการท่องเที่ยวและสันทนาการ						4.08
บมจ. โรงแรมเซ็นทรัลพลาซา	CENDEL			113,600.00	4,657,600.00	1.01
บมจ. ดี เอร่าวัน กรุ๊ป	ERW			446,600.00	2,116,884.00	0.46
บมจ. ไมเนอร์ อินเตอร์เนชั่นแนล	MINT			392,200.00	12,060,150.00	2.61
หมวดขนส่งและโลจิสติกส์						9.61
บมจ. ท่าอากาศยานไทย	AOT			435,000.00	28,275,000.00	6.12
บมจ. การบินกรุงเทพ	BA			128,000.00	2,560,000.00	0.55
บมจ. ทางด่วนและรถไฟฟ้ากรุงเทพ	BEM			723,100.00	5,676,335.00	1.23
บมจ. บีทีเอส กรุ๊ป โฮลดิ้งส์	BTS			653,000.00	3,134,400.00	0.68
บมจ. เคอรี่ เอ็กซ์เพรส (ประเทศไทย)	KEX			296,900.00	1,157,910.00	0.25
บมจ. พีรีเชกซ์ ชิปปิ้ง	PSL			168,600.00	1,753,440.00	0.38
บมจ. เอสซีจี เจดับเบิ้ลยูดี โลจิสติกส์	SJWD			129,400.00	1,863,360.00	0.40

กองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นแอสซ์เซ็ทไทยเพื่อความยั่งยืน

งบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน

ณ 31 พฤษภาคม 2567

การแสดงรายละเอียดเงินลงทุนใช้การจัดกลุ่มตามประเภทของเงินลงทุนและประเภทของอุตสาหกรรม

ประเภทเงินลงทุน/ผู้ออกตราสาร/ผู้ออกหลักทรัพย์	หมายเลขตราสาร	อัตรา ดอกเบี้ย (%)	วันครบอายุ	เงินต้น (บาท) / จำนวนหุ้น	มูลค่ายุติธรรม (บาท)	Unaudited ร้อยละของ มูลค่าเงิน ลงทุน
กลุ่มเทคโนโลยี						
หมวดชิ้นส่วนอิเล็กทรอนิกส์						
บมจ.ฮานา ไมโครอิเล็กทรอนิกส์	HANA			63,200.00	2,559,600.00	0.55
บมจ.เคซีอี อิเล็กทรอนิกส์	KCE			12,500.00	515,625.00	0.11
หมวดเทคโนโลยีสารสนเทศและการสื่อสาร						
บมจ.แอดวานซ์ อินโฟร์ เซอร์วิส	ADVANC			81,400.00	16,524,200.00	3.57
บมจ.อินทัช โฮลดิ้งส์	INTUCH			61,900.00	4,162,775.00	0.90
บมจ.ทรู คอร์ปอเรชั่น	TRUE			200,400.00	1,723,440.00	0.37
ใบสำคัญแสดงสิทธิ						
กลุ่มเกษตรและอุตสาหกรรมอาหาร						
หมวดอาหารและเครื่องดื่ม						
บมจ.ไทยฟู้ดส์ กรุ๊ป	TFG-W4		15 พ.ค. 2570	11,010.00	9,688.80	0.00
					462,258,522.20	100.00

กองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นแฮนด์เซ็ทไทยเพื่อความยั่งยืน

รายละเอียดการลงทุน ณ 31 พฤษภาคม 2567

	มูลค่าตามราคาตลาด	% NAV
หลักทรัพย์หรือทรัพย์สินในประเทศ	472,250,337.34	99.52
หุ้นสามัญ		
จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์		
การท่องเที่ยวและสันทนาการ	18,834,634.00	3.97
การแพทย์	20,977,470.00	4.42
ขนส่งและโลจิสติกส์	44,420,445.00	9.36
ของใช้ส่วนตัวและเวชภัณฑ์	2,890,720.00	0.61
เงินทุนและหลักทรัพย์	20,822,312.80	4.39
ชิ้นส่วนอิเล็กทรอนิกส์	3,075,225.00	0.65
เทคโนโลยีสารสนเทศและการสื่อสาร	22,410,415.00	4.72
ธนาคาร	66,258,779.00	13.96
ธุรกิจการเกษตร	2,735,240.00	0.58
ธุรกิจบริการรับเหมาก่อสร้าง	2,428,470.00	0.51
บรรจุภัณฑ์	6,556,900.00	1.38
ประกันชีวิตและประกันภัย	2,256,090.00	0.48
ปิโตรเคมีและเคมีภัณฑ์	17,253,755.00	3.64
พลังงานและสาธารณูปโภค	116,186,014.00	24.48
พัฒนาอสังหาริมทรัพย์	29,761,989.00	6.27
พาณิชย์	48,079,138.60	10.13
วัสดุก่อสร้าง	11,060,930.00	2.33
สื่อและสิ่งพิมพ์	2,080,650.00	0.44
อาหารและเครื่องดื่ม	24,154,656.00	5.09
ใบสำคัญแสดงสิทธิ		
จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์		
อาหารและเครื่องดื่ม	9,688.80	0.00
เงินฝากธนาคาร		
FITCH_TH-LONG		

กองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นแอนด์ซีทีไทยเพื่อความยั่งยืน

รายละเอียดการลงทุน ณ 31 พฤษภาคม 2567

	มูลค่าตามราคาตลาด	% NAV
Rate AAA	5,005.76	0.00
Rate BBB	9,991,809.38	2.11
อื่นๆ	2,391,215.67	0.48
ลูกหนี้	3,275,611.93	0.69
เจ้าหนี้	(495,663.07)	(0.13)
ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย	(388,733.19)	(0.08)
มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ	474,641,553.01	100.00

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)

กองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นแอสแซนด์เซ็ทไทยเพื่อความยั่งยืน

ตั้งแต่วันที่ 20 ธันวาคม 2566 ถึงวันที่ 31 พฤษภาคม 2567

ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (Fund's Direct Expenses)	จำนวนเงิน (หน่วย: พันบาท)	ร้อยละของมูลค่า ทรัพย์สิน* (ต่อปี) 1/
ค่าธรรมเนียมการจัดการ (Management Fee)	1,414.33	0.6955
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ (Trustee Fee)	51.13	0.0251
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน (Registrar Fee)	326.38	0.1605
ค่าที่ปรึกษาการลงทุน (Advisory Fee)	-	-
ค่าธรรมเนียมสอบบัญชี (Auditing Fee)	28.92	0.0142
ค่าใช้จ่ายอื่น ๆ (Others)	-	-
รวมค่าใช้จ่ายทั้งหมด 2/	1,820.76	0.8953

หมายเหตุ

1/ ค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวมข้างต้น เป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่มหรือภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว

2/ ไม่รวมค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ และค่าธรรมเนียมต่าง ๆ ที่เกิดขึ้นจากการซื้อขายหลักทรัพย์

* มูลค่าทรัพย์สิน ในที่นี้ หมายถึง มูลค่าทรัพย์สินทั้งหมด หักด้วย มูลค่าหนี้สินทั้งหมด

เว้นแต่ค่าธรรมเนียมการจัดการ ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ ค่าธรรมเนียมนายทะเบียนหน่วยลงทุน

และค่าใช้จ่ายที่เกี่ยวข้องกับการปฏิบัติการกองทุน ณ วันที่คำนวณ

ค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์
กองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นแฮนซ์เซ็ทไทยเพื่อความยั่งยืน / Krungsri Enhanced SET Thailand ESG Fund
ตั้งแต่วันที่ 20 ธันวาคม 2566 ถึงวันที่ 31 พฤษภาคม 2567

บริษัท	จำนวนเงิน (บาท)	อัตราส่วน (%)
บมจ.หลักทรัพย์ เคจีไอ (ประเทศไทย) / KGI Securities (Thailand) Plc.	282,398.69	68.72
บมจ.หลักทรัพย์ กรุงศรี / Krungsri Securities Plc.	31,162.60	7.58
บมจ.หลักทรัพย์ กสิกรไทย / Kasikorn Securities Plc.	17,768.30	4.32
บจ.หลักทรัพย์ ซีจีเอส อินเตอร์เนชั่นแนล (ประเทศไทย) / CGS International Securities (Thailand) Co.,Ltd.	15,071.35	3.67
บมจ.หลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส / Finansia Syrus Securities Plc.	13,132.50	3.20
บจ.หลักทรัพย์ ทิสโก้ / Tisco Securities Co.,Ltd.	8,191.71	1.99
บจ.หลักทรัพย์ กรุงไทย เอ็กซ์สปริง จำกัด / Krungthai XSpring Securities Co.,Ltd.	7,632.88	1.86
บมจ.หลักทรัพย์ เกียรตินาคินภัทร / Kiatnakin Phatra Securities Plc.	7,593.47	1.85
บจ.หลักทรัพย์ อินโนเวสต์ เอกซ์ / InnovestX Securities Co., Ltd.	5,863.60	1.43
บจ.หลักทรัพย์ ซิตีคอร์ป (ประเทศไทย) / Citicorp Securities (Thailand) Ltd.	5,780.40	1.41
อื่นๆ / Other	16,353.83	3.98
รวม / Total	410,949.33	100.00

ผลการดำเนินงานของกองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นแอสส์เซ็ทไทยเพื่อความยั่งยืน-ไทยเพื่อความยั่งยืนสะสมมูลค่า

ผลการดำเนินงาน สิ้นสุด ณ วันที่ 31 พฤษภาคม 2567	% ตามช่วงเวลา			% ต่อปี				นับจากวันเริ่ม โครงการ (20 ธันวาคม 2566)
	Year to Date	ย้อนหลัง 3 เดือน	ย้อนหลัง 6 เดือน	ย้อนหลัง 1 ปี	ย้อนหลัง 3 ปี	ย้อนหลัง 5 ปี	ย้อนหลัง 10 ปี	
KFTHAIESGA	-3.85%	-0.95%	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	-3.39%
ดัชนีชี้วัด (Benchmark)*	-3.78%	-0.91%	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	-2.35%
ความผันผวนของผลการดำเนินงาน	+11.04%	+10.82%	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	+10.73%
ความผันผวนของดัชนีชี้วัด	+10.61%	+10.40%	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	+10.36%

หมายเหตุ : * ดัชนีชี้วัด (Benchmark) คือ

ดัชนีผลตอบแทนรวม SET ESG (SET ESG TRI) สัดส่วน 100.00%

(เป็นดัชนีที่สะท้อนการลงทุนในหลักทรัพย์ของบริษัทที่มีการดำเนินธุรกิจอย่างยั่งยืน คำนึงถึงปัจจัยทางด้าน ESG โดยสามารถศึกษาข้อมูลได้ที่

<https://www.set.or.th/th/market/index/setesg/profile>)

** ผลตอบแทนที่มีอายุเกินหนึ่งปีจะแสดงเป็นผลตอบแทนต่อปี

เอกสารการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวมฉบับนี้ ได้จัดทำตามมาตรฐานการวัดผลดำเนินงานของ
กองทุนรวมของสมาคมบริษัทจัดการลงทุน

ผลการดำเนินงานของกองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นแอสส์เซ็ทไทยเพื่อความยั่งยืน-ไทยเพื่อความยั่งยืนปันผล

ผลการดำเนินงาน สิ้นสุด ณ วันที่ 31 พฤษภาคม 2567	% ตามช่วงเวลา			% ต่อปี				นับจากวันเริ่ม โครงการ (20 ธันวาคม 2566)
	Year to Date	ย้อนหลัง 3 เดือน	ย้อนหลัง 6 เดือน	ย้อนหลัง 1 ปี	ย้อนหลัง 3 ปี	ย้อนหลัง 5 ปี	ย้อนหลัง 10 ปี	
KFTHAIESGD	-3.85%	-0.95%	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	-3.39%
ดัชนีชี้วัด (Benchmark)*	-3.78%	-0.91%	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	-2.35%
ความผันผวนของผลการดำเนินงาน	+11.04%	+10.82%	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	+10.73%
ความผันผวนของดัชนีชี้วัด	+10.61%	+10.40%	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	+10.36%

หมายเหตุ : * ดัชนีชี้วัด (Benchmark) คือ

ดัชนีผลตอบแทนรวม SET ESG (SET ESG TRI) สัดส่วน 100.00%

(เป็นดัชนีที่สะท้อนการลงทุนในหลักทรัพย์ของบริษัทที่มีการดำเนินธุรกิจอย่างยั่งยืน คำนึงถึงปัจจัยทางด้าน ESG โดยสามารถศึกษาข้อมูลได้ที่

<https://www.set.or.th/th/market/index/setesg/profile>)

** ผลตอบแทนที่มีอายุเกินหนึ่งปีจะแสดงเป็นผลตอบแทนต่อปี

เอกสารการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวมฉบับนี้ ได้จัดทำตามมาตรฐานการวัดผลดำเนินงานของ
กองทุนรวมของสมาคมบริษัทจัดการลงทุน

ข้อมูลอื่นๆ ที่ผู้ถือหุ้นวงลงทุนควรทราบ

(1) รายงานบุคคลที่เกี่ยวข้องที่มีการทำธุรกรรมในรอบเวลาที่ผ่านมา (วันที่ 20 ธันวาคม 2566 ถึงวันที่ 31 พฤษภาคม 2567)

ชื่อกองทุน	รายชื่อบุคคลที่เกี่ยวข้อง
กองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นแอสแซ่ท์ไทยเพื่อความยั่งยืน	<ol style="list-style-type: none"> 1. บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด 2. บริษัทหลักทรัพย์ กรุงศรี พัฒนสิน จำกัด (มหาชน) 3. บริษัทหลักทรัพย์ กรุงศรี จำกัด (มหาชน) 4. กองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นแอสแซ่ท์ 50 5. กองทุนเปิดกรุงศรีหุ้นระยะยาว SET50 LTF 6. กองทุนเปิดกรุงศรี SET100 7. กองทุนเปิดกรุงศรี SET100 เพื่อการเลี้ยงชีพ 8. กองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นใจ 9. กองทุนสำรองเลี้ยงชีพ เซ็นทรัลพัฒนา ซึ่งจดทะเบียนแล้ว

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

(2) การรับผลประโยชน์ตอบแทนเนื่องจากการที่กองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นแอสแซ่ท์ไทยเพื่อความยั่งยืน ใช้บริการบุคคลอื่น (soft commission)

บริษัทที่ให้ผลประโยชน์	ผลประโยชน์ที่ได้รับ	เหตุผลในการรับผลประโยชน์
1. บริษัทหลักทรัพย์ เกียรตินาคินภัทร จำกัด (มหาชน)	ข่าวสารและบทวิเคราะห์ต่างๆ	เพื่อประโยชน์ของกองทุน
2. บริษัทหลักทรัพย์ เคจีไอ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)	ข่าวสารและบทวิเคราะห์ต่างๆ	เพื่อประโยชน์ของกองทุน
3. บริษัทหลักทรัพย์ เมย์แบงก์ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)	ข่าวสารและบทวิเคราะห์ต่างๆ	เพื่อประโยชน์ของกองทุน
4. บริษัทหลักทรัพย์ เอเชีย พลัส จำกัด (มหาชน)	ข่าวสารและบทวิเคราะห์ต่างๆ	เพื่อประโยชน์ของกองทุน
5. บริษัทหลักทรัพย์ กรุงไทย เอ็กซ์สปริง จำกัด	ข่าวสารและบทวิเคราะห์ต่างๆ	เพื่อประโยชน์ของกองทุน
6. บริษัทหลักทรัพย์ กรุงศรี จำกัด (มหาชน)	ข่าวสารและบทวิเคราะห์ต่างๆ	เพื่อประโยชน์ของกองทุน
7. บริษัทหลักทรัพย์ กลิกรไทย จำกัด (มหาชน)	ข่าวสารและบทวิเคราะห์ต่างๆ	เพื่อประโยชน์ของกองทุน
8. บริษัทหลักทรัพย์ ซีทีคอร์ป (ประเทศไทย) จำกัด	ข่าวสารและบทวิเคราะห์ต่างๆ	เพื่อประโยชน์ของกองทุน
9. บริษัทหลักทรัพย์ ซี แอล เอส เอ (ประเทศไทย) จำกัด	ข่าวสารและบทวิเคราะห์ต่างๆ	เพื่อประโยชน์ของกองทุน
10. บริษัทหลักทรัพย์ ซีจีเอส อินเตอร์เนชั่นแนล (ประเทศไทย) จำกัด	ข่าวสารและบทวิเคราะห์ต่างๆ	เพื่อประโยชน์ของกองทุน
11. บริษัทหลักทรัพย์ คาโอ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)	ข่าวสารและบทวิเคราะห์ต่างๆ	เพื่อประโยชน์ของกองทุน
12. บริษัทหลักทรัพย์ ดีบีเอส วิคเคอร์ส (ประเทศไทย) จำกัด	ข่าวสารและบทวิเคราะห์ต่างๆ	เพื่อประโยชน์ของกองทุน
13. บริษัทหลักทรัพย์ ทรินิตี้ จำกัด	ข่าวสารและบทวิเคราะห์ต่างๆ	เพื่อประโยชน์ของกองทุน
14. บริษัทหลักทรัพย์ ทิสโก้ จำกัด	ข่าวสารและบทวิเคราะห์ต่างๆ	เพื่อประโยชน์ของกองทุน
15. บริษัทหลักทรัพย์ ธนชาติ จำกัด (มหาชน)	ข่าวสารและบทวิเคราะห์ต่างๆ	เพื่อประโยชน์ของกองทุน
16. บริษัทหลักทรัพย์ บัวหลวง จำกัด (มหาชน)	ข่าวสารและบทวิเคราะห์ต่างๆ	เพื่อประโยชน์ของกองทุน
17. บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)	ข่าวสารและบทวิเคราะห์ต่างๆ	เพื่อประโยชน์ของกองทุน
18. บริษัทหลักทรัพย์ ฟิลลิป (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)	ข่าวสารและบทวิเคราะห์ต่างๆ	เพื่อประโยชน์ของกองทุน
19. บริษัทหลักทรัพย์ ยูโอบี เคย์เฮียน (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)	ข่าวสารและบทวิเคราะห์ต่างๆ	เพื่อประโยชน์ของกองทุน
20. บริษัทหลักทรัพย์ ยูบีเอส (ประเทศไทย) จำกัด	ข่าวสารและบทวิเคราะห์ต่างๆ	เพื่อประโยชน์ของกองทุน
21. บริษัทหลักทรัพย์ อินโนเวสต์ เอกซ์ จำกัด	ข่าวสารและบทวิเคราะห์ต่างๆ	เพื่อประโยชน์ของกองทุน

(3) รายชื่อผู้จัดการกองทุน ณ วันที่ 31 พฤษภาคม 2567

1. นายชาติ โขลกทวิพัฒน์
2. นายสาธิต บัวชู
3. นางสาวสาวินี สุขศรีวงศ์
4. นายปิติ ประดิพัทธ์พงษ์
5. นายกวิพ เจริญเสาวภาคย์
6. นายเอกชัย บุญยะพงค์ไชย

(4) การเปิดเผยข้อมูลการถือหน่วยลงทุนเกิน 1 ใน 3 ณ วันที่ 31 พฤษภาคม 2567

ไม่มีการถือหน่วยลงทุนเกิน 1 ใน 3 ของบุคคลใดบุคคลหนึ่ง

ผู้ถือหน่วยลงทุนสามารถตรวจสอบข้อมูลสัดส่วนการถือหน่วยลงทุนโดยตรงได้ที่ www.krungsriasset.com

(5) อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุนของกองทุน (portfolio turnover ratio) ในรอบระยะเวลาที่ผ่านมา

- KFTHAIESGA (portfolio turnover ratio) เท่ากับ 11.30%
- KFTHAIESGD (portfolio turnover ratio) เท่ากับ 11.30%

รายงานการบริหารจัดการกองทุนรวมเพื่อความยั่งยืน

1. ถ้อยคำรับรองว่า บลจ.มีการบริหารจัดการกองทุนที่สอดคล้องกับการมุ่งความยั่งยืนตามหลักสากล

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด ขอรับรองว่าบลจ. มีการบริหารจัดการกองทุนที่สอดคล้องกับการมุ่งความยั่งยืนตามหลักสากล โดยบลจ. ได้ประกาศรับการปฏิบัติตามหลักธรรมาภิบาลการลงทุน เมื่อวันที่ 29 มิถุนายน 2560 และได้กำหนดนโยบายธรรมาภิบาลการลงทุน (Investment Governance Policy: I-Code) เพื่อเป็นหลักปฏิบัติสำหรับการลงทุน ภายใต้แนวคิดว่าการลงทุนในกิจการที่มีกลยุทธ์การกำกับดูแลที่ดี และมีความรับผิดชอบต่อสังคมและสิ่งแวดล้อม จะนำมาซึ่งผลตอบแทนที่ดีและยั่งยืนของลูกค้าและ/หรือผู้ถือหุ้นรายลงทุน โดยยึดประโยชน์ที่ดีที่สุดของผู้ลงทุน (Investor's First) เป็นสำคัญ

2. รายงานเกี่ยวกับการจัดการกองทุนโดยมุ่งความยั่งยืนตามหลักสากล

2.1 ปัญหาหรือเหตุการณ์ร้ายแรงที่เกิดขึ้น และการเปลี่ยนแปลงการลงทุนในทรัพย์สินที่ได้ลงทุนไปแล้ว

บลจ. ได้ติดตามข่าวสารเกี่ยวกับกิจการที่ลงทุนอย่างสม่ำเสมอ กรณีที่พบว่า มีประเด็นน่าสงสัยด้านหลักการกำกับดูแลกิจการที่ดี หรือมีประเด็นเกี่ยวกับความรับผิดชอบต่อสังคมและสิ่งแวดล้อม ทีมจัดการลงทุนได้ติดตามสถานการณ์ รวมถึงสอบถามไปยังกิจการที่ลงทุนอยู่ เพื่อขอรับคำชี้แจงถึงประเด็นดังกล่าว รวมถึงแนวทางการแก้ไขและป้องกันการเกิดปัญหาซ้ำๆ ทั้งนี้ ในรอบ 6 เดือนที่ผ่านมา บลจ. ไม่พบปัญหาหรือเหตุการณ์ร้ายแรงเกิดขึ้น

2.2 ลักษณะเหตุผล และ ความจำเป็นในการพบปะผู้บริหารของกิจการ หรือผู้ออกตราสารที่กองทุนรวมเพื่อความยั่งยืนไปลงทุน รวมถึงผลจากการพบปะดังกล่าว

ในรอบ 6 เดือนที่ผ่านมา บลจ. พบว่าบางกิจการมีประเด็นน่าสงสัยด้านสังคม สิ่งแวดล้อม และการกำกับดูแลกิจการที่ดี บลจ. จึงได้เข้าพบปะผู้บริหารของกิจการ และสอบถามเกี่ยวกับประเด็นน่าสงสัยดังกล่าว โดยกิจการที่มีประเด็นน่าสงสัยดังกล่าว ได้ให้ความร่วมมือในการชี้แจงปัญหาที่เกิดขึ้นและมีแนวทางในการแก้ไขเพื่อลดผลกระทบต่อกิจการของบริษัท และผู้มีส่วนได้เสียที่เกี่ยวข้อง รวมถึงการป้องกันการเกิดปัญหาซ้ำๆ เป็นอย่างดี ส่งผลให้บลจ. มีความเชื่อมั่นว่ากิจการที่บลจ. ลงทุนอยู่ยังคงมีความยั่งยืนตามหลักสากล

2.3 ความเสี่ยงที่เกี่ยวข้องกับความยั่งยืน และการนำปัจจัยความเสี่ยงดังกล่าวมาประกอบการตัดสินใจลงทุน

บลจ. ให้ความสำคัญในการนำปัจจัยความเสี่ยงที่เกี่ยวข้องกับการกำกับดูแลกิจการที่ดี และความรับผิดชอบต่อสังคมและสิ่งแวดล้อมมาเป็นส่วนหนึ่งในการวิเคราะห์ข้อมูลเพื่อการพิจารณาตัดสินใจลงทุน โดยบริษัทได้จัดทำมีนโยบายการพิจารณาปัจจัยด้าน สิ่งแวดล้อม สังคม และธรรมาภิบาลในการลงทุน (ESG Policy) เพื่อนำมาเป็นกรอบและแนวทางในการพิจารณาลงทุน และ บลจ. ยังได้จัดให้มีกระบวนการในการติดตามการดำเนินงานและผลประกอบการของกิจการที่ลงทุนอย่างใกล้ชิดและสม่ำเสมอ เพื่อให้มั่นใจว่า กลยุทธ์การบริหารจัดการของกิจการที่ลงทุนสามารถนำไปสู่ผลที่ต้องการ

และได้ปฏิบัติให้เป็นไปตามหลักการดำเนินธุรกิจอย่างมีบรรษัทภิบาลด้วยความรับผิดชอบต่อสังคมและสิ่งแวดล้อม โดยที่ผู้จัดการลงทุนยึดมั่นตามแนวปฏิบัติของบลจ. คือ มีการติดตามกิจการที่ลงทุนอย่างใกล้ชิด ซึ่งที่ผู้จัดการลงทุนได้ เข้าพบผู้บริหารของบริษัทจดทะเบียนฯ โดยเน้นเข้าร่วมประชุมทั้งที่บริษัท และผ่านสื่ออิเล็กทรอนิกส์ (Conference Call) ตลอดจนการทบทวนกิจการที่ลงทุนอย่างสม่ำเสมอ

นอกจากนี้ บลจ. ได้นำส่งแบบสอบถามด้าน ESG (ESG Questionnaires) ไปยังทุกกิจการภายใต้ Universe การลงทุน โดยที่ผู้จัดการลงทุนได้ใช้ข้อมูลจาก ESG Questionnaires เป็นส่วนหนึ่งในการพิจารณาให้คะแนนด้าน ESG และเป็น ข้อมูลประกอบในการเข้าพบกับกิจการที่ลงทุน ทั้งนี้ บลจ. ได้พิจารณาถึงข้อมูลต่างๆ ทั้งผลประกอบการของกิจการที่ ลงทุน คุณภาพของการรายงานและการเปิดเผยข้อมูล การประชุมผู้ถือหุ้น และข้อมูลข่าวสารที่เกี่ยวข้องของกิจการที่ลงทุน เพื่อให้การติดตามทันต่อเหตุการณ์ ในกรณี หากมีเหตุการณ์ที่อาจจะมีผลกระทบต่อการดำเนินงานของกิจการที่ลงทุน หรือมีข้อกังวล หรือพบว่ากิจการที่ลงทุนไม่ปฏิบัติตามหลักการกำกับดูแลกิจการที่ดี หรือมีประเด็นเกี่ยวกับความ รับผิดชอบต่อสังคม และสิ่งแวดล้อม บลจ. ได้นำมาเป็นปัจจัยในการพิจารณาเกี่ยวกับการลงทุนในกิจการนั้นๆ

2.4 ผลจากการบริหารจัดการลงทุนอย่างยั่งยืน

บลจ. มีความเชื่อมั่นว่าการดำเนินการตามหลักการบริหารการลงทุนอย่างยั่งยืน ภายใต้แนวคิดที่ว่า การลงทุนในกิจการที่ มีกลยุทธ์การกำกับดูแลที่ดี และมีความรับผิดชอบต่อสังคมและสิ่งแวดล้อม จะนำมาซึ่งผลตอบแทนที่ดีและยั่งยืน แก่ผู้ลงทุน และมั่นใจได้ว่ากิจการที่บลจ. ลงทุนอยู่มีความยั่งยืนตามหลักสากล