



krungsri

Asset  
Management

Make Life  
Simple

A member of  MUFJ  
a global financial group

# รายงานประจำครึ่งปีแรก 2566

รอบระยะเวลาตั้งแต่วันที่ 1 มิถุนายน 2566 – 30 พฤศจิกายน 2566

กองทุนรวม

KFYENJAI

กองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นใจ

Krungsri Yenjai Fund

กองทุนนี้มีการแบ่งชนิดหน่วยลงทุนเป็น 3 ชนิด ได้แก่

1. หน่วยลงทุนชนิดสะสมมูลค่า :  
กองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นใจ-สะสมมูลค่า (KFYENJAI-A)
2. หน่วยลงทุนชนิดผู้ลงทุนสถาบัน :  
กองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นใจ-ผู้ลงทุนสถาบัน (KFYENJAI-I)  
(บริษัทจัดการยังไม่เปิดขายหน่วยลงทุนชนิดนี้)
3. หน่วยลงทุนชนิดจ่ายเงินปันผล :  
กองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นใจ-ปันผล (KFYENJAI-D)  
(บริษัทจัดการยังไม่เปิดขายหน่วยลงทุนชนิดนี้)

**Krungsri Asset Management Co., Ltd.**  
1<sup>st</sup>-2<sup>nd</sup> Zone A, 12<sup>th</sup>, 18<sup>th</sup> Zone B Floor,  
Ploenchit Tower, 898 Ploenchit Road,  
Bangkok 10330 Thailand  
T +66 (0) 2657 5757 F +66 (0) 2657 5777  
[www.krungsriasset.com](http://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](http://www.krungsriasset.com)

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด

## รายงานประจำปีแรก 2566

### กองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นใจ

- สารบัญผู้จัดการ 3
- รายงานผู้ดูแลผลประโยชน์ 6
- งบแสดงฐานะการเงิน งบกำไรขาดทุนเบ็ดเสร็จ และงบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน 7
- รายละเอียดเงินลงทุน การกู้ยืมเงิน และการก่อภาระผูกพันของกองทุนรวม 13
- ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม 19
- คำนายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ 20
- ผลการดำเนินงาน 21
- ข้อมูลอื่นๆ ที่ผู้ถือหน่วยลงทุนควรทราบ 22
  - รายงานบุคคลที่เกี่ยวข้องที่มีการทำธุรกรรมในรอบเวลาที่ผ่านมา
  - การรับผลประโยชน์ตอบแทนเนื่องจากการใช้บริการบุคคลอื่นๆ
  - รายชื่อผู้จัดการกองทุน
  - การเปิดเผยข้อมูลการถือหน่วยลงทุนเกิน 1 ใน 3
  - อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุนของกองทุน

## สารบริษัทจัดการ

เรียน ผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุน

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด (บริษัทฯ) ขอนำเสนอรายงานสำหรับรอบระยะเวลา 6 เดือน ของกองทุนเปิดกรุงศรีเย็นใจ (KFYENJAI) ตั้งแต่วันที่ 1 มิถุนายน 2566 ถึงวันที่ 30 พฤศจิกายน 2566 มายังผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุน โดยมีรายละเอียดดังนี้

### ผลการดำเนินงาน

กองทุนเปิดกรุงศรีเย็นใจ มีมูลค่าทรัพย์สินสุทธิ ณ วันที่ 30 พฤศจิกายน 2566 เท่ากับ 1,421.05 ล้านบาท คิดเป็นมูลค่าทรัพย์สินสุทธิต่อหน่วยลงทุนเท่ากับ 10.0129 บาท โดยมีผลการดำเนินงานย้อนหลัง 6 เดือน ลดลงร้อยละ 0.18 ลดลงน้อยกว่าเกณฑ์มาตรฐานการวัดผลการดำเนินงาน ที่ลดลงร้อยละ 0.29

### - การลงทุนในตราสารหนี้ -

#### ภาวะการลงทุนในช่วงที่ผ่านมา

**ไตรมาสที่ 2 ปี 2566** อัตราผลตอบแทนของพันธบัตรรัฐบาลไทยปรับตัวเพิ่มขึ้นร้อยละ +0.12 ถึง +0.38 ในลักษณะที่ส่งผลให้สิ้นอัตราผลตอบแทนปรับตัวเบนราบบลง โดยเป็นการเคลื่อนไหวตามการปรับเพิ่มขึ้นของอัตราดอกเบี้ยนโยบายในอัตราร้อยละ +0.25 ในการประชุมคณะกรรมการนโยบายการเงิน (กนง.) เมื่อวันที่ 31 พฤษภาคม 2566 นอกจากนี้อัตราผลตอบแทนยังได้รับแรงกดดันจากมุมมองของกนง.ต่อเศรษฐกิจไทยที่เป็นบวก และความเสี่ยงทางด้านสูงของอัตราเงินเฟ้อจากเศรษฐกิจที่ขยายตัวอย่างต่อเนื่องและการส่งผ่านต้นทุน เช่นเดียวกับอัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลสหรัฐฯซึ่งปรับตัวเพิ่มขึ้นร้อยละ +0.21 ถึง +0.87 ในลักษณะที่ทำให้สิ้นอัตราผลตอบแทนปรับตัวเบนราบบลง ตามการปรับเพิ่มขึ้นของ Fed Fund Rate และมุมมองของคณะกรรมการของธนาคารกลางสหรัฐฯ (Fed) ส่วนใหญ่ที่ยังเห็นควรให้มีการปรับขึ้นอัตราดอกเบี้ยอีกอย่างน้อย 2 ครั้งในปี นี้ จากเงินเฟ้อที่ยังอยู่ในระดับสูงกว่าเป้าหมายและตลาดแรงงานที่แข็งแกร่ง

สำหรับภาวะเศรษฐกิจไทยในไตรมาสที่ 3 ปี 2566 บลจ.คาดว่าธนาคารแห่งประเทศไทย (ธปท.) จะปรับขึ้นอัตราดอกเบี้ยนโยบายอย่างต่อเนื่องตามการฟื้นตัวของเศรษฐกิจและเพื่อเพิ่มขีดความสามารถในการดำเนินนโยบายการเงินในอนาคต ทำให้คาดการณ์อัตราดอกเบี้ยนโยบายสำหรับสิ้นปี 2566 อยู่ในช่วง 2.25% - 2.50% นอกจากนี้คาดว่าอัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลไทยจะยังคงเผชิญความผันผวนจากความไม่แน่นอนเกี่ยวกับทิศทางนโยบายทางการเงินทั้งภายในและภายนอกประเทศ โดยมีปัจจัยสำคัญที่ต้องติดตาม ได้แก่ แนวโน้มอัตราเงินเฟ้อ สถานการณ์ในภาคธนาคารในสหรัฐฯ และยุโรป การฟื้นตัวของเศรษฐกิจภายในประเทศโดยเฉพาะในภาคการท่องเที่ยวและบริการ กระแสของเงินทุนไหลเข้า-ออกจากต่างประเทศ รวมไปถึงความเสี่ยงทางด้านภูมิรัฐศาสตร์

**ไตรมาสที่ 3 ปี 2566** อัตราผลตอบแทนของพันธบัตรรัฐบาลไทยตั้งแต่ 1 ปีลงมาปรับตัวเพิ่มขึ้นร้อยละ +0.42 ถึง +0.46 และอัตราผลตอบแทนอายุมากกว่า 1 ปีปรับตัวเพิ่มขึ้นร้อยละ +0.39 ถึง +0.66 โดยที่อัตราผลตอบแทนในช่วงอายุ 5 - 20 ปี ปรับตัวขึ้นมากที่สุด โดยเป็นการเคลื่อนไหวตามการปรับเพิ่มขึ้นของอัตราดอกเบี้ยนโยบายในอัตราร้อยละ +0.25 รวม 2 ครั้งในการประชุมคณะกรรมการนโยบายการเงิน (กนง.) เมื่อวันที่ 2 สิงหาคม และวันที่ 27 กันยายน 2566 นอกจากนี้อัตราผลตอบแทนยังได้รับแรงกดดันจากความกังวลเกี่ยวกับอุปทานของพันธบัตรรัฐบาลในปีงบประมาณ 2567 ที่สูงขึ้น รวมไปถึงการปรับเพิ่มขึ้นอย่างมีนัยสำคัญของอัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลสหรัฐฯซึ่งปรับตัวเพิ่มขึ้นร้อยละ +0.05 ถึง +0.84 หลังจากที่ว่าธนาคารกลางสหรัฐฯ (Fed) มีมติปรับขึ้นอัตราดอกเบี้ยระยะสั้น 0.25% สู่ระดับ 5.25 - 5.50% ในการประชุมวันที่ 25 - 26 กรกฎาคม 2566 และต่อมาในการประชุมวันที่ 19 - 20 กันยายน 2566 Fed ส่งสัญญาณปรับขึ้นอัตราดอกเบี้ยอีก 0.25% สู่กรอบ 5.50% - 5.75% ภายในปีนี้ จากมุมมองต่อการขยายตัวของเศรษฐกิจที่เป็นบวกกว่าที่คาดและเงินเฟ้อที่ยังอยู่ในระดับสูงกว่าเป้าหมาย

สำหรับภาวะเศรษฐกิจไทยในไตรมาสที่ 4 ปี 2566 คาดว่าอัตราดอกเบี้ยนโยบายจะทรงตัวที่ระดับ 2.50% จนถึงสิ้นปี 2566 จากการที่ธนาคารแห่งประเทศไทย (ธปท.) ระบุในรายงานการประชุมครั้งล่าสุดว่าอัตราดอกเบี้ยในปัจจุบันอยู่ในระดับที่เหมาะสมกับการขยายตัวของเศรษฐกิจอย่างมีเสถียรภาพในระยะยาว อย่างไรก็ตามอัตราผลตอบแทนอาจเผชิญความผันผวนจากความกังวลทางด้านอุปทานและเงินเฟ้อที่อาจได้รับแรงส่งเพิ่มเติมจากนโยบายภาครัฐ รวมไปถึงการเคลื่อนไหวของอัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลสหรัฐฯ โดยมีปัจจัยสำคัญที่ต้องติดตาม ได้แก่ การฟื้นตัวของเศรษฐกิจภายในประเทศ แนวโน้มอัตราเงินเฟ้อ กระแสของเงินทุนไหลเข้า-ออกจากต่างประเทศ รวมไปถึงความเสี่ยงทางด้านภูมิรัฐศาสตร์

## แนวโน้มการลงทุน

บริษัทฯ คงมุมมองต่อตลาดตราสารหนี้ที่ระดับ “เป็นกลาง, Neutral” ทั้งนี้ภายหลังจากที่การปรับขึ้นอัตราดอกเบี้ยนโยบายของทั้งสหรัฐฯ และของไทยมาอย่างต่อเนื่องในช่วงระยะเวลากว่า 1 ปีที่ผ่านมา น่าจะถึงจุดสิ้นสุดของขาขึ้นในรอบนี้ อีกทั้งในปีถัดไปมีแนวโน้มที่ Fed จะปรับลดอัตราดอกเบี้ยลงประมาณ 0.75% หากแต่อัตราดอกเบี้ยนโยบายจะยังคงระดับอัตราดอกเบี้ยสูงอยู่ในปีหน้า ในขณะที่อัตราดอกเบี้ยนโยบายของไทยที่ระดับปัจจุบัน 2.50% คาดว่าได้จบวัฏจักรอัตราดอกเบี้ยขาขึ้นในรอบนี้แล้ว ทั้งนี้อาจมีเพียงความไม่แน่นอนจากผลกระทบด้านนโยบายภาครัฐในอนาคตที่อาจส่งผลกระทบต่อแนวโน้มเงินเฟ้อให้มีความเสี่ยงด้านสูงเหลืออยู่บ้าง ดังนั้นคาดว่าตลาดตราสารหนี้จะยังคงมีความผันผวนอยู่บ้างต่อไปอีกระยะหนึ่ง สำหรับกลยุทธ์การลงทุนในลำดับถัดไป บริษัทฯ จะคงอายุคงเหลือเฉลี่ยของกองทุนอยู่ในระดับปานกลาง และจะปรับการลงทุนเชิงรุกแบบระมัดระวังอย่างค่อยเป็นค่อยไป หากอัตราผลตอบแทนพันธบัตรระยะกลางถึงระยะยาวปรับเพิ่มสูงขึ้น สำหรับตลาดตราสารหนี้ภาคเอกชนไทยยังคงมีอัตราผลตอบแทนที่น่าสนใจ ทำให้กองทุนที่มีการลงทุนในหุ้นกู้เอกชนสามารถช่วยลดความผันผวนของตลาดลงได้บ้าง

### - การลงทุนในตราสารทุน -

#### ภาวะการลงทุนในช่วงที่ผ่านมา

ในรอบครึ่งปีบัญชีที่ผ่านมา กองทุนยังคงเน้นลงทุนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (ตลาดหลักทรัพย์ฯ) เป็นหลัก ดัชนีผลตอบแทนรวมตลาดหลักทรัพย์ฯ ปรับตัวอยู่ระหว่าง 1,366.19 – 1,579.43 จุด ก่อนปิดที่ 1,380.18 จุด ณ วันที่ 30 พฤศจิกายน 2566 โดยในช่วงเวลาดังกล่าว ดัชนีปรับตัวลดลงร้อยละ 9.09

ในเดือนมิถุนายน 2566 ดัชนีอยู่ในทิศทางปรับตัวลดลงตลอดทั้งเดือนโดยปรับตัวลดลงต่ำกว่าแนวรับหลัก ในสัปดาห์สุดท้ายของเดือนก่อนที่จะปิดสิ้นเดือนอยู่ในระดับเหนือกว่าแนวรับหลักเล็กน้อย การเมืองภายในประเทศยังเป็นปัจจัยในการชี้นำทิศทางของตลาดอีกครั้งเนื่องจากคณะกรรมการการเลือกตั้งประจำการรับรองผลผู้ชนะในการเลือกตั้งสภาผู้แทนราษฎรทั้งหมด 500 คน ในขณะที่การลงมติเลือกประธานสภาผู้แทนราษฎรท่านใหม่จะจัดขึ้นในวันที่ 4 กรกฎาคม 2566 ข่าวก่อการก่อการก่อการในการจัดตั้งรัฐบาลของพรรคร่วมสร้างความสับสนต่อตลาดโดยรวม ในขณะที่ปัจจัยพื้นฐานเช่นผลกำไรสุทธิต่อหุ้น (EPS) ของดัชนีผลตอบแทนรวมตลาดหลักทรัพย์ฯ ถูกปรับลดลงอย่างต่อเนื่อง นอกจากนี้ Delta Electronics (DELTA) หุ้นที่มีมูลค่าขนาดใหญ่ที่สุดในดัชนีถูกขึ้นเครื่องหมายเตือนนักลงทุนในการซื้อขายอีกครั้ง

ในเดือนกรกฎาคม 2566 ดัชนีปรับตัวเพิ่มขึ้น บรรยายภาพการลงทุนในตลาดโลกเป็นบวกตลอดเดือนกรกฎาคม เนื่องจากนักลงทุนคาดการณ์การปรับตัวถึงจุดสูงสุดของรอบวัฏจักรการขึ้นอัตราดอกเบี้ย แรงสนับสนุนมาจากการปรับตัวลดลงของอัตราเงินเฟ้อในสหรัฐฯ และสหราชอาณาจักร และการปรับขึ้นอัตราดอกเบี้ยเพียงเล็กน้อยจาก Fed ธนาคารกลางยุโรป (ECB) และธนาคารกลางญี่ปุ่น (BoJ) สำหรับปัจจัยภายในประเทศ การจัดตั้งรัฐบาลกำลังดำเนินต่อไป ความชัดเจนในการจัดตั้งรัฐบาลและการออกมาตราการทางเศรษฐกิจจะเป็นปัจจัยบวกต่อตลาด

ในเดือนสิงหาคม 2566 ดัชนีปรับตัวเพิ่มขึ้นอย่างต่อเนื่อง โดยเดือนสิงหาคมนี้เริ่มต้นขึ้นด้วยปัจจัยลบจากการที่ Moody's และ S&P Global Ratings ปรับลดอันดับเครดิตของธนาคารระดับภูมิภาคในสหรัฐฯ ในขณะที่ Fitch ปรับลดอันดับความน่าเชื่อถือของสหรัฐฯ จาก AAA เป็น AA+ นอกจากนี้การเมืองภายในประเทศก็เป็นปัจจัยลบเช่นกันจากการเลื่อนวันลงมติเลือกนายกรัฐมนตรีในวันที่ 4 สิงหาคม ดัชนีปรับตัวลดลงสู่จุดต่ำสุด ในช่วงต่อมาสมาชิกวุฒิสภาลงมติเลือกนายเศรษฐา ทวีสิน เป็นนายกรัฐมนตรีคนที่ 30 ในวันที่ 22 สิงหาคม ตามด้วยการจัดวางตำแหน่งคณะรัฐมนตรีในรัฐบาลเสร็จสิ้นก่อนช่วงปลายเดือน ตลาดตอบสนองในเชิงบวก นักลงทุนมีมุมมองเชิงบวกต่อนโยบายการแจกเงินดิจิทัลจำนวน 10,000 บาท ในขณะที่หมวดการท่องเที่ยวได้รับแรงส่งจากนโยบายการยกเว้นวีซ่า

ในเดือนกันยายน 2566 ดัชนีสูญเสียแรงส่งและปรับตัวลดลงต่ำกว่าแนวรับทางจิตวิทยาที่ 1,500 จุด ความกังวลเกี่ยวกับสถานการณ์ในตลาดโลกและภายในประเทศเป็นแรงกดดันต่อดัชนีตลอดทั้งเดือน รัฐบาลออกมาตรการจำนวนมากในความพยายามที่จะปรับลดราคาค่าไฟฟ้าและเชื้อเพลิง ส่งผลให้เกิดแรงเทขายขายในหมวดพลังงาน การปรับตัวเพิ่มขึ้นของอัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลสหรัฐฯ อายุ 10 ปีเป็นแรงกดดันต่อค่าเงินบาท ส่งผลให้ค่าเงินบาทปรับตัวอ่อนค่าสู่ระดับต่ำที่สุดในรอบ 11 เดือน นักลงทุนมีความกังวลว่านโยบายแจกเงินดิจิทัลจำนวน 10,000 บาทจะเป็นแรงกดดันเพิ่มเติมต่อหนี้สาธารณะต่อจีดีพี

ในเดือนตุลาคม 2566 ดัชนีปรับตัวลดลงต่อเนื่องและเป็นระดับต่ำที่สุดรายเดือนนับจากต้นปี ดัชนี MSCI Asia Pacific ปรับตัวดีกว่าตลาดหุ้นไทยเล็กน้อยแต่ก็เป็นระดับต่ำที่สุดในรอบปีเช่นกัน การปรับตัวลดลงอย่างรวดเร็วส่วนหนึ่งมาจากมุมมองว่าอัตราดอกเบี้ยจะปรับตัวเพิ่มขึ้นเป็นระยะเวลายาวนานขึ้น (“higher for longer”) สถานการณ์ระหว่างอิสราเอลและฮามาสเป็นแรงกดดันเพิ่มเติมต่อแรงเทขายในตลาดหุ้น และส่งผลให้ราคาน้ำมันดิบทั่วโลกปรับตัวเพิ่มขึ้นเป็นปัจจัยสนับสนุนมุมมองว่าอัตราดอกเบี้ยจะปรับตัวเพิ่มขึ้นเป็นระยะเวลายาวนานขึ้นและเป็นแรงกดดันต่ออัตราเงินเฟ้อ เหตุยิงในห้างสยามพารากอนเป็นแรงกดดันต่อธุรกิจการท่องเที่ยวภายในประเทศ โดยเฉพาะอย่างยิ่งต่อการกลับมาของนักท่องเที่ยวจีน

ในเดือนพฤศจิกายน 2566 ดัชนีปรับตัวมีเสถียรภาพมากขึ้น โดยดัชนียังคงไม่สามารถยืนอยู่เหนือกว่าระดับทางจิตวิทยาที่ 1,400 จุด แม้ว่าจะมีการซื้อขายอยู่ในระดับสูงกว่า 1,400 จุดเกือบตลอดทั้งเดือน ในช่วงสัปดาห์แรกของเดือนอัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลสหรัฐปรับตัวลดลง เนื่องจาก Fed คงอัตราดอกเบี้ยนโยบายที่ระดับร้อยละ 5.25 - 5.50 ในขณะที่ข้อมูลทางเศรษฐกิจออกมาต่ำกว่าที่คาดไว้ คณะกรรมการนโยบายการเงิน (กนง.) ของไทยคงอัตราดอกเบี้ยที่ระดับร้อยละ 2.50 ในขณะที่ปรับลดคาดการณ์การเติบโตของจีดีพีลงจากร้อยละ 2.8 เหลือร้อยละ 2.4 สะท้อนถึงกิจกรรมทางเศรษฐกิจในระดับอ่อนแอกว่าที่คาดไว้ โดยเฉพาะอย่างยิ่งในธุรกิจการท่องเที่ยวที่เผชิญกับปัจจัยลบจากข่าวการยกเลิกเที่ยวบินมากกว่า 8,000 ที่นั่ง

#### แนวโน้มการลงทุน

บริษัทฯ มีมุมมองว่า ปัจจัยจากต่างประเทศทั้งในส่วนของอัตราผลตอบแทนพันธบัตร และความตึงเครียดในตะวันออกกลางจะเริ่มเบาบางลง แต่ปัจจัยกดดันภายในประเทศทั้งการออกนโยบายกระตุ้นเศรษฐกิจของภาครัฐ และจำนวนนักท่องเที่ยวจีนที่ต่ำกว่าที่คาดจะทำให้ตลาดหุ้นมีโอกาสเคลื่อนไหวที่ในกรอบแคบๆ ต่อไปในช่วงปลายปี 2566

แนวทางการบริหารกองทุนยังคงเป็นการคัดเลือกหลักทรัพย์ที่จะลงทุนรายตัว จากข้อมูลที่ได้รับจากการพบปะกับผู้บริหารบริษัทจดทะเบียน การวิเคราะห์บริษัทจดทะเบียน ทั้งในเชิงคุณภาพ และเชิงปริมาณ รวมถึงการติดตามผลการดำเนินงานของบริษัทจดทะเบียน อย่างสม่ำเสมอ โดยบริษัทฯ เชื่อว่าแนวทางการบริหารกองทุนดังกล่าวจะเป็นสิ่งที่ส่งเสริมให้กองทุนสามารถสร้างผลตอบแทนจากการลงทุนในตลาดหลักทรัพย์ฯ ที่ดีในระยะกลาง และระยะยาว

บริษัทฯ ใคร่ขอขอบพระคุณท่านผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุนที่ได้มอบความไว้วางใจให้บริษัทฯ เป็นผู้บริหารเงินลงทุนของท่าน ทั้งนี้ บริษัทฯ จะพิจารณาดำเนินนโยบายการลงทุนที่เหมาะสมกับสถานการณ์ด้วยความระมัดระวัง และคำนึงถึงผลประโยชน์สูงสุดของผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุนเป็นสำคัญ

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด

### รายงานผู้ดูแลผลประโยชน์

เสนอ ผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุนกองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นไอ

ธนาคารซีทีแบงก์ เอ็น เอ สาขากรุงเทพฯ ในฐานะผู้ดูแลผลประโยชน์ กองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นไอ อันมีบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด เป็นผู้จัดตั้งและจัดการกองทุน ได้ปฏิบัติหน้าที่ดูแลผลประโยชน์กองทุนรวมดังกล่าว สำหรับรอบระยะเวลาตั้งแต่วันที่ 1 มิถุนายน 2566 ถึงวันที่ 30 พฤศจิกายน 2566 แล้วนั้น

ธนาคารฯ ได้จัดทำรายงานฉบับนี้ขึ้นบนพื้นฐานของแหล่งข้อมูลที่ได้รับ ณ วันที่ในจดหมายนี้โดยเชื่อว่าเชื่อถือได้ แต่ธนาคารไม่รับรองความถูกต้องหรือความสมบูรณ์ของข้อมูลดังกล่าว และขอสงวนสิทธิในความรับผิดชอบต่อความผิดพลาด ความละเอียด (รวมถึงไปถึงความรับผิดชอบต่อบุคคลที่สาม) อย่างชัดเจน ไม่มีการรับประกันว่าเหตุการณ์หรือผลลัพธ์ในอนาคตจะตรงกันกับรายงานดังกล่าว ธนาคารฯ กรรมการ พนักงาน หรือตัวแทนของธนาคารไม่รับประกันใดๆ ต่อการจ่ายคืนเงินลงทุน การกระทำการ หรือการแจกจ่ายกองทุน และไม่รับผิดชอบต่อความเสียหายที่เป็นผลมาจากการกระทำ หรือการละเลยที่เกิดขึ้นอันเกี่ยวข้องกับรายงานฉบับนี้

ธนาคารฯ เห็นว่าบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด ได้ปฏิบัติหน้าที่ในการจัดการโดยถูกต้องตามที่ควรตามวัตถุประสงค์ที่ได้กำหนดไว้ในโครงการจัดการที่ได้รับอนุมัติจากสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ และภายใต้พระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535

ขอแสดงความนับถืออย่างสูง



(คุณปานรดา โกจารย์ศรี คุณเจดจันทร์ สุนันทพงษ์ศักดิ์)

Citibank N.A.

ผู้ดูแลผลประโยชน์กองทุนรวม

ธนาคารซีทีแบงก์ เอ็น เอ สาขากรุงเทพฯ

20 ธันวาคม 2566 PA NS.

กองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นใจ  
งบแสดงฐานะการเงิน  
ณ 30 พฤศจิกายน 2566

	Unaudited (บาท)
สินทรัพย์	
เงินลงทุนตามราคายุติธรรม (ราคาทุน 1,414,042,121.36 บาท)	1,403,666,437.92
เงินฝากธนาคาร	18,065,886.93
ลูกหนี้	
จากดอกเบี้ย	1,999,435.06
จากการขายหน่วยลงทุน	299,199.26
จากเงินปันผล	697,530.67
จากการรับเงินค่าตอบแทนจากเงินลงทุนในต่างประเทศ	169,385.98
รวมสินทรัพย์	1,424,897,875.82
หนี้สิน	
เจ้าหนี้	
จากการรับซื้อคืนหน่วยลงทุน	1,099,463.64
จากการซื้อเงินลงทุน	1,290,795.60
ค่าธรรมเนียมสับเปลี่ยนหน่วยลงทุน	37,392.46
ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย	1,084,655.28
ภาษีเงินได้ค้างจ่าย	299,915.24
หนี้สินอื่น	34,189.63
รวมหนี้สิน	3,846,411.85
สินทรัพย์สุทธิ	1,421,051,463.97
สินทรัพย์สุทธิ:	
หน่วยลงทุนจดทะเบียน 5,000 ล้านหน่วย มูลค่าที่ตราไว้หน่วยละ 10 บาท	
ทุนที่ได้รับจากผู้ถือหน่วยลงทุน	1,419,220,818.05
กำไรสะสม	1,702,965.53
บัญชีปรับสมดุล	127,680.39
สินทรัพย์สุทธิ	1,421,051,463.97
ชนิดสะสมมูลค่า	
สินทรัพย์สุทธิ	1,421,051,463.97
หน่วยลงทุนที่ออกจำหน่ายแล้ว ณ วันสิ้นปี (หน่วย)	141,922,081.8051
สินทรัพย์สุทธิต่อหน่วย	10.0129

กองทุนเปิดกรุงศรีเชียงใหม่  
งบกำไรขาดทุนเบ็ดเสร็จ  
สำหรับงวดบัญชีสิ้นสุดวันที่ 30 พฤศจิกายน 2566

	Unaudited (บาท)
รายได้จากการลงทุน	
รายได้ดอกเบี้ย	4,503,571.25
รายได้เงินปันผล	3,025,076.67
รายได้จากการรับเงินค่าตอบแทนจากเงินลงทุนในประเทศ	1,281,071.81
รวมรายได้	8,809,719.73
ค่าใช้จ่าย	
ค่าธรรมเนียมการจัดการ	6,149,548.26
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์	175,701.44
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน	878,506.84
ค่าธรรมเนียมวิชาชีพ	29,999.51
ค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์	4,069.61
รวมค่าใช้จ่าย	7,237,825.66
รายได้จากการลงทุนสุทธิ	1,571,894.07
รายการกำไร (ขาดทุน) สุทธิจากเงินลงทุน	
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิที่เกิดขึ้นจากเงินลงทุน	1,838,221.00
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิที่ยังไม่เกิดขึ้นจากเงินลงทุน	(6,515,055.02)
รวมรายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิจากเงินลงทุนที่เกิดขึ้นและยังไม่มีเกิดขึ้น	(4,676,834.02)
หัก ภาษีเงินได้	(608,772.48)
การเพิ่มขึ้นในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงานหลังหักภาษีเงินได้	(3,713,712.43)
การเพิ่มขึ้นในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงานแยกตามชนิดหน่วยลงทุน มีดังนี้	
ชนิดสะสมมูลค่า	(3,713,712.43)
รวม	(3,713,712.43)



กองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นใจ  
งประกอบรายละเอียดเงินลงทุน  
ณ 30 พฤศจิกายน 2566  
การแสดงรายละเอียดเงินลงทุนใช้การจัดกลุ่มตามประเภทของเงินลงทุนและประเภทของอุตสาหกรรม

ประเภทเงินลงทุน/ผู้ออกตราสาร/ผู้ออกหลักทรัพย์	หมายเลขตราสาร	อัตรา ดอกเบี้ย (%)	วันครบอายุ	เงินต้น (บาท) / จำนวนหุ้น	มูลค่ายุติธรรม (บาท)	Unaudited ร้อยละของ มูลค่าเงิน ลงทุน
<b>หลักทรัพย์ในประเทศ</b>						
<b>เงินฝากออมทรัพย์</b>						
บมจ.ธ.กรุงเทพ			เมื่อทวงถาม	1,002.57	1,002.57	0.00
บมจ.ธ.ทิสโก้	0.600000		เมื่อทวงถาม	507.39	507.39	0.00
บมจ.ธ.ยูโอบี	1.150000		เมื่อทวงถาม	10,313.60	10,313.60	0.00
<b>พันธบัตร</b>						
กระทรวงการคลัง	ESGLB35DA	1.585000	17 ธ.ค. 2578	1,600,000.00	1,372,524.85	0.10
กระทรวงการคลัง	ESGLB376A	3.390000	17 มิ.ย. 2580	16,800,000.00	17,218,384.51	1.23
กระทรวงการคลัง	LB256A	0.950000	17 มิ.ย. 2568	1,600,000.00	1,564,900.66	0.11
กระทรวงการคลัง	LB436A	3.450000	17 มิ.ย. 2586	16,300,000.00	16,531,420.39	1.18
<b>หุ้นกู้</b>						
บมจ.เอเชียเสริมกิจลีสซิ่ง	ASK259A		19 ก.ย. 2568	30,000,000.00	28,321,789.80	2.02
บมจ.บริหารสินทรัพย์ กรุงเทพพาณิชย์	BAM265A	3.240000	17 พ.ค. 2569	64,000,000.00	63,530,574.72	4.53
บมจ.ซีพี แอ็กซ์ตรา	CPAXT269A	3.200000	13 ก.ย. 2569	8,000,000.00	8,005,690.32	0.57
ทรัสต์เพื่อการลงทุนในสิทธิการเช่าอสังหาริมทรัพย์ CPN รีเทล โกรท	CPNREIT272B	2.890000	3 ก.พ. 2570	28,000,000.00	27,429,022.88	1.95
บมจ.ผลิตไฟฟ้า	EGCO26NA	3.350000	3 พ.ย. 2569	11,000,000.00	11,053,641.06	0.79
บมจ.กัลฟ์ เอ็นเนอร์จี ดีเวลลอปเมนท์	GULF263B	3.370000	28 มี.ค. 2569	10,000,000.00	10,023,342.50	0.71
บมจ.กัลฟ์ เอ็นเนอร์จี ดีเวลลอปเมนท์	GULF283A	3.200000	30 มี.ค. 2571	20,000,000.00	19,815,160.40	1.41
บจก.ลีสซิ่ง ไอซีบีซี (ไทย)	ICBCTL274A	3.700000	30 เม.ย. 2570	9,000,000.00	9,055,460.07	0.65
บมจ.แลนด์ แอนด์ เฮาส์	LH264A	3.510000	9 เม.ย. 2569	43,000,000.00	43,318,060.68	3.09
บมจ.เอสซีจี เคมิคอลส์	SCGC259A	2.770000	8 ก.ย. 2568	85,000,000.00	84,765,629.50	6.04
บมจ.เงินติดล้อ	TIDLOR25NA	3.470000	29 พ.ย. 2568	31,000,000.00	30,997,475.98	2.21
บจก.โตโยต้า ลีสซิ่ง (ประเทศไทย)	TLT25NA	3.030000	29 พ.ย. 2568	18,000,000.00	17,998,751.52	1.28
บมจ.ทรู คอร์ปอเรชั่น	TRUE265A	3.740000	7 พ.ค. 2569	15,000,000.00	15,002,549.40	1.07
<b>หุ้นจดทะเบียน</b>						
<b>หุ้นสามัญ</b>						
<b>กลุ่มเกษตรและอุตสาหกรรมอาหาร</b>						
<b>หมวดอาหารและเครื่องดื่ม</b>						
บมจ.คาราบาวกรุ๊ป	CBG			7,300.00	596,775.00	0.04
บมจ.เจริญโภคภัณฑ์อาหาร	CPF			46,000.00	915,400.00	0.07
บมจ. โอสดสภา	OSP			4,200.00	96,180.00	0.01
บมจ.ไทยยูเนียน กรุ๊ป	TU			21,100.00	310,170.00	0.02

กองทุนเปิดกรุงศรีเชียงใหม่  
 งบประมาณรายละเอียดเงินลงทุน  
 ณ 30 พฤศจิกายน 2566  
 การแสดงรายละเอียดเงินลงทุนใช้การจัดกลุ่มตามประเภทของเงินลงทุนและประเภทของอุตสาหกรรม

ประเภทเงินลงทุน/ผู้ออกตราสาร/ผู้ออกหลักทรัพย์	หมายเลขตราสาร	อัตรา ดอกเบี้ย (%)	วันครบอายุ	เงินต้น (บาท) / จำนวนหุ้น	มูลค่ายุติธรรม (บาท)	Unaudited ร้อยละของ มูลค่าเงิน ลงทุน
<b>กลุ่มธุรกิจการเงิน</b>						
<b>หมวดธนาคาร</b>						
บมจ.ธ.กรุงเทพ	BBL			11,800.00	1,781,800.00	0.13
บมจ.ธ.กสิกรไทย	KBANK			18,100.00	2,316,800.00	0.17
บมจ.ธ.กรุงไทย	KTB			78,600.00	1,430,520.00	0.10
บมจ.เอสซีบี เอกซ์	SCB			23,600.00	2,342,300.00	0.17
บมจ.ทีสโก้ไฟแนนเชียลกรุ๊ป	TISCO			100.00	9,725.00	0.00
บมจ.ธ.ทหารไทยธนชาติ	TTB			587,800.00	905,212.00	0.06
<b>หมวดเงินทุนและหลักทรัพย์</b>						
บมจ.บัวหลวงไทย	KTC			13,200.00	617,100.00	0.04
บมจ.เมืองไทย แคปปิตอล	MTC			17,800.00	778,750.00	0.06
บมจ.ศรีสวัสดิ์ คอร์ปอเรชั่น	SAWAD			12,000.00	531,000.00	0.04
บมจ.เงินติดล้อ	TIDLOR			21,787.00	498,922.30	0.04
<b>หมวดประกันชีวิตและประกันภัย</b>						
บมจ.ไทยประกันชีวิต	TLI			73,600.00	717,600.00	0.05
<b>กลุ่มสินค้าอุตสาหกรรม</b>						
<b>หมวดบรรจุภัณฑ์</b>						
บมจ.เอสซีจี แพคเกจจิ้ง	SCGP			28,300.00	1,089,550.00	0.08
<b>หมวดปิโตรเคมีและเคมีภัณฑ์</b>						
บมจ.อินโดรามา เวนเจอร์ส	IVL			43,000.00	1,053,500.00	0.08
บมจ.พีทีที โกลบอล เคมิคอล	PTTGC			38,900.00	1,497,650.00	0.11
<b>กลุ่มอสังหาริมทรัพย์และก่อสร้าง</b>						
<b>หมวดวัสดุก่อสร้าง</b>						
บมจ.ปูนซิเมนต์ไทย	SCC			6,400.00	1,836,800.00	0.13
<b>หมวดพัฒนาอสังหาริมทรัพย์</b>						
บมจ.แอสเสท เวิร์ด คอร์ป	AWC			236,800.00	876,160.00	0.06
บมจ.เซ็นทรัลพัฒนา	CPN			28,400.00	1,924,100.00	0.14
บมจ.แลนด์ แอนด์ เฮาส์	LH			2,600.00	20,020.00	0.00
บมจ.ดับบลิวเอชเอ คอร์ปอเรชั่น	WHA			64,200.00	321,000.00	0.02

กองทุนเปิดกรุงศรีเชียงใหม่  
 งบประมาณรายละเอียดเงินลงทุน  
 ณ 30 พฤศจิกายน 2566  
 การแสดงรายละเอียดเงินลงทุนใช้การจัดกลุ่มตามประเภทของเงินลงทุนและประเภทของอุตสาหกรรม

ประเภทเงินลงทุน/ผู้ออกตราสาร/ผู้ออกหลักทรัพย์	หมายเลขตราสาร	อัตรา ดอกเบี้ย (%)	วันครบอายุ	เงินต้น (บาท) / จำนวนหุ้น	มูลค่ายุติธรรม (บาท)	Unaudited ร้อยละของ มูลค่าเงิน ลงทุน
<b>กลุ่มทรัพยากร</b>						
<b>หมวดพลังงานและสาธารณูปโภค</b>						
บมจ.บ้านปู	BANPU			55,200.00	411,240.00	0.03
บมจ.บี.กริม เพาเวอร์	BGRIM			16,900.00	426,725.00	0.03
บมจ.พลังงานบริสุทธิ์	EA			27,800.00	1,237,100.00	0.09
บมจ.ผลิตไฟฟ้า	EGCO			1,500.00	193,500.00	0.01
บมจ.โกลบอล เพาเวอร์ ซินเนอร์ยี	GPSC			20,300.00	923,650.00	0.07
บมจ.กัลฟ์ เอ็นเนอร์จี ดีเวลลอปเม้นท์	GULF			84,200.00	3,873,200.00	0.28
บมจ.ปตท. น้ำมันและการค้าปลีก	OR			75,200.00	1,496,480.00	0.11
บมจ.ปตท.	PTT			182,800.00	6,352,300.00	0.45
บมจ.ปตท.สำรวจ และผลิตปิโตรเลียม	PTTEP			24,300.00	3,681,450.00	0.26
บมจ.ราช กรุ๊ป	RATCH			7,300.00	237,250.00	0.02
บมจ.ไทยออยล์	TOP			15,802.00	813,803.00	0.06
<b>กลุ่มบริการ</b>						
<b>หมวดพาณิชย์</b>						
บมจ.คอมเซเว่น	COM7			16,500.00	377,850.00	0.03
บมจ.ซีพี ออลล์	CPALL			55,800.00	2,901,600.00	0.21
บมจ.เซ็นทรัล รีเทล คอร์ปอเรชั่น	CRC			38,800.00	1,464,700.00	0.10
บมจ.สยามโกลบอลเฮ้าส์	GLOBAL			25,191.00	423,208.80	0.03
บมจ.โฮม โปรดักส์ เซ็นเตอร์	HMPRO			51,800.00	611,240.00	0.04
<b>หมวดการแพทย์</b>						
บมจ.กรุงเทพดุสิตเวชการ	BDMS			77,200.00	2,026,500.00	0.14
บมจ.โรงพยาบาลบำรุงราษฎร์	BH			3,100.00	691,300.00	0.05
<b>หมวดการท่องเที่ยวและสันทนาการ</b>						
บมจ.โรงแรมเซ็นทรัลพลาซา	CENTEL			8,100.00	342,225.00	0.02
บมจ.ไมเนอร์ อินเตอร์เนชั่นแนล	MINT			43,000.00	1,171,750.00	0.08
<b>หมวดขนส่งและโลจิสติกส์</b>						
บมจ.ท่าอากาศยานไทย	AOT			87,400.00	5,200,300.00	0.37
บมจ.ทางด่วนและรถไฟฟ้ากรุงเทพ	BEM			63,100.00	492,180.00	0.04
บมจ.บีทีเอส กรุ๊ป โฮลดิ้งส์	BTS			71,400.00	517,650.00	0.04

กองทุนเปิดกรุงศรีเชียงใหม่  
 งบประมาณรายละเอียดเงินลงทุน  
 ณ 30 พฤศจิกายน 2566  
 การแสดงรายละเอียดเงินลงทุนใช้การจัดกลุ่มตามประเภทของเงินลงทุนและประเภทของอุตสาหกรรม

ประเภทเงินลงทุน/ผู้ออกตราสาร/ผู้ออกหลักทรัพย์	หมายเลขตราสาร	อัตรา ดอกเบี้ย (%)	วันครบอายุ	เงินต้น (บาท) / จำนวนหุ้น	มูลค่ายุติธรรม (บาท)	Unaudited ร้อยละของ มูลค่าเงิน ลงทุน
<b>กลุ่มเทคโนโลยี</b>						
<b>หมวดหุ้นส่วนอิเล็กทรอนิกส์</b>						
บมจ.เคลต้า อีเลคโทรนิคส์ (ประเทศไทย)	DELTA			82,300.00	6,398,825.00	0.46
<b>หมวดเทคโนโลยีสารสนเทศและการสื่อสาร</b>						
บมจ.แอดวานซ์ อินโฟร์ เซอร์วิส	ADVANC			13,900.00	3,030,200.00	0.22
บมจ.อินทัช โฮลดิ้งส์	INTUCH			6,500.00	453,375.00	0.03
บมจ.ทรู คอร์ปอเรชั่น	TRUE			235,183.00	1,317,024.80	0.09
<b>หน่วยลงทุน</b>						
ทรัสต์เพื่อการลงทุนในอสังหาริมทรัพย์และสิทธิการเช่า ทรัสต์เพื่อการลงทุนในสิทธิการเช่าอสังหาริมทรัพย์ CPN รีเทล โกรท	BAREIT			97,800.00	968,220.00	0.07
ทรัสต์เพื่อการลงทุนในอสังหาริมทรัพย์และสิทธิการเช่า อสังหาริมทรัพย์เพื่ออุตสาหกรรมเฟรเซอร์สพรีอเพอร์	CPNREIT			806,000.00	8,785,400.00	0.63
กองทุนรวมสิทธิการเช่าอสังหาริมทรัพย์ฟิวเจอร์พาร์ค	FTREIT			1,157,865.00	11,578,650.00	0.82
ทรัสต์เพื่อการลงทุนในอสังหาริมทรัพย์อิมแพ็ค โกรท	FUTUREPF			144,200.00	1,687,140.00	0.12
ทรัสต์เพื่อการลงทุนในสิทธิการเช่าอสังหาริมทรัพย์ แอล เอช ซุปเปอร์ เซ็นเตอร์	IMPACT			845,200.00	10,565,000.00	0.75
กองทุนรวมอสังหาริมทรัพย์และสิทธิการเช่า โลตัสรีเทล โกรท	LHSC			121,300.00	1,182,675.00	0.08
ทรัสต์เพื่อการลงทุนในอสังหาริมทรัพย์และสิทธิการเช่า ดับบลิวเอชเอ พรีเมียม โกรท	LPF			1,077,600.00	14,008,800.00	1.00
กองทุนรวมโครงสร้างพื้นฐานเพื่ออนาคตประเทศไทย	WHART			951,009.00	9,319,888.20	0.66
กองทุนรวมโครงสร้างพื้นฐาน โทรคมนาคม ดิจิทัล	TFFIF			668,700.00	4,346,550.00	0.31
กองทุนเปิดกรุงศรีแอดทิฟตราสารหนี้-สะสมมูลค่า	DIF			470,400.00	3,927,840.00	0.28
กองทุนเปิดกรุงศรีสมาร์ทตราสารหนี้-สะสมมูลค่า	KFAFIX-A			4,497,859.02	51,545,464.36	3.67
กองทุนเปิดกรุงศรีสมาร์ทตราสารหนี้-สะสมมูลค่า	KFSMART-A			73,362,515.32	810,200,946.66	57.72
					1,403,666,437.92	100.00

## กองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นไอ

รายละเอียดการลงทุน ณ 30 พฤศจิกายน 2566

	มูลค่าตามราคาตลาด	% NAV
<b>หลักทรัพย์หรือทรัพย์สินในประเทศ</b>	<b>1,423,731,759.91</b>	<b>100.21</b>
<b>หุ้นสามัญ</b>		
<b>จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์</b>		
การท่องเที่ยวและสันทนาการ	1,513,975.00	0.11
การแพทย์	2,717,800.00	0.19
ขนส่งและโลจิสติกส์	6,210,130.00	0.44
เงินทุนและหลักทรัพย์	2,425,772.30	0.17
ชิ้นส่วนอิเล็กทรอนิกส์	6,398,825.00	0.45
เทคโนโลยีสารสนเทศและการสื่อสาร	4,800,599.80	0.34
ธนาคาร	8,786,357.00	0.62
บรรจุภัณฑ์	1,089,550.00	0.08
ประกันชีวิตและประกันภัย	717,600.00	0.05
ปิโตรเคมีและเคมีภัณฑ์	2,551,150.00	0.18
พลังงานและสาธารณูปโภค	19,646,698.00	1.38
พัฒนาอสังหาริมทรัพย์	3,141,280.00	0.22
พาณิชย์	5,778,598.80	0.41
วัสดุก่อสร้าง	1,836,800.00	0.13
อาหารและเครื่องดื่ม	1,918,525.00	0.14
<b>หน่วยลงทุน</b>		
<b>จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์</b>		
กองทุนรวมอสังหาริมทรัพย์และกองทรัสต์เพื่อการลงทุนในอสังหาริมทรัพย์	66,370,163.20	4.67
<b>ไม่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์</b>		
<b>กองทุนรวม</b>	<b>861,746,411.02</b>	<b>60.64</b>
<b>พันธบัตรรัฐบาลและตั๋วเงินคลัง</b>		
อายุคงเหลือ 1 - 3 ปี	1,571,855.19	0.11
อายุคงเหลือมากกว่า 3 ปี	35,651,802.07	2.51
<b>หุ้นกู้</b>		
<b>TRIS</b>		
Rate AAA	18,001,740.06	1.27

## กองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นไอ

รายละเอียดการลงทุน ณ 30 พฤศจิกายน 2566

มูลค่าตามราคาตลาด % NAV

Rate AA+	11,081,909.52	0.78
Rate AA-	27,695,061.24	1.95
Rate A+	96,656,466.07	6.80
Rate A	31,003,370.32	2.18
Rate A-	63,610,110.08	4.48
FITCH_TH-LONG		
Rate AAA	9,083,742.30	0.64
Rate A	113,629,276.45	8.00
เงินฝากธนาคาร		
TRIS		
Rate A	508.97	0.00
S&P		
Rate A-	18,084,324.38	1.27
FITCH_TH-LONG		
Rate AAA	10,355.57	0.00
Rate BBB	1,002.57	0.00
อื่นๆ	<b>(2,680,295.94)</b>	<b>(0.21)</b>
ลูกหนี้	1,166,115.91	0.08
เจ้าหนี้	(2,761,756.57)	(0.21)
ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย	(1,084,655.28)	(0.08)
<b>มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ</b>	<b>1,421,051,463.97</b>	<b>100.00</b>

## กองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นใจ

รายงานสรุปเงินลงทุน ณ 30 พฤศจิกายน 2566

กลุ่มของตราสาร	มูลค่าตามราคาตลาด	%NAV
(ก) ตราสารภาครัฐไทยและตราสารภาครัฐต่างประเทศ	37,223,657.26	2.62
(ข) ตราสารที่ธนาคารที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้น ธนาคารพาณิชย์ หรือบริษัทเงินทุนเป็นผู้ออก ผู้ส่งจ่าย ผู้รับรอง ผู้รับอ่าวัด ผู้สลักหลัง หรือผู้ค้ำประกัน	0.00	0.00
(ค) ตราสารที่มีบริษัทที่ได้รับ rating ในระดับ investment grade เป็นผู้ออก ผู้รับรอง ผู้รับอ่าวัด ผู้สลักหลัง หรือผู้ค้ำประกัน	370,761,676.04	26.09
(ง) ตราสารที่มีบริษัทที่ได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือในระดับที่ต่ำกว่า investment grade หรือไม่มี rating เป็นผู้ออก ผู้รับรอง ผู้รับอ่าวัด หรือผู้ค้ำประกัน	0.00	0.00

สัดส่วนเงินลงทุนขั้นสูงต่อมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุนที่บริษัทจัดการตั้งไว้ในแผนการลงทุนสำหรับกลุ่มตราสารตาม (ง) เท่ากับ 15.00 %

## กองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นไอ

รายละเอียดตัวตราสารและความน่าเชื่อถือของตราสารทุกตัวใน Port ณ 30 พฤศจิกายน 2566

ประเภท	ผู้ออก	ผู้ค้า/ผู้รับรอง/ผู้สลับหลัง	วันครบกำหนด	อันดับความน่าเชื่อถือ	มูลค่าหน้าตั๋ว	มูลค่าตามราคาตลาด
หลักทรัพย์ในประเทศ						
1 พันธบัตร	กระทรวงการคลัง	กระทรวงการคลัง	17 มิถุนายน 2568		1,600,000.00	1,571,855.19
	กระทรวงการคลัง	กระทรวงการคลัง	17 ธันวาคม 2578		1,600,000.00	1,384,127.92
	กระทรวงการคลัง	กระทรวงการคลัง	17 มิถุนายน 2580		16,800,000.00	17,478,959.40
	กระทรวงการคลัง	กระทรวงการคลัง	17 มิถุนายน 2586		16,300,000.00	16,788,714.75
2 หุ้นกู้	บจก.โตโยต้า ลีสซิ่ง (ประเทศไทย)	บจ.โตโยต้า มอเตอร์ ไฟแนนซ์ (เนเธอร์แลนด์)	29 พฤศจิกายน 2568	AAA	18,000,000.00	18,001,740.06
	บจก.ลีสซิ่งไอซีบีซี (ไทย)		30 เมษายน 2570	AAA	9,000,000.00	9,083,742.30
	บมจ.ผลิตไฟฟ้า		3 พฤศจิกายน 2569	AA+	11,000,000.00	11,081,909.52
	ทรัสต์เพื่อการลงทุนในสิทธิการเช่าอสังหาริมทรัพย์ CPN รีเทล โกรท		3 กุมภาพันธ์ 2570	AA-	28,000,000.00	27,695,061.24
	บมจ.ซีพี แอ็กซ์ตรา		13 กันยายน 2569	A+	8,000,000.00	8,061,098.56
	บมจ.ทรู คอร์ปอเรชั่น		7 พฤษภาคม 2569	A+	15,000,000.00	15,039,437.10
	บมจ.แลนด์ แอนด์ เฮาส์		9 เมษายน 2569	A+	43,000,000.00	43,549,624.71
	บมจ.กัลฟ์ เอ็นเนอร์จี ดีเวลลอปเมนท์		28 มีนาคม 2569	A	10,000,000.00	10,082,432.90
	บมจ.กัลฟ์ เอ็นเนอร์จี ดีเวลลอปเมนท์		30 มีนาคม 2571	A	20,000,000.00	19,923,872.80



## กองทุนเปิดกรุงศรีเย็นใจ

รายละเอียดตัวตราสารและความน่าเชื่อถือของตราสารทุกตัวใน Port ณ 30 พฤศจิกายน 2566

ประเภท	ผู้ออก	ผู้ค้า/ผู้รับรอง/ผู้สลับหลัง	วันครบกำหนด	อันดับความน่าเชื่อถือ	มูลค่าหน้าตัว	มูลค่าตามราคาตลาด
	บมจ.เงินติดล้อ		29 พฤศจิกายน 2568	A	31,000,000.00	31,003,370.32
	บมจ.เอเชียเซรามิกจีสซิ่ง		19 กันยายน 2568	A	30,000,000.00	28,321,789.80
	บมจ.เอสซีจี เคมิคอลส์		8 กันยายน 2568	A	85,000,000.00	85,307,486.65
	บมจ.บริหารสินทรัพย์ กรุงเทพพาณิชย์		17 พฤษภาคม 2569	A-	64,000,000.00	63,610,110.08
3 เงินฝากออมทรัพย์	บมจ.ธ.ยูโอบี	บมจ.ธ.ยูโอบี	เมื่อทวงถาม	AAA	10,313.60	10,355.57
	บมจ.ธ.ทิสโก้	บมจ.ธ.ทิสโก้	เมื่อทวงถาม	A	507.39	508.97
	บมจ.ธ.กรุงเทพ	บมจ.ธ.กรุงเทพ	เมื่อทวงถาม	BBB	1,002.57	1,002.57

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)

กองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นใจ

ตั้งแต่วันที่ 1 มิถุนายน 2566 ถึงวันที่ 30 พฤศจิกายน 2566

ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (Fund's Direct Expenses)	จำนวนเงิน หน่วย: พันบาท	ร้อยละของมูลค่า ทรัพย์สิน* (ต่อปี) 1/
ค่าธรรมเนียมการจัดการ (Management Fee)	6,149.55	0.7490
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ (Trustee Fee)	175.70	0.0214
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน (Registrar Fee)	878.51	0.1070
ค่าที่ปรึกษาการลงทุน (Advisory Fee)	-	-
ค่าธรรมเนียมสอบบัญชี (Auditing Fee)	30.00	0.0036
ค่าใช้จ่ายอื่น ๆ (Others)	-	-
<b>รวมค่าใช้จ่ายทั้งหมด 2/</b>	<b>7,233.76</b>	<b>0.8810</b>

หมายเหตุ

1/ ค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวมข้างต้น เป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่มหรือภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว

2/ ไม่รวมค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ และค่าธรรมเนียมต่าง ๆ ที่เกิดขึ้นจากการซื้อขายหลักทรัพย์

\* มูลค่าทรัพย์สิน ในที่นี้ หมายถึง มูลค่าทรัพย์สินทั้งหมด หักด้วย มูลค่าหนี้สินทั้งหมด

เว้นแต่ค่าธรรมเนียมการจัดการ ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ ค่าธรรมเนียมนายทะเบียนหน่วยลงทุน

และค่าใช้จ่ายที่เกี่ยวข้องกับการปฏิบัติการกองทุน ณ วันที่คำนวณ

**ค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์**  
**กองทุนเปิดกรุงศรีเย็นใจ / Krungsri Yenjai Fund**  
**ตั้งแต่วันที่ 1 มิถุนายน 2566 ถึงวันที่ 30 พฤศจิกายน 2566**

บริษัท	จำนวนเงิน (บาท)	อัตราส่วน (%)
บมจ.หลักทรัพย์ เคจีไอ (ประเทศไทย) / KGI Securities (Thailand) Plc.	6,396.07	54.18
บจ.หลักทรัพย์ กรุงไทย เอ็กซ์สปริง จำกัด / Krungthai XSpring Securities Co.,Ltd.	2,744.52	23.25
บมจ.หลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส / Finansia Syrus Securities Plc.	2,665.00	22.57
<b>รวม / Total</b>	<b>11,805.59</b>	<b>100.00</b>

ผลการดำเนินงานของกองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นใจ-สะสมมูลค่า

ผลการดำเนินงาน สิ้นสุด ณ วันที่ 30 พฤศจิกายน 2566	% ตามช่วงเวลา			% ต่อปี				
	Year to Date	ย้อนหลัง 3 เดือน	ย้อนหลัง 6 เดือน	ย้อนหลัง 1 ปี	ย้อนหลัง 3 ปี	ย้อนหลัง 5 ปี	ย้อนหลัง 10 ปี	นับจากวันเริ่ม โครงการ (29 มิถุนายน 2565)
KFYENJAI-A	-0.46%	-0.35%	-0.18%	-0.18%	N/A	N/A	N/A	+0.09%
ดัชนีชี้วัด (Benchmark)*	-0.53%	-0.42%	-0.29%	-0.10%	N/A	N/A	N/A	+0.42%
ความผันผวนของผลการดำเนินงาน	+1.05%	+1.36%	+1.11%	+1.02%	N/A	N/A	N/A	+0.95%
ความผันผวนของดัชนีชี้วัด	+0.78%	+0.97%	+0.80%	+0.77%	N/A	N/A	N/A	+0.75%

หมายเหตุ : \* ดัชนีชี้วัด (Benchmark) คือ

1. ดัชนีพันธบัตรที่มีอายุคงที่ (ZRR) อายุประมาณ 2 ปี สัดส่วน 45.00%
2. อัตราดอกเบี้ยเงินฝากประจำ 1 ปี เฉลี่ยประเภทบุคคลธรรมดาเงิน 1 ล้านบาท ของธนาคารกรุงเทพ, ธนาคารกรุงศรีไทย และธนาคารไทยพาณิชย์ หลังหักภาษี สัดส่วน 45.00%
3. ดัชนีผลตอบแทนรวม SET50 (SET50 TRI) สัดส่วน 5.00%
4. ดัชนีผลตอบแทนรวมของกองทุนรวมอสังหาริมทรัพย์และกองทุนทรัสต์เพื่อการลงทุนในอสังหาริมทรัพย์ (PE&REIT Total Return Index) สัดส่วน 5.00%

\*\* ผลตอบแทนที่มีอายุเกินหนึ่งปีจะแสดงเป็นผลตอบแทนต่อปี

เอกสารการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวมฉบับนี้ ได้จัดทำตามมาตรฐานการวัดผลดำเนินงานของ  
กองทุนรวมของสมาคมบริษัทจัดการลงทุน

ข้อมูลอื่นๆ ที่ผู้ถือหุ้นลงทุนควรทราบ

(1) รายงานบุคคลที่เกี่ยวข้องที่มีการทำธุรกรรมในรอบเวลาที่ผ่านมา (วันที่ 1 มิถุนายน 2566 ถึงวันที่ 30 พฤศจิกายน 2566)

ชื่อกองทุน	รายชื่อบุคคลที่เกี่ยวข้อง
กองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นใจ	<ol style="list-style-type: none"> <li>ธนาคารกรุงศรีอยุธยา จำกัด (มหาชน)</li> <li>บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด</li> <li>กองทุนสำรองเลี้ยงชีพ เซ็นทรัลพัฒนา ซึ่งจดทะเบียนแล้ว</li> <li>กองทุนเปิดกรุงศรีหุ้นระยะยาว SET50 LTF</li> <li>กองทุนเปิดกรุงศรี SET100 เพื่อการเลี้ยงชีพ</li> <li>กองทุนเปิดกรุงศรี SET100</li> <li>กองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นแอสแซนด์ 50</li> </ol>

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

(2) การรับผลประโยชน์ตอบแทนเนื่องจากการที่กองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นใจ ใช้บริการบุคคลอื่นๆ (soft commission)

บริษัทที่ให้ผลประโยชน์	ผลประโยชน์ที่ได้รับ	เหตุผลในการรับผลประโยชน์
1. บริษัทหลักทรัพย์ เกียรตินาคินภัทร จำกัด (มหาชน)	ข่าวสารและบทวิเคราะห์ต่างๆ	เพื่อประโยชน์ของกองทุน
2. บริษัทหลักทรัพย์ เคจีไอ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)	ข่าวสารและบทวิเคราะห์ต่างๆ	เพื่อประโยชน์ของกองทุน
3. บริษัทหลักทรัพย์ เครดิต สวิส (ประเทศไทย) จำกัด	ข่าวสารและบทวิเคราะห์ต่างๆ	เพื่อประโยชน์ของกองทุน
4. บริษัทหลักทรัพย์ เมย์แบงก์ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)	ข่าวสารและบทวิเคราะห์ต่างๆ	เพื่อประโยชน์ของกองทุน
5. บริษัทหลักทรัพย์ กรุงไทย เอ็กซ์สปริง จำกัด	ข่าวสารและบทวิเคราะห์ต่างๆ	เพื่อประโยชน์ของกองทุน
6. บริษัทหลักทรัพย์ กรุงศรี จำกัด (มหาชน)	ข่าวสารและบทวิเคราะห์ต่างๆ	เพื่อประโยชน์ของกองทุน
7. บริษัทหลักทรัพย์ กรุงศรี พัฒนสิน จำกัด (มหาชน)	ข่าวสารและบทวิเคราะห์ต่างๆ	เพื่อประโยชน์ของกองทุน
8. บริษัทหลักทรัพย์ กลีกรไทย จำกัด (มหาชน)	ข่าวสารและบทวิเคราะห์ต่างๆ	เพื่อประโยชน์ของกองทุน
9. บริษัทหลักทรัพย์ ซีดีคอร์ป (ประเทศไทย) จำกัด	ข่าวสารและบทวิเคราะห์ต่างๆ	เพื่อประโยชน์ของกองทุน
10. บริษัทหลักทรัพย์ ซี แอล เอส เอ (ประเทศไทย) จำกัด	ข่าวสารและบทวิเคราะห์ต่างๆ	เพื่อประโยชน์ของกองทุน
11. บริษัทหลักทรัพย์ ซีจีเอส-ซีไอเอ็มบี (ประเทศไทย) จำกัด	ข่าวสารและบทวิเคราะห์ต่างๆ	เพื่อประโยชน์ของกองทุน
12. บริษัทหลักทรัพย์ คาโอ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)	ข่าวสารและบทวิเคราะห์ต่างๆ	เพื่อประโยชน์ของกองทุน
13. บริษัทหลักทรัพย์ ดีบีเอส วิคเคอร์ส (ประเทศไทย) จำกัด	ข่าวสารและบทวิเคราะห์ต่างๆ	เพื่อประโยชน์ของกองทุน
14. บริษัทหลักทรัพย์ ทรินิตี้ จำกัด	ข่าวสารและบทวิเคราะห์ต่างๆ	เพื่อประโยชน์ของกองทุน
15. บริษัทหลักทรัพย์ ทิสโก้ จำกัด	ข่าวสารและบทวิเคราะห์ต่างๆ	เพื่อประโยชน์ของกองทุน
16. บริษัทหลักทรัพย์ ธนชาด จำกัด (มหาชน)	ข่าวสารและบทวิเคราะห์ต่างๆ	เพื่อประโยชน์ของกองทุน
17. บริษัทหลักทรัพย์ บัวหลวง จำกัด (มหาชน)	ข่าวสารและบทวิเคราะห์ต่างๆ	เพื่อประโยชน์ของกองทุน
18. บริษัทหลักทรัพย์ บันนิงเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)	ข่าวสารและบทวิเคราะห์ต่างๆ	เพื่อประโยชน์ของกองทุน
19. บริษัทหลักทรัพย์ ฟิวลิป (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)	ข่าวสารและบทวิเคราะห์ต่างๆ	เพื่อประโยชน์ของกองทุน
20. บริษัทหลักทรัพย์ ยูบีเอส (ประเทศไทย) จำกัด	ข่าวสารและบทวิเคราะห์ต่างๆ	เพื่อประโยชน์ของกองทุน
21. บริษัทหลักทรัพย์ อินโนเวสต์ เอกซ์ จำกัด	ข่าวสารและบทวิเคราะห์ต่างๆ	เพื่อประโยชน์ของกองทุน

(3) รายชื่อผู้จัดการกองทุน ณ วันที่ 30 พฤศจิกายน 2566

ตราสารทุน

- นายชวลิต ไชคทียพัฒนา
- นายสาธิต บัวชู
- นางสาวสาวิณี สุขศรีวงศ์
- นายปิติ ประดิพัทธ์พงษ์
- นายกวีพ หาริชญเสาวภาคย์
- นายเอกชัย บุญยะพงส์ไชย

ตราสารหนี้

- นางสาวพรทิพา หนึ่งน้ำใจ
- นายธีรภาพ จิรศักดิ์กุล
- นางสาวรัมภารัตน์ ยูธานหัส
- นายเอกพจน์ ภู่วินุลย์พาณิชย์
- นางสาวณัฐษา เตรียมวิทยา

(4) การเปิดเผยข้อมูลการถือหน่วยลงทุนเกิน 1 ใน 3 ณ วันที่ 30 พฤศจิกายน 2566

ไม่มีการถือหน่วยลงทุนเกิน 1 ใน 3 ของบุคคลใดบุคคลหนึ่ง

ผู้ถือหน่วยลงทุนสามารถตรวจสอบข้อมูลสัดส่วนการถือหน่วยลงทุนโดยตรงได้ที่ [www.krungsriasset.com](http://www.krungsriasset.com)

(5) อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุนของกองทุน (portfolio turnover ratio) ในรอบระยะเวลาที่ผ่านมา

- KFYENJAI-A (portfolio turnover ratio) เท่ากับ 21.61%