



krungsri
Asset
Management

A member of MUFG

รายงานประจำปีแรก 2569

รอบระยะเวลาตั้งแต่วันที่ 1 ธันวาคม 2568 – 31 พฤษภาคม 2569

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

รายงานประจำปีแรก 2569

กองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นแซนด์ซีทีไทยเพื่อความยั่งยืน

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

สารบัญชจัดการ

เรียน ผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุน

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด (บริษัทฯ) ขอส่งรายงานสำหรับรอบระยะเวลา 6 เดือน ของกองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นแฮนซ์ เซ็ทไทยเพื่อความยั่งยืน (KFTHAIESG) ตั้งแต่วันที่ 1 ธันวาคม 2568 ถึงวันที่ 31 พฤษภาคม 2569 มายังผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุน โดยมีรายละเอียดดังนี้

ผลการดำเนินงาน

กองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นแฮนซ์เซ็ทไทยเพื่อความยั่งยืน มีมูลค่าทรัพย์สินสุทธิ ณ วันที่ 31 พฤษภาคม 2569 ซึ่งแบ่งตามชนิดหน่วยลงทุน ดังนี้

- KFTHAIESGA จำนวน 961.14 ล้านบาท คิดเป็นมูลค่าทรัพย์สินสุทธิต่อหน่วยลงทุน 10.7076 บาท
 - KFTHAIESGD จำนวน 993.96 ล้านบาท คิดเป็นมูลค่าทรัพย์สินสุทธิต่อหน่วยลงทุน 10.7075 บาท
- และมีผลการดำเนินงานย้อนหลัง 6 เดือน โดยแบ่งตามชนิดหน่วยลงทุน ได้แก่
- KFTHAIESGA เพิ่มขึ้นร้อยละ 20.18 ใกล้เคียงกับดัชนีผลตอบแทนรวม SET ESG (SET ESG TRI) ที่เพิ่มขึ้นร้อยละ 20.34
 - KFTHAIESGD เพิ่มขึ้นร้อยละ 20.18 ใกล้เคียงกับดัชนีผลตอบแทนรวม SET ESG (SET ESG TRI) ที่เพิ่มขึ้นร้อยละ 20.34

ภาวะการลงทุนในช่วงที่ผ่านมา

ในรอบครึ่งปีบัญชีที่ผ่านมา ดัชนีผลตอบแทนรวมตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (ตลาดหลักทรัพย์ฯ) ปรับตัวอยู่ระหว่าง 1,232.40 – 1,581.74 จุด ก่อนปิดที่ 1,568.37 จุด ณ วันที่ 31 พฤษภาคม 2569 โดยในช่วงเวลาดังกล่าว ดัชนีปรับตัวเพิ่มขึ้นประมาณร้อยละ 28.88 ในเดือนธันวาคม 2568 ดัชนีปรับตัวเพิ่มขึ้น บรรยากาศการลงทุนในช่วงต้นเดือนปรับตัวดีขึ้นเล็กน้อย จากค่าเงินบาทที่แข็งค่า ข้อมูลการจ้างงานภาคเอกชนของสหรัฐฯ ที่อ่อนแอ ส่งผลให้ความน่าจะเป็นของการปรับลดอัตราดอกเบี้ยของ Fed ในการประชุมเดือนธันวาคม เพิ่มขึ้นเกือบร้อยละ 90 ในช่วงกลางเดือน ผลการดำเนินงานของตลาดอ่อนแอลง หลังเกิดเหตุปะทะบริเวณชายแดนไทย-กัมพูชา ซึ่งกระตุ้นภาวะหลีกเลี่ยงความเสี่ยง และกดดันราคาหุ้นที่มีความเกี่ยวข้องกับกัมพูชาเพิ่มเติม ขณะเดียวกัน ความไม่แน่นอนทางการเมืองภายในประเทศเพิ่มสูงขึ้น ภายหลังการยุบสภาเมื่อวันที่ 12 ธันวาคม 2568 ส่งผลให้ประเทศไทยเข้าสู่วัฏจักรการเลือกตั้งทั่วไป ในเดือนมกราคม 2569 ดัชนีปรับตัวเพิ่มขึ้น บรรยากาศการลงทุนปรับตัวดีขึ้นอย่างมีนัยสำคัญในช่วงต้นปี จากแรงสนับสนุนของความเชื่อมั่นต่อสินทรัพย์เสี่ยงในตลาดโลกที่ปรับตัวดีขึ้น และการฟื้นตัวอย่างชัดเจนของกิจกรรมการซื้อขาย โดยมูลค่าการซื้อขายเฉลี่ยต่อวันเพิ่มขึ้นสะท้อนถึงสภาพคล่องในตลาดที่ปรับตัวดีขึ้นอย่างมีนัยสำคัญ ตลาดหุ้นสหรัฐฯ ปรับตัวขึ้นทำระดับสูงสุดใหม่ ได้รับแรงสนับสนุนจากหุ้นที่เกี่ยวข้องกับเทคโนโลยีปัญญาประดิษฐ์ (AI) ในขณะที่ราคาน้ำมันดิบปรับตัวลดลงอย่างรวดเร็วในช่วงต้นเดือนก่อนจะฟื้นตัวขึ้นในช่วงปลายเดือน จากการหยุดการผลิตในคาซัคสถาน และความตึงเครียดทางภูมิรัฐศาสตร์ที่ทวีความรุนแรงขึ้น โดยเฉพาะประเด็นที่เกี่ยวข้องกับอิหร่าน สำหรับตลาดภายในประเทศ บรรยากาศการลงทุนได้รับแรงสนับสนุนจากสัญญาณเงินทุนไหลเข้าสู่ตลาดเอเซีย และการอ่อนค่าของเงินดอลลาร์สหรัฐฯ ซึ่งมีน้ำหนักมากกว่าประเด็นการบริโภคที่เกี่ยวข้องกับการเลือกตั้ง

ในเดือนกุมภาพันธ์ 2569 ดัชนีปรับตัวขึ้นแรงโดยได้แรงหนุนจากสภาพคล่องที่ดีขึ้นและกระแสเงินทุนต่างชาติไหลเข้า โดยเฉพาะในหุ้นขนาดใหญ่ที่มีปัจจัยพื้นฐานแข็งแกร่งปัจจัยต่างประเทศยังคงผันผวน จากการโยกเงินออกจากหุ้นเทคโนโลยี ท่ามกลางความกังวลเรื่องมูลค่าและการเปลี่ยนแปลงจาก AI ขณะที่ธนาคารกลางหลักยังใช้นโยบายระมัดระวัง และจีนมีแนวโน้มผ่อนคลายนโยบายเพิ่มเติมในประเทศ ความชัดเจนทางการเมืองหลังการเลือกตั้งช่วยหนุนความเชื่อมั่นนักลงทุน ประกอบกับเศรษฐกิจไทยฟื้นตัวดีกว่าคาด และการลดอัตราดอกเบี้ยนโยบายเป็นปัจจัยสนับสนุนสำคัญต่อการปรับขึ้นของตลาด อย่างไรก็ตาม ในช่วงปลายเดือนมีแรงกดดันจากความตึงเครียดทางภูมิรัฐศาสตร์ที่รุนแรงขึ้น ส่งผลให้ราคาน้ำมันและทองคำพุ่งสูง และเพิ่มความผันผวนต่อทิศทางตลาดในระยะถัดไป

ในเดือนมีนาคม 2569 เผชิญกับสภาวะที่ค่อนข้างเปราะบางและมีความผันผวนสูง โดยดัชนีมีการปรับตัวลดลงท่ามกลางวิกฤตการณ์ความตึงเครียดทางภูมิรัฐศาสตร์ในภูมิภาคตะวันออกกลาง สถานการณ์ดังกล่าวส่งผลกระทบโดยตรงต่อราคาพลังงานในตลาดโลกที่พุ่งสูงขึ้นอย่างรวดเร็ว ก่อให้เกิดความกังวลระลอกใหม่เกี่ยวกับปัญหาเงินเฟ้อและแนวโน้มที่ธนาคารกลางทั่วโลก

อาจกลับมาใช้นโยบายการเงินที่เข้มงวดมากขึ้น ในช่วงต้นเดือนตลาดเกิดความตื่นตระหนกจนส่งผลให้ดัชนีร่วงลงอย่างรุนแรงจนต้องใช้มาตรการหยุดการซื้อขายชั่วคราวตลอดทั้งเดือน นักลงทุนส่วนใหญ่เปลี่ยนพฤติกรรมเป็นการหลีกเลี่ยงสินทรัพย์เสี่ยงเพื่อถือครองสินทรัพย์ที่ปลอดภัยกว่า สรุปได้ว่าความผันผวนของราคาพลังงานและความไม่แน่นอนทางการเมืองระหว่างประเทศ คือปัจจัยหลักที่กดดันให้ตลาดหุ้นไทยปิดตัวในแดนลบและเต็มไปด้วยความระมัดระวังในการลงทุน

ในเดือนเมษายน 2569 ดัชนีปรับตัวเพิ่มขึ้นและฟื้นตัวบางส่วน หลังจากอ่อนตัวแรงในเดือนก่อนหน้า โดยได้รับแรงหนุนจากการผ่อนคลายของความตึงเครียดในตะวันออกกลาง หลังมีสัญญาณข้อตกลงหยุดยิงชั่วคราว ส่งผลให้บรรยากาศการลงทุนทั่วโลกกลับมาดีขึ้น ขณะที่ปัจจัยภายในประเทศได้รับแรงสนับสนุนจากหุ้นขนาดใหญ่ โดยเฉพาะกลุ่มเทคโนโลยี แม้การขึ้นเครื่องหมาย XD ของหุ้นขนาดใหญ่ในกลุ่มธนาคารพาณิชย์จะกดดันดัชนีในช่วงปลายเดือนก็ตาม ด้านผลประกอบการไตรมาสแรกของบริษัทจดทะเบียนโดยรวมออกมาดีกว่าที่ตลาดคาด ช่วยหนุนแรงซื้อแบบเลือกลงทุนในบางกลุ่มอุตสาหกรรม ขณะที่กนง. มีมติคงอัตราดอกเบี้ยนโยบายและยังคงมุมมองการเติบโตเศรษฐกิจไทยไว้ในระดับเดิม แม้ตลาดยังมีความผันผวนสูง แต่ความเชื่อมั่นของนักลงทุนปรับตัวดีขึ้นจากเดือนก่อนหน้า โดยนักลงทุนรายย่อยเป็นฝ่ายซื้อสุทธิหลักของตลาด ขณะที่นักลงทุนสถาบัน นักลงทุนต่างชาติ และบัญชีบริษัทหลักทรัพย์เป็นผู้ขายสุทธิ

ในเดือนพฤษภาคม 2569 ปรับตัวเพิ่มขึ้นอย่างแข็งแกร่งจนสามารถทำสถิติสูงสุดในรอบหลายปีและฟื้นตัวกลับขึ้นมาเหนือระดับสำคัญ 1,500 จุดได้อย่างรวดเร็ว โดยได้รับแรงหนุนสำคัญจากสถานการณ์ภูมิรัฐศาสตร์ในตะวันออกกลางที่เริ่มคลี่คลาย ส่งผลให้ราคาน้ำมันดิบในตลาดโลกปรับตัวลดลงอย่างเห็นได้ชัดและช่วยคลายความกังวลด้านอุปทานพลังงาน ขณะที่ปัจจัยภายในประเทศได้รับแรงส่งจากตัวเลขเศรษฐกิจมหภาคที่ดีกว่าคาด ทั้งการเติบโตของผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศในไตรมาสแรก ตัวเลขการส่งออกที่ขยายตัวต่อเนื่อง และการที่ธนาคารแห่งประเทศไทย (ธปท.) ปรับเพิ่มคาดการณ์แนวโน้มเศรษฐกิจไทย รวมถึงมาตรการกระตุ้นการบริโภคจากภาครัฐ นอกจากนี้ ตลาดยังได้แรงขับเคลื่อนจากกระแสการลงทุนในธีมเทคโนโลยีและปัญญาประดิษฐ์ระดับโลกที่หนุนนำให้เกิดแรงซื้อในหมวดขึ้นส่วนอิเล็กทรอนิกส์อย่างคึกคัก

แนวโน้มการลงทุน

แนวโน้มดัชนีในเดือนมิถุนายน 2569 คาดว่าจะมีลักษณะแกว่งตัวในลักษณะทรงตัวถึงขาขึ้นต่อเนื่อง (Sideway Up) เพื่อรักษาระดับฐานที่เพิ่งฟื้นตัวขึ้นมา โดยตลาดได้รับแรงขับเคลื่อนต่อเนื่องจากโมเมนตัมเศรษฐกิจในประเทศที่แข็งแกร่ง ทั้งานิสัยของมาตรการกระตุ้นการบริโภค "ไทยช่วยไทย พลัส" ที่จะเริ่มเห็นผลชัดเจนขึ้น และความเชื่อมั่นที่เพิ่มขึ้นหลัง ธปท. ปรับเพิ่มประมาณการเติบโตทางเศรษฐกิจ ขณะที่กลุ่มขึ้นส่วนอิเล็กทรอนิกส์และเทคโนโลยียังมีโอกาสนำตลาดตามกระแสเมกะเทรนด์โลก แต่อย่างไรก็ตาม ตลาดอาจเผชิญแรงกดดันและมีความผันผวนระหว่างทางจากการปรับสมดุลของราคาน้ำมันดิบในตลาดโลกหลังผ่านช่วงลดความตึงเครียดทางภูมิรัฐศาสตร์ รวมถึงแรงขายทำกำไรระยะสั้นของนักลงทุนสถาบันในประเทศที่อาจเกิดขึ้นต่อเนื่องจากเดือนก่อนหน้า ทั้งนี้ สิ่งที่ต้องติดตามอย่างใกล้ชิดคือความต่อเนื่องของกระแสเงินทุนเคลื่อนย้ายจากนักลงทุนต่างชาติว่า จะยังคงเดินทางซื้อสุทธิเพื่อผลักดันดัชนีต่อไปได้มากน้อยเพียงใด

แนวทางการบริหารกองทุนตราสารทุนยังคงเป็นการคัดเลือกหลักทรัพย์ที่จะลงทุนรายตัว จากข้อมูลที่ได้รับจากการพบปะกับผู้บริหารบริษัทจดทะเบียนฯ การวิเคราะห์บริษัทจดทะเบียนฯ ทั้งในเชิงคุณภาพ และเชิงปริมาณ รวมถึงการติดตามผลการดำเนินงานของบริษัทจดทะเบียนฯ อย่างสม่ำเสมอ โดยบริษัทฯ เชื่อว่าแนวทางการบริหารกองทุนตราสารทุนดังกล่าวจะเป็นสิ่งที่ส่งเสริมให้กองทุนสามารถสร้างผลตอบแทนจากการลงทุนในตลาดหลักทรัพย์ฯ ที่ดีในระยะกลาง และระยะยาว

บริษัทฯ ใคร่ขอขอบพระคุณท่านผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุนที่ได้มอบความไว้วางใจให้บริษัทฯ เป็นผู้บริหารเงินลงทุนของท่าน ทั้งนี้ บริษัทฯ จะพิจารณาดำเนินนโยบายการลงทุนที่เหมาะสมกับสถานการณ์ด้วยความระมัดระวัง และคำนึงถึงผลประโยชน์สูงสุดของผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุนเป็นสำคัญ

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด

ความเห็นของผู้ดูแลผลประโยชน์

วันที่ 22 มิถุนายน 2569

เรียน ผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุนกองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นแอนด์ซีไทยเพื่อความยั่งยืน

ธนาคารกรุงเทพ จำกัด (มหาชน) ในฐานะผู้ดูแลผลประโยชน์ ได้ดูแลการจัดการกองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นแอนด์ซีไทยเพื่อความยั่งยืน ซึ่งจัดการโดยบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนกรุงศรี จำกัด สำหรับระยะเวลาตั้งแต่วันที่ 1 ธันวาคม 2568 ถึงวันที่ 31 พฤษภาคม 2569 แล้ว

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



(นางฤดี สิทฺธิชวลิต)

ธนาคารกรุงเทพ จำกัด (มหาชน)

ในฐานะผู้ดูแลผลประโยชน์

กองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นแอสส์เซทไทยเพื่อความยั่งยืน

งบแสดงฐานะการเงิน

ณ 31 พฤษภาคม 2569

	Unaudited (บาท)
สินทรัพย์	
เงินลงทุนตามราคายุติธรรม (ราคาทุน 1,832,198,103.67 บาท)	1,927,345,035.29
เงินฝากธนาคาร	28,143,211.06
ลูกหนี้	
จากดอกเบี้ย	63,098.51
จากการขายเงินลงทุน	1,924,422.62
จากการขายหน่วยลงทุน	969,951.00
จากเงินปันผล	454,397.00
รวมสินทรัพย์	1,958,900,115.48
หนี้สิน	
เจ้าหนี้	
จากการรับซื้อคืนหน่วยลงทุน	1,438,713.71
จากการซื้อเงินลงทุน	841,453.87
ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย	1,470,991.25
ภาษีเงินได้ค้างจ่าย	9,464.78
หนี้สินอื่น	40,497.33
รวมหนี้สิน	3,801,120.94
สินทรัพย์สุทธิ	1,955,098,994.54
สินทรัพย์สุทธิ:	
หน่วยลงทุนจดทะเบียน 300 ล้านหน่วย มูลค่าที่ตราไว้หน่วยละ 10 บาท	
ทุนที่ได้รับจากผู้ถือหน่วยลงทุน	1,825,898,774.05
กำไรสะสม	205,229,980.27
บัญชีปรับสมดุล	(76,029,759.78)
สินทรัพย์สุทธิ	1,955,098,994.54
ชนิดไทยเพื่อความยั่งยืนสะสมมูลค่า (KFTHAIESGA)	
สินทรัพย์สุทธิ	961,136,491.34
หน่วยลงทุนที่ออกจำหน่ายแล้ว ณ วันสิ้นปี (หน่วย)	89,761,999.0847
สินทรัพย์สุทธิต่อหน่วย	10.7076
ชนิดไทยเพื่อความยั่งยืนปันผล (KFTHAIESGD)	
สินทรัพย์สุทธิ	993,962,503.20
หน่วยลงทุนที่ออกจำหน่ายแล้ว ณ วันสิ้นปี (หน่วย)	92,827,878.3199
สินทรัพย์สุทธิต่อหน่วย	10.7075

กองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นแอนด์ซีไทยเพื่อความยั่งยืน
งบกำไรขาดทุนเบ็ดเสร็จ
สำหรับงวดบัญชีสิ้นสุดวันที่ 31 พฤษภาคม 2569

	Unaudited (บาท)
รายได้จากการลงทุน	
รายได้ดอกเบี้ย	81,490.27
รายได้เงินปันผล	71,301,828.27
รายได้จากการให้ยืมหลักทรัพย์	1,607.62
รวมรายได้	<u>71,384,926.16</u>
ค่าใช้จ่าย	
ค่าธรรมเนียมการจัดการ	5,991,283.59
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์	216,607.85
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน	1,382,603.87
ค่าธรรมเนียมวิชาชีพ	35,149.81
ค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์	528,713.23
รวมค่าใช้จ่าย	<u>8,154,358.35</u>
รายได้จากการลงทุนสุทธิ	<u>63,230,567.81</u>
รายการกำไร (ขาดทุน) สุทธิจากเงินลงทุน	
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิที่เกิดขึ้นจากเงินลงทุน	36,971,688.19
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิที่ยังไม่เกิดขึ้นจากเงินลงทุน	212,356,134.19
รวมรายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิจากเงินลงทุนที่เกิดขึ้นและยังไม่มีเกิดขึ้น	<u>249,327,822.38</u>
หัก ภาษีเงินได้	<u>(12,223.54)</u>
การเพิ่มขึ้นในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงานหลังหักภาษีเงินได้	<u>312,546,166.65</u>
การเพิ่มขึ้นในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงานแยกตามชนิดหน่วยลงทุน มีดังนี้	
ชนิดไทยเพื่อความยั่งยืนสะสมมูลค่า (KFTHAIESGA)	151,736,872.77
ชนิดไทยเพื่อความยั่งยืนปันผล (KFTHAIESGD)	160,809,293.88
รวม	<u><u>312,546,166.65</u></u>

กองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นแซนด์เซฟไทยเพื่อความยั่งยืน

งบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน

ณ 31 พฤษภาคม 2569

การแสดงรายละเอียดเงินลงทุนใช้การจัดกลุ่มตามประเภทของเงินลงทุนและประเภทของอุตสาหกรรม

ประเภทเงินลงทุน/ผู้ออกตราสาร/ผู้ออกหลักทรัพย์	หมายเลขตราสาร	อัตรา ดอกเบี้ย (%)	วันครบอายุ	เงินต้น (บาท) / จำนวนหุ้น	มูลค่ายุติธรรม (บาท)	Unaudited ร้อยละของ มูลค่าเงิน ลงทุน
หลักทรัพย์ในประเทศ						
เงินฝากออมทรัพย์						1.14
บมจ. ธ.ยูโอบี		0.500000	เมื่อทวงถาม	22,048,409.69	22,048,409.69	1.14
หุ้นจดทะเบียน						
หุ้นสามัญ						
กลุ่มเกษตรและอุตสาหกรรมอาหาร						
หมวดธุรกิจการเกษตร						
บมจ. ศรีตรังแอโกรอินดัสทรี	STA			350,200.00	6,723,840.00	0.35
หมวดอาหารและเครื่องดื่ม						
บมจ. เบทาโกร	BTG			467,900.00	9,311,210.00	0.48
บมจ. คาราวาโกรูป	CBG			252,600.00	10,167,150.00	0.53
บมจ. เจริญโภคภัณฑ์อาหาร	CPF			1,642,100.00	31,199,900.00	1.62
บมจ. ไอ-เทล คอร์ปอเรชั่น	ITC			363,600.00	5,853,960.00	0.30
บมจ. เอ็มเค เรสโตรองต์ กรุ๊ป	M			251,300.00	5,151,650.00	0.27
บมจ. โอสดสภา	OSP			441,900.00	6,761,070.00	0.35
บมจ. เซ็ปเป้	SAPPE			13,300.00	395,675.00	0.02
บมจ. ไทยยูเนี่ยน กรุ๊ป	TU			691,800.00	7,748,160.00	0.40
กลุ่มสินค้าอุปโภคบริโภค						
หมวดแฟชั่น						
บมจ. ออโรรา ดีไซน์	AURA			144,700.00	2,112,620.00	0.11
หมวดของใช้ส่วนตัวและเวชภัณฑ์						
บมจ. นีโอ คอร์ปอเรท	NEO			151,000.00	2,567,000.00	0.13
บมจ. ศรีตรังโกลฟ์ (ประเทศไทย)	STGT			261,900.00	3,011,850.00	0.16
กลุ่มธุรกิจการเงิน						
หมวดธนาคาร						
บมจ. ธ.กรุงเทพ	BBL			417,200.00	72,175,600.00	3.74
บมจ. ธ.กสิกรไทย	KBANK			494,800.00	99,454,800.00	5.16
บมจ. ธ.เกียรตินาคินภัทร	KKP			167,400.00	14,731,200.00	0.76
บมจ. ธ.กรุงไทย	KTB			2,592,900.00	90,103,275.00	4.67
บมจ. เอสซีบี เอกซ์	SCB			553,300.00	74,418,850.00	3.86
บมจ. ทุนธนชาติ	TCAP			48,300.00	2,885,925.00	0.15
บมจ. ทิสโก้ไฟแนนเชียลกรุ๊ป	TISCO			34,200.00	3,864,600.00	0.20
บมจ. ธ.ทหารไทยธนชาติ	TTB			15,596,900.00	35,560,932.00	1.85

กองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นแซนด์เซฟไทยเพื่อความยั่งยืน

งบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน

ณ 31 พฤษภาคม 2569

การแสดงรายละเอียดเงินลงทุนใช้การจัดกลุ่มตามประเภทของเงินลงทุนและประเภทของอุตสาหกรรม

ประเภทเงินลงทุน/ผู้ออกตราสาร/ผู้ออกหลักทรัพย์	หมายเลขตราสาร	อัตรา ดอกเบี้ย (%)	วันครบอายุ	เงินต้น (บาท) / จำนวนหุ้น	มูลค่ายุติธรรม (บาท)	Unaudited ร้อยละของ มูลค่าเงิน ลงทุน
หมวดเงินลงทุนและหลักทรัพย์						
บมจ.อีออน ธนสินทรัพย์ (ไทยแลนด์)	AEONTS			33,300.00	3,155,175.00	0.16
บมจ.บริหารสินทรัพย์ กรุงเทพพาณิชย์	BAM			545,700.00	3,519,765.00	0.18
บมจ.บัตรกรุงไทย	KTC			566,200.00	16,986,000.00	0.88
บมจ.เมืองไทย แคปปิตอล	MTC			974,100.00	28,005,375.00	1.45
บมจ.ศรีสวัสดิ์ คอร์ปอเรชั่น	SAWAD			640,940.00	14,036,586.00	0.73
บมจ.ดีคัส โฮลดิ้งส์	TIDLOR			61,400.00	1,123,620.00	0.06
หมวดประกันภัยและประกันชีวิต						
บมจ.กรุงเทพประกันชีวิต	BLA			265,700.00	6,057,960.00	0.31
บมจ.ไทยประกันชีวิต	TLI			2,242,100.00	24,887,310.00	1.29
บมจ.ทีคิวเอ็ม อัลฟา	TQM			15,400.00	207,900.00	0.01
กลุ่มสินค้าอุตสาหกรรม						
หมวดบรรจุภัณฑ์						
บมจ.เอสซีจี แพคเกจจิ้ง	SCGP			883,000.00	20,838,800.00	1.08
หมวดปิโตรเคมีและเคมีภัณฑ์						
บมจ.อินโดรามา เวนเจอร์ส	IVL			1,374,400.00	32,023,520.00	1.66
บมจ.พีทีที โกลบอล เคมีคอล	PTTGC			1,009,500.00	33,818,250.00	1.75
กลุ่มอสังหาริมทรัพย์และก่อสร้าง						
หมวดวัสดุก่อสร้าง						
บมจ.อีสเทิร์น โพลีเมอร์ กู๊ป	EPG			763,600.00	4,428,880.00	0.23
บมจ.ปูนซิเมนต์ไทย	SCC			247,600.00	56,205,200.00	2.92
บมจ.ทีปโก้แอสฟัลท์	TASCO			274,600.00	3,789,480.00	0.20
หมวดบริการรับเหมาก่อสร้าง						
บมจ.ช.การช่าง	CK			652,600.00	11,746,800.00	0.61
บมจ.สเคคอน กู๊ป	STECON			442,100.00	6,940,970.00	0.36
หมวดพัฒนาอสังหาริมทรัพย์						
บมจ.อมตะ คอร์ปอเรชั่น	AMATA			375,800.00	9,207,100.00	0.48
บมจ.เอพี (ไทยแลนด์)	AP			650,600.00	4,749,380.00	0.25
บมจ.แอสเสท เวิร์ด คอร์ป	AWC			9,466,400.00	21,583,392.00	1.12
บมจ.เซ็นทรัลพัฒนา	CPN			813,100.00	52,444,950.00	2.72
บมจ.แลนด์แอนด์เฮาส์	LH			2,672,400.00	9,620,640.00	0.50
บมจ.พญาโฮม	PSH			272,900.00	933,318.00	0.05
บมจ.สุภาลัย	SPALI			135,300.00	2,097,150.00	0.11
บมจ.ดับบลิวเอชเอ คอร์ปอเรชั่น	WHA			4,096,700.00	20,073,830.00	1.04

กองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นแซนด์เซิร์ทไทยเพื่อความยั่งยืน

งบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน

ณ 31 พฤษภาคม 2569

การแสดงรายละเอียดเงินลงทุนใช้การจัดกลุ่มตามประเภทของเงินลงทุนและประเภทของอุตสาหกรรม

ประเภทเงินลงทุน/ผู้ออกตราสาร/ผู้ออกหลักทรัพย์	หมายเลขตราสาร	อัตรา ดอกเบี้ย (%)	วันครบอายุ	เงินต้น (บาท) / จำนวนหุ้น	มูลค่ายุติธรรม (บาท)	Unaudited ร้อยละของ มูลค่าเงิน ลงทุน
กลุ่มทรัพยากร						
หมวดพลังงานและสาธารณูปโภค						
บมจ.บ้านปู	BANPU			2,379,300.00	13,562,010.00	0.70
บมจ.บี.กริม เพาเวอร์	BGRIM			1,069,100.00	14,860,490.00	0.77
บมจ.ซีเค เพาเวอร์	CKP			2,795,600.00	6,429,880.00	0.33
บมจ.ผลิตไฟฟ้า	EGCO			98,000.00	11,417,000.00	0.59
บมจ.โกลบอล เพาเวอร์ ซินเนอร์ยี	GPSC			844,700.00	34,210,350.00	1.77
บมจ.กัลฟ์ ดีเวลลอปเม้นท์	GULF			1,658,451.00	102,823,962.00	5.34
บมจ.ปตท. น้ำมันและการค้าปลีก	OR			2,725,300.00	33,793,720.00	1.75
บมจ.พีทีจี เอ็นเนอยี	PTG			300,200.00	2,191,460.00	0.11
บมจ.ปตท.	PTT			2,278,000.00	82,577,500.00	4.28
บมจ.ปตท.สำรวจและผลิตปิโตรเลียม	PTTEP			535,300.00	75,744,950.00	3.93
บมจ.ราช กรุ๊ป	RATCH			273,400.00	8,407,050.00	0.44
บมจ.สตาร์ ปิโตรเลียม รีไฟน์นิ่ง	SPRC			904,300.00	6,691,820.00	0.35
บมจ.ไทยออยล์	TOP			516,100.00	23,869,625.00	1.24
บมจ.ดับบลิวเอชเอ ยูทิลิตี้ส์ แอนด์ เพาเวอร์	WHAUP			482,900.00	2,752,530.00	0.14
กลุ่มบริการ						
หมวดพาณิชย์						
บมจ.เบอร์ลี่ ยุคเกอร์	BJC			1,260,200.00	17,894,840.00	0.93
บมจ.คอมเซเว่น	COM7			756,500.00	19,669,000.00	1.02
บมจ.ซีพี ออลล์	CPALL			2,016,900.00	95,298,525.00	4.94
บมจ.เซ็นทรัล รีเทล คอร์ปอเรชั่น	CRC			1,477,300.00	31,171,030.00	1.62
บมจ.สยามโกลบอลเฮาส์	GLOBAL			1,371,059.00	10,145,836.60	0.53
บมจ.โฮมโปร คัดส์ เซ็นเตอร์	HMPRO			2,928,300.00	17,716,215.00	0.92
บมจ.เมก้าไลฟ์ไชเอนซ์	MEGA			113,400.00	4,082,400.00	0.21
บมจ.มิสเตอร์. ดี.ไอ.วาย. โฮลดิ้ง (ประเทศไทย)	MRDIYT			303,600.00	2,641,320.00	0.14
หมวดการแพทย์						
บมจ.บางกอก เชน ฮอสปิเทล	BCH			519,800.00	4,912,110.00	0.25
บมจ.กรุงเทพดุสิตเวชการ	BDMS			3,195,500.00	58,158,100.00	3.02
บมจ.โรงพยาบาลบำรุงราษฎร์	BH			160,200.00	28,755,900.00	1.49
บมจ.โรงพยาบาลจุฬารัตน์	CHG			784,900.00	1,130,256.00	0.06
หมวดการท่องเที่ยวและสันทนาการ						
บมจ.โรงแรมเซ็นทรัลพลาซา	CENTEL			377,700.00	12,747,375.00	0.66
บมจ.ดิ เอราวัณ กรุ๊ป	ERW			2,344,800.00	6,706,128.00	0.35
บมจ.ไมเนอร์ อินเตอร์เนชั่นแนล	MINT			1,882,100.00	42,347,250.00	2.20

กองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นแซนด์เซ็ทไทยเพื่อความยั่งยืน

งบประมาณรายละเอียดการลงทุน

ณ 31 พฤษภาคม 2569

การแสดงรายละเอียดการลงทุนใช้การจัดกลุ่มตามประเภทของเงินลงทุนและประเภทของอุตสาหกรรม

ประเภทเงินลงทุน/ผู้ออกตราสาร/ผู้ออกหลักทรัพย์	หมายเลขตราสาร	อัตรา ดอกเบี้ย (%)	วันครบอายุ	เงินต้น (บาท) / จำนวนหุ้น	มูลค่ายุติธรรม (บาท)	Unaudited ร้อยละของ มูลค่าเงิน ลงทุน
หมวดขนส่งและโลจิสติกส์						
บมจ.เอเชีย เอวิชั่น	AAV			9,425,700.00	10,274,013.00	0.53
บมจ.ท่าอากาศยานไทย	AOT			1,822,700.00	100,704,175.00	5.23
บมจ.การบินกรุงเทพ	BA			580,500.00	9,055,800.00	0.47
บมจ.ทางด่วนและรถไฟฟ้ากรุงเทพ	BEM			2,288,600.00	11,900,720.00	0.62
บมจ.บีทีเอส กรุ๊ป โฮลดิ้งส์	BTS			9,037,800.00	18,437,112.00	0.96
บมจ.พีริแอส จีพี	PSL			138,200.00	1,057,230.00	0.05
บมจ.เอสซีจี เจดับเบิ้ลยูดี โลจิสติกส์	SJWD			519,100.00	3,945,160.00	0.20
บมจ.การบินไทย	THAI			372,500.00	2,495,750.00	0.13
กลุ่มเทคโนโลยี						
หมวดชิ้นส่วนอิเล็กทรอนิกส์						
บมจ.ฮานา ไมโครอิเล็กทรอนิกส์	HANA			219,900.00	8,191,275.00	0.43
บมจ.เคซีอี อิเล็กทรอนิกส์	KCE			450,800.00	16,905,000.00	0.88
หมวดเทคโนโลยีสารสนเทศและการสื่อสาร						
บมจ.แอดวานซ์ อินโฟร์ เซอร์วิส	ADVANC			190,000.00	67,070,000.00	3.48
บมจ.ทรู คอร์ปอเรชั่น	TRUE			715,300.00	9,871,140.00	0.51
					1,927,345,035.29	100.00

กองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นแซนด์เซฟไทยเพื่อความยั่งยืน

รายละเอียดการลงทุน ณ 31 พฤษภาคม 2569

	มูลค่าตามราคาตลาด	% NAV
หลักทรัพย์หรือทรัพย์สินในประเทศ	1,955,551,344.86	100.03
หุ้นสามัญ		
จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์		
การท่องเที่ยวและสันทนาการ	61,800,753.00	3.16
การแพทย์	92,956,366.00	4.75
ขนส่งและโลจิสติกส์	157,869,960.00	8.07
ของใช้ส่วนตัวและเวชภัณฑ์	5,578,850.00	0.29
เงินทุนและหลักทรัพย์	66,826,521.00	3.42
ชิ้นส่วนอิเล็กทรอนิกส์	25,096,275.00	1.28
เทคโนโลยีสารสนเทศและการสื่อสาร	76,941,140.00	3.94
ธนาคาร	393,195,182.00	20.11
ธุรกิจการเกษตร	6,723,840.00	0.34
บรรจุภัณฑ์	20,838,800.00	1.07
บริการรับเหมาก่อสร้าง	18,687,770.00	0.96
ประกันภัยและประกันชีวิต	31,153,170.00	1.59
ปิโตรเคมีและเคมีภัณฑ์	65,841,770.00	3.37
พลังงานและสาธารณูปโภค	419,332,347.00	21.45
พัฒนาอสังหาริมทรัพย์	120,709,760.00	6.17
พาณิชย์	198,619,166.60	10.16
แฟชั่น	2,112,620.00	0.11
วัสดุก่อสร้าง	64,423,560.00	3.30
อาหารและเครื่องดื่ม	76,588,775.00	3.92
เงินฝากธนาคาร		
FITCH_TH-LONG		
Rate AAA	22,091,718.11	1.13

กองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นแอนด์เซฟไทยเพื่อความยั่งยืน

รายละเอียดการลงทุน ณ 31 พฤษภาคม 2569

	มูลค่าตามราคาตลาด	% NAV
Rate BBB	28,163,001.15	1.44
อื่นๆ	(452,350.32)	(0.03)
ลูกหนี้	3,348,770.62	0.17
เจ้าหนี้	(2,330,129.69)	(0.12)
ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย	(1,470,991.25)	(0.08)
มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ	1,955,098,994.54	100.00

คำอธิบายการจัดอันดับตราสารของสถาบันจัดอันดับความน่าเชื่อถือ

• ตราสารหนี้ระยะกลางและระยะยาว

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

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

ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (Fund's Direct Expenses)

กองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นแอสส์เซิทไทยเพื่อความยั่งยืน

ตั้งแต่วันที่ 1 ธันวาคม 2568 ถึงวันที่ 31 พฤษภาคม 2569

ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (Fund's Direct Expenses)	จำนวนเงิน (หน่วย: พันบาท)	ร้อยละของมูลค่า ทรัพย์สิน* (ต่อปี) 1/
ค่าธรรมเนียมการจัดการ (Management Fee)	5,991.28	0.6955
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ (Trustee Fee)	216.61	0.0251
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน (Registrar Fee)	1,382.60	0.1605
ค่าที่ปรึกษาการลงทุน (Advisory Fee)	-	-
ค่าธรรมเนียมสอบบัญชี (Auditing Fee)	35.15	0.0041
ค่าใช้จ่ายอื่น ๆ (Others)	-	-
รวมค่าใช้จ่ายทั้งหมด 2/	7,625.64	0.8852

หมายเหตุ

1/ ค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวมข้างต้น เป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่มหรือภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว

2/ ไม่รวมค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ และค่าธรรมเนียมต่าง ๆ ที่เกิดขึ้นจากการซื้อขายหลักทรัพย์

* มูลค่าทรัพย์สิน ในที่นี้ หมายถึง มูลค่าทรัพย์สินทั้งหมด หักด้วย มูลค่าหนี้สินทั้งหมด

เว้นแต่ค่าธรรมเนียมการจัดการ ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ ค่าธรรมเนียมนายทะเบียนหน่วยลงทุน

ค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์
กองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นแฮนซ์เซ็ทไทยเพื่อความยั่งยืน / Krungsri Enhanced SET Thailand ESG Fund
ตั้งแต่วันที่ 1 ธันวาคม 2568 ถึงวันที่ 31 พฤษภาคม 2569

บริษัท	จำนวนเงิน	อัตราส่วน
	(บาท)	(%)
บมจ.หลักทรัพย์ เคจีไอ (ประเทศไทย) / KGI Securities (Thailand) Plc.	290,875.99	39.78
บจ.หลักทรัพย์ กรุงไทย เอ็กซ์สปริง จำกัด / Krungthai XSpring Securities Co.,Ltd.	201,411.07	27.54
บมจ.หลักทรัพย์ เกียรตินาคินภัทร / Kiatnakin Phatra Securities Plc.	40,181.24	5.49
บจ.หลักทรัพย์ ซิตี้คอร์ป (ประเทศไทย) / Citicorp Securities (Thailand) Ltd.	36,332.22	4.97
บจ.หลักทรัพย์ ซีจีเอส อินเตอร์เนชั่นแนล (ประเทศไทย) / CGS International Securities (Thailand) Co.,Ltd.	34,184.79	4.67
บมจ.หลักทรัพย์ บัวหลวง / Bualuang Securities Plc.	31,825.53	4.35
บจ.หลักทรัพย์ อินโนเวสต์ เอกซ์ / InnovestX Securities Co., Ltd.	18,896.94	2.58
บจ.หลักทรัพย์ ซี แอล เอส เอ (ประเทศไทย) / CLSA Securities (Thailand) Ltd.	18,225.71	2.49
บจ.หลักทรัพย์ ทิสโก้ / Tisco Securities Co.,Ltd.	11,553.58	1.58
บมจ.หลักทรัพย์ กรุงศรี / Krungsri Securities Plc.	11,076.18	1.51
อื่นๆ / Other	36,686.14	5.02
รวม / Total	731,249.39	100.00

ผลการดำเนินงานของกองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นแซนด์ซีไทยเพื่อความยั่งยืน-ไทยเพื่อความยั่งยืนสะสมมูลค่า

ผลการดำเนินงาน สิ้นสุด ณ วันที่ 29 พฤษภาคม 2569	% 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 (20 ธันวาคม 2566)
KFTHAIESGA	+17.09%	-0.26%	+20.18%	+30.00%	N/A	N/A	N/A	+2.84%
ดัชนีชี้วัด (Benchmark)*	+16.95%	0.00%	+20.34%	+30.61%	N/A	N/A	N/A	+4.37%
ความผันผวนของผลการดำเนินงาน	+18.10%	+19.65%	+17.02%	+17.24%	N/A	N/A	N/A	+16.36%
ความผันผวนของดัชนีชี้วัด	+17.44%	+19.04%	+16.40%	+16.48%	N/A	N/A	N/A	+15.86%

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 29 พฤษภาคม 2569	% 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 (20 ธันวาคม 2566)
KFTHAIESGD	+17.09%	-0.26%	+20.18%	+30.00%	N/A	N/A	N/A	+2.84%
ดัชนีชี้วัด (Benchmark)*	+16.95%	0.00%	+20.34%	+30.61%	N/A	N/A	N/A	+4.37%
ความผันผวนของผลการดำเนินงาน	+18.10%	+19.65%	+17.02%	+17.24%	N/A	N/A	N/A	+16.36%
ความผันผวนของดัชนีชี้วัด	+17.44%	+19.04%	+16.40%	+16.48%	N/A	N/A	N/A	+15.86%

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 ที่ผู้ถือหุ้นควรทราบ

(1) รายงานบุคคลที่เกี่ยวข้องที่มีการทำธุรกรรมในรอบเวลาที่ผ่านมา (วันที่ 1 ธันวาคม 2568 ถึงวันที่ 31 พฤษภาคม 2569)

ชื่อกองทุน	รายชื่อบุคคลที่เกี่ยวข้อง
กองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นแซนด์เซ็ทไทยเพื่อความยั่งยืน	1. บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด 2. บริษัทหลักทรัพย์ กรุงศรี จำกัด (มหาชน) 3. กองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นแซนด์เซ็ท 50 4. กองทุนเปิดกรุงศรี SET100 5. กองทุนเปิดกรุงศรี SET100 เพื่อการเลี้ยงชีพ 6. กองทุนเปิดกรุงศรี SET50 7. กองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นไอ 8. กองทุนสำรองเลี้ยงชีพ เซ็นทรัลพัฒนา ซึ่งจดทะเบียนแล้ว

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

(2) การรับผลประโยชน์ตอบแทนเนื่องจากการที่กองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นแซนด์เซ็ทไทยเพื่อความยั่งยืน ใช้บริการบุคคลอื่นๆ (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	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 ซีดีเคอร์ป (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 บัวหลวง จำกัด (มหาชน)	ข่าวสารและบทวิเคราะห์ต่างๆ	เพื่อประโยชน์ของกองทุน
16. บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)	ข่าวสารและบทวิเคราะห์ต่างๆ	เพื่อประโยชน์ของกองทุน
17. บริษัทหลักทรัพย์ ฟิลลิป (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)	ข่าวสารและบทวิเคราะห์ต่างๆ	เพื่อประโยชน์ของกองทุน
18. บริษัทหลักทรัพย์ ยูโอบี เคย์เฮียน (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)	ข่าวสารและบทวิเคราะห์ต่างๆ	เพื่อประโยชน์ของกองทุน
19. บริษัทหลักทรัพย์ ยูบีเอส (ประเทศไทย) จำกัด	ข่าวสารและบทวิเคราะห์ต่างๆ	เพื่อประโยชน์ของกองทุน
20. บริษัทหลักทรัพย์ อินโนเวสต์ เอกซ์ จำกัด	ข่าวสารและบทวิเคราะห์ต่างๆ	เพื่อประโยชน์ของกองทุน
21. บริษัทหลักทรัพย์ ทีทีบี เวิร์ธ จำกัด (มหาชน)	ข่าวสารและบทวิเคราะห์ต่างๆ	เพื่อประโยชน์ของกองทุน

(3) รายชื่อผู้จัดการกองทุน ณ วันที่ 31 พฤษภาคม 2569

1. นายทลิต โชคทิพย์พัฒนา
2. นายสาริต บัวชู
3. นางสาวสาวิณี สุขศรีวงศ์
4. นายปิติ ประดิพัทธ์พงษ์
5. นายกวิพ เจริญเสาวภาคย์
6. นายเอกชัย บุญยะพงศ์ไชย

(4) การเปิดเผยข้อมูลการถือหน่วยลงทุนเกิน 1 ใน 3 ณ วันที่ 31 พฤษภาคม 2569

ไม่มีการถือหน่วยลงทุนเกิน 1 ใน 3 ของบุคคลใดบุคคลหนึ่ง

ผู้ถือหน่วยลงทุนสามารถตรวจสอบข้อมูลสัดส่วนการถือหน่วยลงทุนโดยตรงได้ที่ www.krungsriasset.com

(5) อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุนของกองทุน (portfolio turnover ratio) ในรอบระยะเวลาที่ผ่านมา

- KFTHAIESGA (portfolio turnover ratio) 0.19 เท่า
- KFTHAIESGD (portfolio turnover ratio) 0.19 เท่า

รายงานการบริหารจัดการกองทุนรวมเพื่อความยั่งยืน

1 ถ้อยคำรับรองว่า บลจ.มีการบริหารจัดการกองทุนที่สอดคล้องกับการมุ่งความยั่งยืนตามหลักสากล

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด ขอรับรองว่าบลจ. มีการบริหารจัดการกองทุนที่สอดคล้องกับการมุ่งความยั่งยืนตามหลักสากล โดยบลจ. ได้ประกาศรับการปฏิบัติตามหลักธรรมาภิบาลการลงทุน เมื่อวันที่ 29 มิถุนายน 2560 และได้กำหนดนโยบายธรรมาภิบาลการลงทุน (Investment Governance Policy: I-Code) เพื่อเป็นหลักปฏิบัติสำหรับการลงทุน ภายใต้แนวคิดว่าการลงทุนในกิจการที่มีกลยุทธ์การกำกับดูแลที่ดี และมีความรับผิดชอบต่อสังคมและสิ่งแวดล้อมจะนำมาซึ่งผลตอบแทนที่ดีและยั่งยืนของลูกค้าและ/หรือผู้ถือหน่วยลงทุน โดยยึดประโยชน์ที่ดีที่สุดของผู้ลงทุน (Investor's First) เป็นสำคัญ ทั้งนี้ บลจ.ได้ยกระดับการบริหารจัดการกองทุนให้สอดคล้องกับแนวทางความยั่งยืนอย่างต่อเนื่อง ผ่านการกำหนดนโยบายและมาตรการสำคัญ อาทิเช่น การประกาศเจตนารมณ์ความร่วมมือด้านการลงทุนอย่างรับผิดชอบต่อสังคม (ESG Collaborative Engagement), การลงนามแนวปฏิบัติการระงับการลงทุน (Negative List Guideline) รวมถึงการจัดให้มีนโยบายการพิจารณาปัจจัยด้านสิ่งแวดล้อม สังคม และ ธรรมาภิบาลในการลงทุน (ESG policy)

2 รายงานเกี่ยวกับการจัดการกองทุนโดยมุ่งความยั่งยืนตามหลักสากล

12.2.1 ปัญหาหรือเหตุการณ์ร้ายแรงที่เกิดขึ้น และการเปลี่ยนแปลงการลงทุนในทรัพย์สินที่ได้ลงทุนไปแล้ว

บลจ.ได้ติดตามข่าวสารเกี่ยวกับกิจการที่ลงทุนอย่างสม่ำเสมอ กรณีที่พบว่ามีความเสี่ยงด้านหลักการกำกับดูแลกิจการที่ดี หรือมีประเด็นเกี่ยวกับความรับผิดชอบต่อสังคมและสิ่งแวดล้อม รวมถึงความยั่งยืนของกิจการ ที่ผู้จัดการลงทุนได้ดำเนินการติดตามสถานการณ์อย่างใกล้ชิด รวมถึงสอบถามไปยังกิจการที่ลงทุนอยู่ เพื่อขอรับคำชี้แจงถึงประเด็นดังกล่าว รวมถึงแนวทางการแก้ไขและป้องกันการเกิดปัญหาซ้ำ ทั้งนี้ ในรอบ 6 เดือน ที่ผ่านมา ได้พบประเด็นด้านความยั่งยืนในกิจการที่ลงทุนลงทุน อาทิเช่น ประเด็นที่เกี่ยวกับการดำเนินธุรกิจที่มีผลกระทบต่อลูกค้าหรือคู่ค้า เช่น การข่มขู่ผู้เอาประกันภัยของตัวแทนประกันชีวิต และการละเมิดทรัพย์สินทางปัญญาของผู้เข้าพื้นที่ รวมถึงประเด็นด้านกระบวนการกำกับดูแลกิจการ เช่น ข้อสงสัยในกระบวนการแต่งตั้งกรรมการบริษัทที่อาจไม่เหมาะสม และ ประเด็นการที่ผู้บริหารใช้ข้อมูลภายในในการซื้อขายหลักทรัพย์ ซึ่ง บลจ. ได้ดำเนินการติดต่อกับกิจการเพื่อสอบถามข้อสงสัย ขอคำอธิบายเหตุการณ์ และเน้นย้ำให้กิจการฯ ดำเนินมาตรการภายในที่เหมาะสมเพื่อป้องกันไม่ให้เกิดเหตุการณ์ซ้ำในอนาคต

12.2.2 ลักษณะเหตุผล และ ความจำเป็นในการพบปะผู้บริหารของกิจการ หรือผู้ออกตราสารที่กองทุนรวมเพื่อความยั่งยืนไปลงทุน รวมถึงผลจากการพบปะดังกล่าว

ในรอบ 6 เดือนที่ผ่านมา บลจ. ได้เข้าพบปะผู้บริหารของกิจการ และสอบถามเกี่ยวกับประเด็นนำสงสัย ด้านความยั่งยืนของกิจการ ทั้งนี้ ในประเด็นด้านการข่มขู่ของตัวแทนประกันชีวิต กิจการฯ ได้ชี้แจงว่าจะกำหนดมาตรการดำเนินการเพื่อป้องกันความเสี่ยงมิให้เกิดเหตุการณ์ในลักษณะดังกล่าวขึ้นอีก ในด้านผู้เข้าพื้นที่ละเมิดทรัพย์สินทางปัญญา กิจการฯ

ได้ยืนยันความร่วมมืออย่างเต็มที่กับหน่วยงานภาครัฐ โดยระบุว่าจะยกเลิกสัญญาเช่าพื้นที่เมื่อพบว่าผู้เช่ามีความผิดฐานจำหน่ายสินค้าปลอม นอกจากนี้ กิจการฯ ยังได้เพิ่มความเข้มงวดในการคัดกรองผู้เช่า จัดให้มีการตรวจสอบภายในอย่างสม่ำเสมอ และดำเนินโครงการรณรงค์อย่างต่อเนื่องเพื่อป้องกันการละเมิดทรัพย์สินทางปัญญา และส่งเสริมสภาพแวดล้อมทางธุรกิจที่เป็นธรรมและโปร่งใสตามมาตรฐานสากล สำหรับประเด็นด้านกระบวนการแต่งตั้งคณะกรรมการบริษัท กิจการฯ ได้ชี้แจงว่า กิจการฯ มีคณะกรรมการสรรหาและกำหนดค่าตอบแทนทำหน้าที่รับผิดชอบในการพิจารณาแต่งตั้งกรรมการบริษัทใหม่เพื่อทดแทนกรรมการที่ลาออกอย่างเหมาะสม และเป็นไปตามหลักการกำกับดูแลกิจการที่ดี ในขณะที่ประเด็นด้านผู้บริหารใช้ข้อมูลภายในในการซื้อขายหลักทรัพย์นั้น กิจการฯ จะดำเนินการเพิ่มนโยบายมาตรการ และกระบวนการทำงานที่เกี่ยวข้อง เพื่อป้องกันไม่ให้เกิดเหตุการณ์ที่ผู้บริหารของกิจการฯ ใช้ข้อมูลภายในในการซื้อขายหลักทรัพย์ในอนาคต

12.2.3 ความเสี่ยงที่เกี่ยวข้องกับความยั่งยืน และการนำปัจจัยความเสี่ยงดังกล่าวมาประกอบการตัดสินใจลงทุน

บลจ. ให้ความสำคัญในการนำปัจจัยความเสี่ยงที่เกี่ยวข้องกับการกำกับดูแลกิจการที่ดี และความรับผิดชอบต่อสังคมและสิ่งแวดล้อมมาเป็นส่วนหนึ่งในการวิเคราะห์ข้อมูลเพื่อการพิจารณาตัดสินใจลงทุน โดยบลจ. ได้จัดให้มันนโยบายการพิจารณาปัจจัยด้าน สิ่งแวดล้อม สังคม และธรรมาภิบาลในการลงทุน (ESG Policy) เพื่อนำมาเป็นกรอบและแนวทางในการพิจารณาลงทุน และ บลจ. ยังได้จัดให้มีกระบวนการในการติดตามการดำเนินงานและผลประกอบการของกิจการที่ลงทุนอย่างใกล้ชิดและสม่ำเสมอ เพื่อให้มั่นใจว่า กลยุทธ์การบริหารจัดการของกิจการที่ลงทุนสามารถนำไปสู่ผลที่ต้องการ และได้ปฏิบัติให้เป็นไปตามหลักการดำเนินธุรกิจอย่างมีบรรษัทภิบาลด้วยความรับผิดชอบต่อสังคมและสิ่งแวดล้อม โดยทีมจัดการลงทุนยึดมั่นตามแนวปฏิบัติของบลจ. คือ มีการติดตามกิจการที่ลงทุนอย่างใกล้ชิด ซึ่งทีมจัดการลงทุนได้เข้าพบผู้บริหารของบริษัทจดทะเบียนฯ โดยเน้นเข้าร่วมประชุมทั้งที่บริษัท และผ่านสื่ออิเล็กทรอนิกส์ (Conference Call) ตลอดจนการทบทวนกิจการที่ลงทุนอย่างสม่ำเสมอ

นอกจากนี้ บลจ. ได้นำส่งแบบสอบถามด้าน ESG (ESG Questionnaires) ไปยังทุกกิจการภายใต้ Universe การลงทุน โดยทีมจัดการลงทุนได้ใช้ข้อมูลจาก ESG Questionnaires เป็นส่วนหนึ่งในการพิจารณาให้คะแนนด้าน ESG และเป็นข้อมูลประกอบในการเข้าพบกับกิจการที่ลงทุน ทั้งนี้ บลจ. ได้พิจารณาถึงข้อมูลต่างๆ ทั้งผลประกอบการของกิจการที่ลงทุน คุณภาพของการรายงานและการเปิดเผยข้อมูล การประชุมผู้ถือหุ้น และข้อมูลข่าวสารที่เกี่ยวข้องของกิจการที่ลงทุน เพื่อให้การติดตามทันต่อเหตุการณ์ ในการนี้ หากมีเหตุการณ์ที่อาจจะมีผลกระทบต่อการทำงานของกิจการที่ลงทุน หรือมีข้อกังวล หรือพบว่ากิจการที่ลงทุนไม่ปฏิบัติตามหลักการกำกับดูแลกิจการที่ดี หรือมีประเด็นเกี่ยวกับความรับผิดชอบต่อสังคม และสิ่งแวดล้อม บลจ. ได้นำมาเป็นปัจจัยในการพิจารณาเกี่ยวกับการลงทุนในกิจการนั้นๆ

12.2.4 ผลจากการบริหารจัดการลงทุนอย่างยั่งยืน

บลจ. มีความเชื่อมั่นว่าการดำเนินการตามหลักการบริหารการลงทุนอย่างยั่งยืน ภายใต้แนวคิดที่ว่า การลงทุนในกิจการที่มีกลยุทธ์การกำกับดูแลที่ดี และมีความรับผิดชอบต่อสังคมและสิ่งแวดล้อม จะนำมาซึ่งผลตอบแทนที่ดีและยั่งยืน แก่ผู้ลงทุน และมั่นใจได้ว่ากิจการที่บลจ. ลงทุนอยู่มีความยั่งยืนตามหลักสากล