กองทุนเปิดกรุงศรี SET50 ไทยเพื่อความยั่งยืนแบบพิเศษ-เงินลงทุนเริ่มปี 2569

หน่วยลงทุนชนิดเงินลงทุนเริ่มปี 2569

KFS50-THAIESGX-69

ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมตราสารทุน / กองทุนรวมดัชนี / กองทุนรวมเพื่อความยั่งยืน (SRI Fund) / กองทุนรวมไทยเพื่อความยั่งยืนแบบพิเศษ / กองทุนรวมที่มีนโยบายเปิดให้มีการลงทุนในกองทุนรวมอื่นภายใต้ บลจ. เดียวกัน
- กองทุนรวมที่ลงทุนแบบมีความเสี่ยงทั้งในและต่างประเทศ
- กลุ่มกองทุนรวม : SET 50 Index Fund

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- กองทุนเน้นลงทุนในหุ้นที่เป็นส่วนประกอบของดัชนีผลตอบแทนรวม SET50 Free Float Adjusted Market Capitalization Weighted (SET50FF TRI) (ดัชนีอ้างอิง) ซึ่งเป็นหุ้นที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยที่ได้รับการคัดเลือกจากตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยว่ามีความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน (ESG) และ/หรือมีการเปิดเผยข้อมูลเกี่ยวกับการปล่อยก๊าซเรือนกระจกหรือแผนการจัดการในการลดปริมาณการปล่อยก๊าซเรือนกระจก และ/หรือมีธรรมาภิบาล (Governance) ที่มีลักษณะตามประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุนกำหนด โดยกองทุนจะลงทุนเพื่อให้มี net exposure ในทรัพย์สินดังกล่าว โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน (สามารถดูวัตถุประสงค์การลงทุนและกรอบการลงทุนเกี่ยวกับ ESG ได้ที่ “ข้อมูลอื่น ๆ”)
- กองทุนอาจลงทุนในต่างประเทศได้ไม่เกินร้อยละ 15 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน โดยจะป้องกันความเสี่ยงด้านอัตราแลกเปลี่ยนตามดุลยพินิจของผู้จัดการกองทุน
- กองทุนอาจลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมภายใต้การจัดการของบริษัทจัดการไม่เกินร้อยละ 20 ของ NAV
- กองทุนอาจเข้าทำสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) เพื่อเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน (Efficient Portfolio Management) ซึ่งรวมถึงการป้องกันความเสี่ยง (Hedging) จากการลงทุน
- กองทุนจะดำรงค่าความผันผวนของส่วนต่างของผลตอบแทนเฉลี่ยของกองทุนรวมและผลตอบแทนของดัชนีชี้วัด (TE) ไม่เกิน 1.50% ต่อปี
- กองทุนมุ่งหวังให้ผลประกอบการเคลื่อนไหวตามดัชนีชี้วัด (Passive management/Index tracking)

ระดับความเสี่ยง

ต่ำ | 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | **6** | 7 | 8 | สูง

เสี่ยงสูง

ลงทุนในตราสารทุนเป็นหลักโดยเฉลี่ยในรอบปีไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน	13 พฤษภาคม 2568
วันเริ่มต้น class	5 มกราคม 2569
นโยบายการจ่ายเงินปันผล	ไม่จ่าย
อายุกองทุน	ไม่กำหนด
การป้องกันความเสี่ยง FX	ตามดุลยพินิจของผู้จัดการกองทุน

ผู้จัดการกองทุนรวม

นาย ฑลิต โชคทิพย์พัฒนา (5 มกราคม 2569)

นาย สาธิต บัวชู (5 มกราคม 2569)

ดัชนีชี้วัด

ดัชนีผลตอบแทนรวม SET50 Free Float Adjusted Market Capitalization Weighted (SET50FF TRI) สัดส่วน 100.00%

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (% ต่อปี)

* ขอยกเว้นการแสดงผลการดำเนินงานย้อนหลังตามปีปฏิทินกรณีกองทุนจัดตั้งในปีปัจจุบัน

ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด (% ต่อปี)

	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี *
กองทุน	N/A	-3.01	8.41	N/A
ดัชนีชี้วัด	N/A	-2.87	8.83	N/A
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	N/A	-3.48	7.93	N/A
ความผันผวนกองทุน	N/A	10.00	11.45	N/A
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	N/A	11.42	11.73	N/A

	3 ปี *	5 ปี *	10 ปี *	ตั้งแต่จัดตั้ง
กองทุน	N/A	N/A	N/A	25.91
ดัชนีชี้วัด	N/A	N/A	N/A	28.60
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	N/A	N/A	N/A	N/A
ความผันผวนกองทุน	N/A	N/A	N/A	15.40
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	N/A	N/A	N/A	16.21

* ผลตอบแทนที่มีอายุเกินหนึ่งปีจะแสดงเป็นผลตอบแทนต่อปี
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกันตามกลุ่ม SET 50 Index Fund

คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวมมิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต: ได้รับการรับรองจาก CAC

ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือบริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่องได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

www.krungsriasset.com

การซื้อหน่วยลงทุน

วันทำการซื้อ: ทุกวันทำการ

เวลาทำการ: 08:30 น. - 15:30 น.

การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ: 500 บาท

การซื้อครั้งถัดไปขั้นต่ำ: 500 บาท

การขายคืนหน่วยลงทุน

วันทำการขายคืน: ทุกวันทำการ

เวลาทำการ: 08:30 น. - 15:30 น.

การขายคืนขั้นต่ำ: ไม่กำหนด

ยอดคงเหลือขั้นต่ำ: ไม่กำหนด

ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน: ภายใน 5 วันทำการนับถัดจากวันทำรายการขายคืน โดยทั่วไปจะได้รับเงิน 3 วันทำการนับถัดจากวันทำรายการ (T+3)

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปี ของ NAV)

ค่าธรรมเนียมต่อไปนี้จะส่งผลกระทบต่อผู้ลงทุน เนื่องจากจะทำให้ผลตอบแทนจากการลงทุนลดลง ดังนั้น ผู้ลงทุนควรตรวจสอบทุกครั้งก่อนตัดสินใจลงทุน

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	**2.1400**	**0.5350**
ค่าตอบแทนแก่ผู้สนับสนุนการขายหรือรับซื้อคืนหน่วยลงทุนของกองทุนรวม (trailer fee): มี		
รวมค่าใช้จ่าย	**4.6545**	**0.7922**

หมายเหตุ

(1) หากกองทุนลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมภายใต้การจัดการเดียวกัน (กองทุนปลายทาง) บริษัทจัดการจะไม่เรียกเก็บค่าธรรมเนียมการจัดการซ้ำซ้อนกับกองทุนปลายทาง

(2) ค่าตอบแทนแก่ผู้สนับสนุนการขายหรือรับซื้อคืนหน่วยลงทุน (trailer fee) เป็นส่วนหนึ่งของค่าธรรมเนียมการจัดการ

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)

ผู้ลงทุนจะถูกเรียกเก็บค่าธรรมเนียมต่อไปนี้โดยตรงทุกครั้งเมื่อทำรายการซื้อขายหรือสับเปลี่ยนหน่วยลงทุน

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การขาย	2.00	ยังไม่เรียกเก็บ
การรับซื้อคืน	2.00	ยังไม่เรียกเก็บ
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า	2.00	ยังไม่เรียกเก็บ
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก	2.00	-
กรณีภายในบริษัทจัดการ	2.00	ยังไม่เรียกเก็บ
กรณีสับเปลี่ยนไปยังบริษัทจัดการอื่น	2.00 (โดยมีขั้นต่ำ 200 บาทต่อ 1 รายการ)	ยังไม่เรียกเก็บ
การโอนหน่วย	ไม่มี	ไม่มี
ค่าปรับกรณีขายคืนและสับเปลี่ยนออกก่อนระยะเวลาที่กำหนด	0.50	0.50 (กรณีถือหน่วยลงทุนน้อยกว่า 3 ปี)

หมายเหตุ

- ค่าธรรมเนียมดังกล่าวเป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว
- หากกองทุนลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมภายใต้การจัดการเดียวกัน บริษัทจัดการจะไม่เรียกเก็บค่าธรรมเนียมการขาย และ/หรือรับซื้อคืนหน่วยลงทุนซ้ำซ้อน
- บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ
- บริษัทจัดการจะไม่เรียกเก็บค่าปรับกรณีขายคืนและสับเปลี่ยนออกก่อนระยะเวลาที่กำหนด เฉพาะกรณีที่เป็นการสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนระหว่างกองทุนรวมไทยเพื่อความยั่งยืนแบบพิเศษด้วยกัน หรือระหว่างกองทุนรวมไทยเพื่อความยั่งยืนแบบพิเศษกับกองทุนรวมไทยเพื่อความยั่งยืน ทั้งภายใต้การบริหารของบริษัทจัดการและบริษัทจัดการอื่น (เฉพาะชนิดหน่วยลงทุนที่เปิดให้บริการเท่านั้น) โดยเป็นไปตามเงื่อนไขและช่วงเวลาที่บริษัทจัดการกำหนด

ข้อมูลเชิงสถิติ

Maximum Drawdown	**-8.99 %**
Recovering Period	**2 เดือน 6 วัน**
FX Hedging	**ยังไม่มีการลงทุนในต่างประเทศ**
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน	**0.10 เท่า**
Sharpe Ratio	**N/A**
Alpha	**0.00 %**
Beta	**1.01**
Tracking Error	**N/A**

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน (% NAV)

ตราสารทุนและหน่วยลงทุน	99.05
เงินฝาก หรือตราสารหนี้ที่สถาบันการเงินเป็นผู้ออก	1.89
ทรัพย์สินอื่น	0.21
หนี้สินอื่น	-1.15

การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม (% NAV)

หมวดธนาคาร	27.06
หมวดพลังงานและสาธารณูปโภค	22.37
หมวดชิ้นส่วนอิเล็กทรอนิกส์	8.56
หมวดเทคโนโลยีสารสนเทศและการสื่อสาร	7.28
หมวดพาณิชย์	6.95

ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก

Holding	% NAV
บมจ.ปตท.	8.77
บมจ.เดลต้า อีเลคโทรนิคส์ (ประเทศไทย)	8.14
บมจ.ธ.กสิกรไทย	6.65
บมจ.เอสซีบี เอกซ์	5.99
บมจ.กัลฟ์ ดีเวลลอปเมนท์	5.66

ข้อมูลอื่นๆ

- บริษัทจัดการจะปฏิบัติตามกฎเกณฑ์ของกองทุนต่างประเทศที่ไปลงทุน โดยรายงานการถือครองหน่วยลงทุนตั้งแต่ร้อยละ 10 ของจำนวนหน่วยลงทุนที่จำหน่ายได้แล้วทั้งหมดของกองทุนให้กับผู้มีอำนาจหน้าที่ของกองทุนต่างประเทศ และอาจนำส่งข้อมูลส่วนตัวของผู้ถือหน่วยลงทุนดังกล่าวเช่น สำเนาบัตรประจำตัวประชาชนและ/หรือสำเนาหนังสือเดินทาง เป็นต้น และ/หรือขอข้อมูลหรือเอกสารเพิ่มเติมอื่นใดจากผู้ถือหน่วยลงทุนในภายหลังก็ได้ เพื่อให้เป็นไปตามที่กองทุนต่างประเทศร้องขอ หากผู้ถือหน่วยลงทุนรายใดปฏิเสธการให้ข้อมูลหรือเอกสารเพิ่มเติมดังกล่าวหรือมีพฤติกรรมเข้าข่ายและ/หรือมีความผิดตามกฎหมายอันมีผลทำให้บริษัทจัดการไม่สามารถปฏิบัติตามกฎเกณฑ์ของกองทุนต่างประเทศได้ บริษัทจัดการขอสงวนสิทธิที่จะระงับหรือหยุดให้บริการและดำเนินการคืนเงินลงทุนตามมูลค่าหน่วยลงทุนให้แก่ผู้ถือหน่วยลงทุน โดยถือว่าได้รับความเห็นชอบจากผู้ถือหน่วยลงทุนแล้ว ทั้งนี้ ผู้ถือหน่วยลงทุนจะไม่สามารถนำเรื่องดังกล่าวมาใช้เป็นสิทธิเรียกร้องความเสียหายจากเหตุดังกล่าวจากบริษัทจัดการได้แต่อย่างใด

สรุปข้อมูลด้านความยั่งยืน (Sustainability Corner)

(1) ประเภทของกองทุนรวม SRI และเกณฑ์การพิจารณาโดยสรุป	
ประเภท SRI ตามวัตถุประสงค์	SRI Focus
เกณฑ์การพิจารณาโดยสรุป	การลงทุนของกองทุนซึ่งมุ่งเน้นลงทุนในหุ้นที่เป็นส่วนประกอบของดัชนี SET50FF TRI ที่มีความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อม (E) หรือ สังคม (S) หรือ ความยั่งยืน (ESG) ที่เป็นหุ้นที่ได้รับคัดเลือกจากตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET) ว่ามีความโดดเด่นด้าน ESG และ/หรือมีการเปิดเผยข้อมูลเกี่ยวกับการปล่อยก๊าซเรือนกระจก และ/หรือหุ้นที่มีคะแนน CGR 90 คะแนนขึ้นไปหรือเทียบเท่าและเปิดเผยเป้าหมายและแผนธุรกิจเกี่ยวกับการเพิ่มมูลค่าของกิจการ (CVUP) ผ่านช่องทางของ SET หรืออยู่ในโครงการส่งเสริมการเพิ่มมูลค่าของบริษัทจดทะเบียน (JUMP+) ของ SET ที่เปิดเผยเป้าหมายและแผนการดำเนินงานแล้ว

(2) เป้าหมายด้านความยั่งยืน	
เป้าหมายด้านความยั่งยืน	กองทุนไม่มีเป้าหมายด้านความยั่งยืนแบบเฉพาะเจาะจง โดยมุ่งลงทุนในหุ้นที่เป็นส่วนประกอบของดัชนี SET50FF TRI ที่ได้รับการประเมินจาก SET ESG Ratings ในระดับ BBB ขึ้นไป และ/หรือมีการเปิดเผยข้อมูลและตั้งเป้าหมายในการลดปริมาณการปล่อยก๊าซเรือนกระจก และ/หรือหุ้นที่ได้รับคะแนน CGR ตั้งแต่ 90 คะแนนขึ้นไปหรือเทียบเท่าที่เป็นหุ้น CVUP และ/หรือ JUMP+ ทั้งนี้ กองทุนมุ่งลงทุนในหลักทรัพย์ตามข้างต้นจากทุกกลุ่มอุตสาหกรรมเพื่อสร้างพอร์ตการลงทุนที่ประกอบด้วยผู้ที่มีความโดดเด่นด้านความยั่งยืนในภาพรวม

(3) กลยุทธ์การลงทุน (เพื่อการบรรลุวัตถุประสงค์ด้านความยั่งยืน)	
กลยุทธ์	- ESG Integration - Thematic (Sustainability) - Negative screening/Exclusions
เหตุผลและหลักการที่เลือกใช้กลยุทธ์ดังกล่าว	กองทุนมุ่งเน้นลงทุนในหลักทรัพย์ที่มีความโดดเด่นด้าน E หรือ S หรือ ESG โดยใช้กลยุทธ์การลงทุนตามข้างต้นที่ครอบคลุมทั้งการคัดกรองหลักทรัพย์ที่ไม่พึงประสงค์ออกจาก Investment Universe การเลือกลงทุนในหลักทรัพย์ที่ดำเนินธุรกิจสอดคล้องกับเป้าหมายด้านความยั่งยืนของกองทุน รวมไปถึงการนำปัจจัยด้านความยั่งยืนมาใช้ในการวิเคราะห์หลักทรัพย์ โดยอาจเลือกใช้ทุกกลยุทธ์ หรือกลยุทธ์ใดกลยุทธ์หนึ่งได้ขึ้นอยู่กับดุลยพินิจของบริษัทจัดการตามสภาวการณ์ในแต่ละขณะ ในการคัดเลือกหุ้นที่เป็นส่วนประกอบของดัชนี SET50FF TRI ที่มีคุณสมบัติด้าน ESG ที่กำหนด เพื่อให้การลงทุนด้านความยั่งยืนเป็นไปตามวัตถุประสงค์ของกองทุน

(4) กรอบการลงทุน	
ลักษณะ/ขอบเขตการลงทุนหลัก	หุ้นที่เป็นส่วนประกอบของดัชนี SET50FF TRI ที่เป็นหุ้นที่ได้รับการคัดเลือกจาก SET ว่ามีความโดดเด่นด้าน ESG/ที่ตั้งเป้าหมายลดปริมาณการปล่อยก๊าซเรือนกระจก/หุ้น CVUP หรือ JUMP+ ที่มีคะแนน CGR ตั้งแต่ 90 คะแนนขึ้นไป

ตารางสัดส่วนการลงทุนตามคุณลักษณะด้านความยั่งยืน (% ของ NAV)

คุณลักษณะด้านความยั่งยืน	สัดส่วน (% ของ NAV)
ตราสารทุน	
หุ้นกลุ่มที่ได้รับการจัดอันดับหรือคะแนนด้านความยั่งยืน	82.94
หุ้นกลุ่มที่เปิดเผยข้อมูลการปล่อยก๊าซเรือนกระจก (GHGs)	92.13
หุ้นกลุ่มที่มีธรรมาภิบาลดีเลิศและมีการเปิดเผยแผนธุรกิจที่เกี่ยวข้องกับการเพิ่มมูลค่าของกิจการ (corporate value up plan)	0.00
ตราสารหนี้	
ตราสารเพื่ออนุรักษ์สิ่งแวดล้อม (green bond)	0.00
ตราสารเพื่อความยั่งยืน (sustainability bond)	0.00
ตราสารส่งเสริมความยั่งยืน (sustainability-linked bond)	0.00
โทเคนดิจิทัลเพื่อการลงทุนกลุ่มความยั่งยืน	
โทเคนดิจิทัลเพื่ออนุรักษ์สิ่งแวดล้อม (green token)	0.00
โทเคนดิจิทัลเพื่อความยั่งยืน (sustainability token)	0.00
โทเคนดิจิทัลเพื่อส่งเสริมความยั่งยืน (sustainability-linked token)	0.00
ทรัพย์สินอื่น ๆ	
หน่วยทรัสต์ของทรัสต์เพื่อการลงทุนในอสังหาริมทรัพย์ที่ได้รับการจัดอันดับหรือคะแนนด้านความยั่งยืน	0.00
หน่วยลงทุนของกองทุนรวมโครงสร้างพื้นฐานที่ได้รับการจัดอันดับหรือคะแนนด้านความยั่งยืน	0.00
ผลรวมสัดส่วนการลงทุน	**175.07**

ข้อมูล ณ วันที่ 30 กันยายน 2569

หมายเหตุ

หลักทรัพย์หนึ่งตัวอาจมีคุณสมบัติตามเกณฑ์การลงทุนได้มากกว่าหนึ่งประเภท (เช่น บมจ. เอ ได้รับการจัดอันดับ ด้าน ESG และขณะเดียวกันมีการเปิดเผยข้อมูลการปล่อยก๊าซเรือนกระจก โดยที่บริษัทจัดการมีการติดตามตรวจสอบคุณสมบัติ ทั้ง 2 ประเภทดังกล่าว เป็นต้น) ดังนั้น ผลรวมของสัดส่วนการลงทุนจึงอาจแสดงค่ามากกว่า 100% ได้

ตารางสัดส่วนการลงทุนตามอันดับหรือคะแนนด้านสิ่งแวดล้อม หรือความยั่งยืน ของหุ้นกลุ่มที่มีความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อม หรือความยั่งยืน

อันดับหรือคะแนนด้านสิ่งแวดล้อม หรือความยั่งยืน	จำนวนบริษัท	สัดส่วน (% ของ NAV)
AAA	32	68.06
AA	9	13.19
A	1	1.69
ต่ำกว่า BBB / ไม่มี Rating	8	15.24
รวม	**42**	**82.94**
อันดับหรือคะแนนเฉลี่ยของพอร์ต AAA		

ข้อมูล ณ วันที่ 30 กันยายน 2569

หมายเหตุ

(1) บริษัทจัดการจะคำนวณเฉพาะหลักทรัพย์ที่ได้รับ ESG rating ตั้งแต่ BBB ขึ้นไป

(2) ตัวอย่างการคำนวณอันดับหรือคะแนนด้านสิ่งแวดล้อมหรือความยั่งยืน

สมมติว่ากองทุนมีสัดส่วนการลงทุนในหลักทรัพย์ที่ได้รับ ESG rating ระดับ AAA, AA, A และ BBB คิดเป็น 50%, 15%, 16% และ 5% ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิ (NAV) ตามลำดับ

โดยกำหนดค่าคะแนนให้แต่ละระดับเท่ากับ

AAA = 4 คะแนน

AA = 3 คะแนน

A = 2 คะแนน

BBB = 1 คะแนน

(หลักทรัพย์ที่มี ESG rating ต่ำกว่า BBB หรือไม่มี rating จะไม่นำมารวมในการคำนวณ)

ดังนั้น บริษัทจัดการจะคำนวณคะแนนเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักจากหลักทรัพย์ที่ได้รับ ESG rating ตั้งแต่ระดับ BBB ขึ้นไป ซึ่งมีสัดส่วนรวม 86% ของ NAV โดยนำสัดส่วนการลงทุนของแต่ละระดับมาคูณกับคะแนนที่กำหนด แล้วรวมผลลัพธ์และหารด้วยสัดส่วนการลงทุนรวมที่นำมาคำนวณ ดังนี้

คะแนนเฉลี่ยถ่วงน้ำหนัก = [(50 x 4) + (15 x 3) + (16 x 2) + (5 x 1)] / 86 = 3.28 คะแนน ดังนั้น จากผลการคำนวณกองทุนมีคะแนนเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักเท่ากับ 3.28 คะแนน ซึ่งตามเกณฑ์การแปลงคะแนนที่กำหนด สามารถจัดอยู่ในระดับ AA

ตารางการตั้งเป้าหมายลดก๊าซเรือนกระจกของหุ้นกลุ่มที่เปิดเผยข้อมูลเกี่ยวกับการปล่อยก๊าซเรือนกระจก ที่กองทุนรวมลงทุน

คุณสมบัติของบริษัทที่ลงทุน	จำนวนบริษัท	สัดส่วน (% ของ NAV)
บริษัทที่มีการตั้งปีเป้าหมายการลดก๊าซเรือนกระจก**ระยะสั้นและยาว**	6	13.03
บริษัทที่มีการตั้งปีเป้าหมายการลดก๊าซเรือนกระจก**เฉพาะระยะยาว**	1	0.38
บริษัทที่มีการตั้งปีเป้าหมายการลดก๊าซเรือนกระจก**เฉพาะระยะสั้น**	4	7.08
รวมบริษัทที่เปิดเผยก๊าซเรือนกระจกและมีการตั้งปีเป้าหมายการลดก๊าซเรือนกระจก	**11**	**20.49**

ข้อมูล ณ วันที่ 30 กันยายน 2569

ตารางปริมาณการปล่อยก๊าซเรือนกระจกรวมของหุ้นกลุ่มที่เปิดเผยข้อมูลการปล่อยก๊าซเรือนกระจก ที่กองทุนรวมลงทุน

ตัวชี้วัด	รอบการรายงาน ปีก่อนหน้า (ปี 2567)	รอบการรายงาน ปีปัจจุบัน (ปี 2568)	การเปลี่ยนแปลง YoY (%)
ปริมาณการปล่อยก๊าซเรือนกระจกรวม (ตัน CO_2e)	418,500,954.00	411,648,746.00	-1.64

ข้อมูล ณ วันที่ 30 กันยายน 2569

ตัวชี้วัดการพัฒนาของบริษัทที่ลงทุน	จำนวนบริษัท	สัดส่วน (% ของ NAV)
บริษัทที่ปริมาณการปล่อยก๊าซเรือนกระจกลดลงจากกรอบการรายงานปีก่อนหน้า (YoY)	26	56.06
บริษัทที่มีการปรับปีเป้าหมายการลดก๊าซเรือนกระจก ให้เร็วขึ้น	5	11.20
รวม	**31**	**67.26**

ข้อมูล ณ วันที่ 30 กันยายน 2569

หมายเหตุ

(1) ข้อมูลการปล่อยก๊าซเรือนกระจกในตารางนี้อ้างอิงจากข้อมูลล่าสุดที่บริษัทในพอร์ตเปิดเผย ณ วันที่ 30 กันยายน 2569 โดยข้อมูลรอบรายงานปีปัจจุบันหมายถึงข้อมูลปี 2568 และข้อมูลรอบรายงานปีก่อนหน้าหมายถึงข้อมูลปี 2567 การเปลี่ยนแปลง YoY คำนวณจากบริษัทที่มีข้อมูลครบทั้ง 2 ปี ทั้งนี้ บริษัทที่ยังไม่มีข้อมูลครบทั้ง 2 ปีไม่ได้ถูกรวมอยู่ในการคำนวณ YoY

(2) ข้อมูลปริมาณการปล่อยก๊าซเรือนกระจกรวมข้างต้น เป็นการเปิดเผยปริมาณการปล่อยก๊าซเรือนกระจกในลักษณะตัวเลขรวม (absolute) ของหุ้นกลุ่มที่เปิดเผยข้อมูลเกี่ยวกับการปล่อยก๊าซเรือนกระจกที่กองทุนรวมถือครอง มิใช่การคำนวณปริมาณการปล่อยก๊าซเรือนกระจกที่กองทุนรวมมีส่วนรับผิดชอบโดยตรง (financed emissions)

(3) การเปิดเผยปริมาณการปล่อยก๊าซเรือนกระจกรวม มีวัตถุประสงค์เพื่อสร้างความโปร่งใส โดยกองทุนรวมทำหน้าที่เป็นกลไกขับเคลื่อนกิจการให้มีการตั้งเป้าหมายระยะสั้นและยาวในการลดการปล่อยก๊าซเรือนกระจก และผลักดันกิจการให้ดำเนินธุรกิจโดยคำนึงถึงการลดการปล่อยก๊าซเรือนกระจกอย่างต่อเนื่อง

(4) ผู้ลงทุนควรพิจารณาข้อมูลนี้ร่วมกับปัจจัยอื่น เช่น รายงานการมีส่วนร่วมกับกิจการ (engagement) การใช้สิทธิออกเสียง ในนามกองทุนรวม เป็นต้น เพื่อให้ผู้ลงทุนเห็นภาพรวมของระดับการติดตามกิจการที่ลงทุนของบริษัทจัดการ และผลลัพธ์ ที่ตรวจสอบได้ ในการผลักดันให้กิจการที่ลงทุนลดการปล่อยก๊าซเรือนกระจกอย่างเป็นรูปธรรม

ตารางสรุปการลงทุนในหุ้นกลุ่ม corporate value up plan

ประเภทหุ้นกลุ่ม corporate value up	จำนวนบริษัท	สัดส่วน (% ของ NAV)
หุ้นกลุ่มที่มีแผนจะเข้ารับการประเมินด้านสิ่งแวดล้อม (E) หรือความยั่งยืน (ESG) จากผู้ประเมินผลการดำเนินงานด้านความยั่งยืนตามมาตรฐานสากล	0	0.00
หุ้นกลุ่มที่มีเป้าหมายและแผนการดำเนินงานเพื่อลดปริมาณ การปล่อยก๊าซเรือนกระจกของประเทศไทย	0	0.00
รวม	**0**	**0.00**

ข้อมูล ณ วันที่ 30 กันยายน 2569

ตารางความครอบคลุมการมีส่วนร่วมกับบริษัทในกลุ่ม corporate value up plan

จำนวนบริษัทที่บริษัทจัดการได้ไปมีส่วนร่วมแล้วในรอบการรายงาน (N)	จำนวนบริษัทในกลุ่ม corporate value up plan ที่กองทุนรวมลงทุน (M)	สัดส่วนความครอบคลุมของการมีส่วนร่วม (N/M, %)
0	0	0.00

ข้อมูล ณ วันที่ 30 กันยายน 2569

หมายเหตุ

(1) การมีส่วนร่วมกับบริษัทครอบคลุมการมีส่วนร่วมกับบริษัทโดยตรง (direct engagement) การร่วมมือกับผู้ลงทุนอื่น ตามความเหมาะสม (collective engagement) หรือการเข้าร่วมเวทีสาธารณะ (เช่น SET Opportunity Day) เพื่อสนับสนุน การดำเนินงานตาม corporate value up plan ของบริษัท

(2) นับบริษัทละ 1 ครั้งต่อรอบรายงาน หากเกิดการมีส่วนร่วมอย่างน้อยหนึ่งกิจกรรมในช่วงระยะเวลาการเปิดเผยข้อมูล

ตารางวัตถุประสงค์การใช้เงินที่ได้จากการระดมทุนของตราสารหนี้เพื่อความยั่งยืนที่ลงทุนสูงสุด 5 อันดับแรก

ลำดับ	ชื่อตราสาร - ชื่อโครงการ	วัตถุประสงค์การใช้เงินที่ได้จากการระดมทุน (use of proceeds)	สัดส่วน (% ของ NAV)
รวม			**0.00**

ข้อมูล ณ วันที่ 30 กันยายน 2569

ตารางสัดส่วนการลงทุนตามกลุ่มอุตสาหกรรมของผู้ออกตราสารหนี้เพื่อความยั่งยืน

กลุ่มอุตสาหกรรมของผู้ออกตราสารหนี้เพื่อความยั่งยืน	สัดส่วน (% ของ NAV)
รวม	**0.00**

ข้อมูล ณ วันที่ 30 กันยายน 2569

ตารางรายละเอียดของตัวชี้วัดและเป้าหมายด้านความยั่งยืนที่ผู้ออกตราสารหนี้ส่งเสริมความยั่งยืนกำหนด

ลำดับ	ชื่อผู้ออก	ตัวชี้วัดและเป้าหมายด้านความยั่งยืน	ระยะเวลาเป้าหมาย	ดอกเบี้ย (%)/ อัตราการเพิ่มขึ้นของดอกเบี้ยหากไม่บรรลุเป้าหมาย (bps)	สัดส่วน (% ของ NAV)
รวม					**0.00**

ข้อมูล ณ วันที่ 30 กันยายน 2569

ตารางสัดส่วนการลงทุนตามกลุ่มอุตสาหกรรมของผู้ออกตราสารหนี้ส่งเสริมความยั่งยืน

กลุ่มอุตสาหกรรมของผู้ออกตราสารหนี้ส่งเสริมความยั่งยืน	สัดส่วน (% ของ NAV)
รวม	**0.00**

ข้อมูล ณ วันที่ 30 กันยายน 2569

ตารางรายละเอียดด้านความยั่งยืนของโทเคนดิจิทัลเพื่อการลงทุนกลุ่มความยั่งยืน ที่ลงทุนสูงสุด 5 อันดับแรก

ลำดับ	ชื่อโทเคน	ประเภทโครงการอ้างอิง	รายละเอียดด้านความยั่งยืน	สัดส่วน (% ของ NAV)
รวม				**0.00**

ข้อมูล ณ วันที่ 30 กันยายน 2569

ตารางสัดส่วนการลงทุนตามอันดับหรือคะแนนด้าน E หรือ ESG ของ REITs หรือ Infra Funds

อันดับหรือคะแนนด้าน E หรือ ESG	จำนวนกองทุน	สัดส่วน (% ของ NAV)
AAA	0	0.00
AA	0	0.00
A	0	0.00
BBB	0	0.00
ต่ำกว่า BBB / ไม่มี Rating	0	0.00
รวม	**0**	**0.00**
อันดับหรือคะแนนเฉลี่ยของพอร์ต		

ข้อมูล ณ วันที่ 30 กันยายน 2569

คำอธิบาย

Maximum Drawdown เปอร์เซ็นต์ผลขาดทุนสูงสุดของกองทุนรวมในระยะเวลา 5 ปีย้อนหลัง (หรือตั้งแต่จัดตั้งกองทุนกรณีที่ยังไม่ครบ 5 ปี) โดยวัดจากระดับ NAV ต่อหน่วยที่จุดสูงสุดไปจนถึงจุดต่ำสุดในช่วงที่ NAV ต่อหน่วยปรับตัวลดลง ค่า Maximum Drawdown เป็นข้อมูลที่ช่วยให้ทราบถึงความเสี่ยงที่อาจจะขาดทุนจากการลงทุนในกองทุนรวม

Recovering Period ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาตั้งแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลานานเท่าใด

FX Hedging เปอร์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตกองทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลาหนึ่ง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อหลักทรัพย์กับผลรวมของมูลค่าการขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 1 ปีหารด้วยมูลค่า NAV ของกองทุนรวมเฉลี่ยในรอบระยะเวลาเดียวกัน กองทุนรวมที่มีค่า portfolio turnover สูงบ่งชี้ถึงการซื้อขายหลักทรัพย์บ่อยครั้งของผู้จัดการกองทุนและทำให้มีต้นทุนการซื้อขายหลักทรัพย์ที่สูง จึงต้องพิจารณเปรียบเทียบกับผลการดำเนินงานของกองทุนรวมเพื่อประเมินความคุ้มค่าของการซื้อขายหลักทรัพย์ดังกล่าว

Sharpe Ratio อัตราส่วนระหว่างผลตอบแทนส่วนเพิ่มของกองทุนรวมเปรียบเทียบกับความเสี่ยงจากการลงทุน โดยคำนวณจากผลต่างระหว่างอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมกับอัตราผลตอบแทนที่ปราศจากความเสี่ยง (risk-free rate) เปรียบเทียบกับค่าเบี่ยงเบนมาตรฐาน (standard deviation) ของกองทุนรวม ค่า Sharpe Ratio สะท้อนถึงอัตราผลตอบแทนที่กองทุนรวมควรได้รับเพิ่มขึ้นเพื่อชดเชยกับความเสี่ยงที่กองทุนรวมรับมา โดยกองทุนรวมที่มีค่า Sharpe Ratio สูงกว่าจะเป็นกองทุนที่มีประสิทธิภาพในการบริหารจัดการลงทุนที่ดีกว่าเนื่องจากได้รับผลตอบแทนส่วนเพิ่มที่สูงกว่าภายใต้ระดับความเสี่ยงเดียวกัน

Alpha ผลตอบแทนส่วนเกินของกองทุนรวมเมื่อเปรียบเทียบกับดัชนีชี้วัด (benchmark) โดยค่า Alpha ที่สูง หมายถึง กองทุนสามารถสร้างผลตอบแทนได้สูงกว่าดัชนีชี้วัด ซึ่งเป็นผลจากประสิทธิภาพของผู้จัดการกองทุนในการคัดเลือกหรือหาจังหวะเข้าลงทุนในหลักทรัพย์ได้อย่างเหมาะสม

Beta ระดับและทิศทางการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุน โดยเปรียบเทียบกับอัตราการเปลี่ยนแปลงของตลาด Beta น้อยกว่า 1 แสดงว่าหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนน้อยกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด Beta มากกว่า 1 แสดงว่า หลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนมากกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด

Tracking Error อัตราผลตอบแทนของกองทุนมีประสิทธิภาพในการเลียนแบบดัชนีชี้วัด โดยหาก tracking error ต่ำ หมายถึงกองทุนรวมมีประสิทธิภาพในการสร้างผลตอบแทนให้ใกล้เคียงกับดัชนีชี้วัด กองทุนรวมที่มีค่า tracking error สูง จะมีอัตราผลตอบแทนโดยเฉลี่ยห่างจากดัชนีชี้วัดมากขึ้น

Yield to Maturity อัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในตราสารหนี้โดยถือจนครบกำหนดอายุ ซึ่งคำนวณจากดอกเบี้ยที่จะได้รับในอนาคตตลอดอายุตราสารและเงินต้นที่จะได้รับคืนนำมาคิดลดเป็นมูลค่าปัจจุบัน โดยใช้วัดอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมตราสารหนี้ คำนวณจากค่าเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักของ Yield to Maturity ของตราสารหนี้แต่ละตัวที่กองทุนมีการลงทุน และเนื่องจาก Yield to Maturity มีหน่วยมาตรฐานเป็นเปอร์เซ็นต์ต่อปี จึงสามารถนำไปใช้เปรียบเทียบอัตราผลตอบแทนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีนโยบายถือครองตราสารหนี้จนครบกำหนดอายุและมีลักษณะการลงทุนที่ใกล้เคียงกันได้

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด
เลขที่ 898 อาคารเพลินจิตทาวเวอร์ ชั้นที่ 1 โซนเอ, 2 โซนเอ และ 12
ถนนเพลินจิต แขวงลุมพินี เขตปทุมวัน กรุงเทพฯ 10330
โทรศัพท์ 0-2657-5757 โทรสาร 0-2657-5777
เว็บไซต์: www.krungsriasset.com