



krungsri

Asset
Management

Make Life
Simple

A member of  MUFG
a global financial group

รายงานประจำปีแรก 2568

รอบระยะเวลาตั้งแต่วันที่ 1 ธันวาคม 2567 – 31 พฤษภาคม 2568

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 2568

กองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นแอสท์ซีทีไทยเพื่อความยั่งยืน

- สารบัญจัดการ 3
- รายงานผู้ดูแลผลประโยชน์ 5
- งบแสดงฐานะการเงิน งบกำไรขาดทุนเบ็ดเสร็จ และงบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน 6
- รายละเอียดเงินลงทุน การกู้ยืมเงิน และการก่อภาวะผูกพันของกองทุนรวม 11
- ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม 14
- คำนายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ 15
- ผลการดำเนินงาน 16
- ข้อมูลอื่นๆ ที่ผู้ถือหน่วยลงทุนควรทราบ 18
 - รายงานบุคคลที่เกี่ยวข้องที่มีการทำธุรกรรมในรอบเวลาที่ผ่านมา
 - การรับผลประโยชน์ตอบแทนเนื่องจากการใช้บริการบุคคลอื่นๆ
 - รายชื่อผู้จัดการกองทุน
 - การเปิดเผยข้อมูลการถือหน่วยลงทุนเกิน 1 ใน 3
 - อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุนของกองทุน
- รายงานการบริหารจัดการกองทุนรวมเพื่อความยั่งยืน 19

สารบริษัทจัดการ

เรียน ผู้ถือหน่วยลงทุน

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด (บริษัทฯ) ขอนำส่งรายงานสำหรับรอบระยะเวลา 6 เดือน ของกองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นแชนซ์ เซ็ทไทยเพื่อความยั่งยืน (KFTHAIESG) ตั้งแต่วันที่ 1 ธันวาคม 2567 ถึงวันที่ 31 พฤษภาคม 2568 มายังผู้ถือหน่วยลงทุน โดยมีรายละเอียดดังนี้

ผลการดำเนินงาน

กองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นแชนซ์เซ็ทไทยเพื่อความยั่งยืน มีมูลค่าทรัพย์สินสุทธิ ณ วันที่ 31 พฤษภาคม 2568 ซึ่งแบ่งตามชนิดหน่วยลงทุน ดังนี้

- KFTHAIESGA จำนวน 507.80 ล้านบาท คิดเป็นมูลค่าทรัพย์สินสุทธิต่อหน่วยลงทุน 8.2429 บาท
- KFTHAIESGD จำนวน 575.24 ล้านบาท คิดเป็นมูลค่าทรัพย์สินสุทธิต่อหน่วยลงทุน 8.2429 บาท

และมีผลการดำเนินงานย้อนหลัง 6 เดือน โดยแบ่งตามชนิดหน่วยลงทุน ได้แก่

- KFTHAIESGA ลดลงร้อยละ 15.86 ลดลงใกล้เคียงกับดัชนีผลตอบแทนรวม SET ESG (SET ESG TRI) ที่ลดลงร้อยละ 14.91
- KFTHAIESGD ลดลงร้อยละ 15.86 ลดลงใกล้เคียงกับดัชนีผลตอบแทนรวม SET ESG (SET ESG TRI) ที่ลดลงร้อยละ 14.91

ภาวะการลงทุนในช่วงที่ผ่านมา

ในรอบครึ่งปีบัญชีที่ผ่านมา ดัชนีผลตอบแทนรวมตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (ตลาดหลักทรัพย์ฯ) ปรับตัวอยู่ระหว่าง 1,056.41 – 1,457.71 จุด ก่อนปิดที่ 1,149.18 จุด ณ วันที่ 31 พฤษภาคม 2568 โดยในช่วงเวลาดังกล่าว ดัชนีปรับตัวลดลงร้อยละ 17.05

ในเดือนธันวาคม 2567 ดัชนีปรับตัวลดลง การหารือเกี่ยวกับแผนปรับโครงสร้างภาษีใหม่ โดยเฉพาะการเพิ่มภาษีมูลค่าเพิ่ม (VAT) และการปรับตัวเพิ่มขึ้นของอัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลสหรัฐฯ ยังเร่งให้เกิดกระแสเงินทุนไหลออกจากตลาดหุ้นไทย นอกจากนี้ ตลาดหุ้นไทยได้รับปัจจัยลบจาก CP Aextra PCL (CPAXT) ประกาศการลงทุนด้านอสังหาริมทรัพย์ ซึ่งก่อให้เกิดความกังวลเกี่ยวกับความเชื่อมโยงของธุรกิจและประเด็นธรรมาภิบาลองค์กร เหตุการณ์ดังกล่าวนำไปสู่การเทขายหุ้นในวงกว้าง โดยเฉพาะหุ้นขนาดเล็ก

ในเดือนมกราคม 2568 ดัชนีปรับตัวลดลง ตรงกันข้ามกับดัชนี MSCI Asia Pacific ปรับตัวเพิ่มขึ้นในช่วงเวลาเดียวกันตลอดเดือนมกราคม ดัชนีเคลื่อนไหวในกรอบมัวว่าจะเผชิญความท้าทายที่สำคัญ เช่น การไถ่ถอนหน่วยลงทุนของกองทุนรวมหุ้นระยะยาว (LTF) ซึ่งเป็นกองทุนรวมลดหย่อนภาษีในระดับที่สูงกว่าปกติ การบังคับใช้ภาษีขั้นต่ำทั่วโลก (Global Minimum Tax) ซึ่งส่งผลกระทบต่อผลประกอบการของหุ้นขนาดใหญ่หลายตัว ความกังวลเกี่ยวกับจำนวนนักท่องเที่ยวชาวจีนที่อาจลดลงจากเหตุการณ์ลักพาตัว รวมถึงการปรับตัวเพิ่มขึ้นของอัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลสหรัฐฯ อายุ 10 ปี ซึ่งแตะระดับสูงสุดที่ร้อยละ 4.8 นับเป็นระดับสูงสุดในรอบ 14 เดือน เป็นต้น

ในเดือนกุมภาพันธ์ 2568 ตลาดหุ้นไทยเผชิญแรงขายต่อเนื่อง สาเหตุหลักมาจากความกังวลเรื่องการไถ่ถอนกองทุน LTF ซึ่งไม่มีมาตรการลดหย่อนภาษีอื่นรองรับ ประกอบกับค่าเงินบาทที่อ่อนตัวลงและปัจจัยภายนอกประเทศที่ส่งผลกระทบต่อเศรษฐกิจ แม้จะมีความพยายามฟื้นตัวในหุ้นขนาดใหญ่บางตัว แต่ก็ไม่สามารถต้านทานแรงขายที่มาจากผลประกอบการของบริษัทจดทะเบียนที่ต่ำกว่าคาดการณ์ได้ ส่งผลให้ตลาดโดยรวมปรับตัวลดลงอย่างหนัก แม้ว่าธนาคารแห่งประเทศไทยจะปรับลดอัตราดอกเบี้ยนโยบายแล้วก็ตาม นักลงทุนต่างชาติและสถาบันในประเทศต่างเทขายหุ้น ในขณะที่นักลงทุนรายย่อยเป็นผู้ซื้อสุทธิเพียงกลุ่มเดียว

ในเดือนมีนาคม 2568 ดัชนีปรับตัวลดลง ต่ำกว่าระดับแนวรับทางจิตวิทยาที่ 1,200 จุดอย่างมีนัยสำคัญ นักลงทุนทั่วโลกยังคงมีความกังวลก่อนการประกาศ “Liberation Day” (วันปลดปล่อย) โดยประธานาธิบดีทรัมป์ ซึ่งกำหนดไว้เป็นวันที่ 2 เมษายน 2568 ส่งผลให้บรรยากาศการลงทุนที่เกี่ยวข้องกับนโยบายภาษีมีความผันผวนตลอดเดือนมีนาคม ด้านการเมืองในประเทศ นายกรัฐมนตรี แพทองธาร ผ่านการลงมติไม่ไว้วางใจไปได้อย่างราบรื่น ด้วยคะแนนไว้วางใจ 319 ต่อ 162 เสียง รัฐบาลได้เสนอแผนรับมือการไถ่ถอนหน่วยลงทุนของกองทุนรวมหุ้นระยะยาว (LTF) โดยการให้สิทธิประโยชน์ทางภาษีเพิ่มเติมโดยการโอนเงินลงทุนไปยังกองทุนรวมไทยเพื่อความยั่งยืนแบบพิเศษ (Thai ESGX Fund) แม้ว่าแผนดังกล่าวจะช่วยชะลอแรงขายได้ในระดับหนึ่ง ทว่าไม่สามารถเปลี่ยนทิศทางขาลงโดยรวมของตลาดได้ ช่วงปลายเดือนเกิดเหตุแผ่นดินไหวขนาด 7.7 แมกนิจูดในประเทศพม่า โดยแรงสั่นสะเทือนรับรู้ได้ถึงกรุงเทพฯ ทำให้อาคารที่อยู่ระหว่างก่อสร้างแห่งหนึ่งพังถล่มลงมา นอกจากนี้ตลาดหลักทรัพย์ฯ ยังได้ระงับการซื้อขายชั่วคราว โดยเมื่อเปิดทำการซื้อขายในวันทำการซื้อขายถัดมา ตลาดเผชิญแรงขายอีกรอบ

ในเดือนเมษายน 2568 ดัชนีกลับมาปรับตัวเพิ่มขึ้น ในช่วงครึ่งเดือนแรกดัชนีปรับตัวลดลงสู่ระดับต่ำสุดในรอบ 5 ปี สะท้อนถึงการปรับตัวลดลงของตลาดหุ้นทั่วโลก หลังสหรัฐฯประกาศแผนขึ้นภาษี เพื่อลดความผันผวนของตลาด สำนักงาน ก.ล.ต. และตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้ดำเนินมาตรการรักษาเสถียรภาพตลาด ในช่วงเวลาเดียวกัน กองทุนการเงินระหว่างประเทศ (IMF) ได้ปรับลดคาดการณ์อัตราการขยายตัวของ GDP โลกในปี 2568 และปรับลดคาดการณ์การเติบโตของเศรษฐกิจไทย อย่างไรก็ตาม ในวันที่ 9 เมษายน ประธานาธิบดีทรัมป์ได้สร้างความประหลาดใจให้แก่นักลงทุนทั่วโลกด้วยการประกาศพักการขึ้นภาษีดังกล่าวเป็นระยะเวลา 90 วัน ส่งผลให้บรรยากาศการลงทุนพลิกกลับในเชิงบวก และตลาดหุ้นไทยฟื้นตัวแรงต่อเนื่องจนปิดใกล้ระดับแนวต้านสำคัญที่ 1,200 จุด

ในเดือนพฤษภาคม 2568 ตลาดหุ้นไทยเผชิญความท้าทาย โดยมีผลตอบแทนลดลงอย่างต่อเนื่องตั้งแต่ต้นปี ซึ่งสวนทางกับตลาดหุ้นในเอเชียแปซิฟิกที่ปรับตัวดีขึ้นอย่างเห็นได้ชัด อันเป็นผลมาจากการคลี่คลายความกังวลเรื่องภาษีและความเสี่ยงทางเศรษฐกิจในระดับโลก โดยเฉพาะอย่างยิ่งหลังการเจรจาระหว่างสหรัฐฯ และจีนที่นำไปสู่การลดภาษีนำเข้า-ส่งออกชั่วคราว แม้ข่าวดีนี้จะหนุนตลาดโลก แต่ตลาดหุ้นไทยยังคงประสบปัญหา จากปัจจัยภายในประเทศ ความไม่แน่นอนทางการเมืองยังคงเป็นปัจจัยกดดันสำคัญ โดยเฉพาะอย่างยิ่งกรณีที่ดีตนายกรัฐมนตรีถูกสั่งให้ชดใช้ค่าเสียหายคดีจำนำข้าวเป็นจำนวนมาก รวมถึงความกังวลก่อนคำตัดสินของศาลฎีกาในคดีสำคัญ อย่างไรก็ตาม มีข่าวดีที่สภาผู้แทนราษฎรได้อนุมัติร่างพระราชบัญญัติงบประมาณรายจ่ายประจำปีสำหรับปีงบประมาณถัดไป ซึ่งแสดงถึงการเพิ่มขึ้นของงบประมาณด้านการใช้จ่าย และในด้านเศรษฐกิจ การเติบโตของ GDP ในไตรมาสแรกของปี ได้สูงกว่าที่คาดการณ์ไว้ ส่วนหนึ่งมาจากคำสั่งซื้อล่วงหน้าเพื่อรับมือกับผลกระทบจากภาษีที่อาจเกิดขึ้น

แนวโน้มการลงทุน

บริษัทฯ มีมุมมองว่า ตลาดหุ้นไทยยังคงเผชิญความท้าทาย แม้จะมีพัฒนาการเชิงบวกทั้งในระดับโลกและการเติบโตทางเศรษฐกิจภายในประเทศก็ตาม แต่ปัญหาภายในประเทศโดยเฉพาะประเด็นด้านการเมืองยังคงกดดันทั้งในเชิงการเติบโตทางเศรษฐกิจและเชิงความเชื่อมั่นนักลงทุน อย่างไรก็ตาม ระดับดัชนีหุ้นไทยในปัจจุบันอยู่ในระดับที่น่าสนใจเมื่อเปรียบเทียบกับมูลค่าพื้นฐาน และยังมีอัตราเงินปันผลที่อยู่ในระดับสูงเพื่อเทียบกับตลาดหุ้นอื่นๆ

แนวทางการบริหารกองทุนตราสารทุนยังคงเป็นการคัดเลือกหลักทรัพย์ที่จะลงทุนรายตัว จากข้อมูลที่ได้รับจากการพบกับผู้บริหารบริษัทจดทะเบียน การวิเคราะห์บริษัทจดทะเบียนทั้งในเชิงคุณภาพ และเชิงปริมาณ รวมถึงการติดตามผลการดำเนินงานของบริษัทจดทะเบียนอย่างสม่ำเสมอ โดยบริษัทฯ เชื่อว่าแนวทางการบริหารกองทุนตราสารทุนดังกล่าวจะเป็นสิ่งที่ส่งเสริมให้กองทุนสามารถสร้างผลตอบแทนจากการลงทุนในตลาดหลักทรัพย์ฯ ที่ดีในระยะกลาง และระยะยาว

บริษัทฯ ขอขอบพระคุณท่านผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุนที่ได้มอบความไว้วางใจให้บริษัทฯ เป็นผู้บริหารเงินลงทุนของท่าน ทั้งนี้ บริษัทฯ จะพิจารณาดำเนินนโยบายการลงทุนที่เหมาะสมกับสถานการณ์ด้วยความระมัดระวัง และคำนึงถึงผลประโยชน์สูงสุดของผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุนเป็นสำคัญ

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด



ความเห็นของผู้ดูแลผลประโยชน์

วันที่ 20 มิถุนายน 2568

เรียน ผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุนกองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นแอสเซตซีทีไทยเพื่อความยั่งยืน

ธนาคารกรุงเทพ จำกัด (มหาชน) ในฐานะผู้ดูแลผลประโยชน์ ได้ดูแลการจัดการกองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นแอสเซตซีทีไทยเพื่อความยั่งยืน ซึ่งจัดการโดยบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด สำหรับระยะเวลาตั้งแต่วันที่ 1 ธันวาคม 2567 ถึงวันที่ 31 พฤษภาคม 2568 แล้ว

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

(นาถฤดี ลีโทชวลิต)

ธนาคารกรุงเทพ จำกัด (มหาชน)

ในฐานะผู้ดูแลผลประโยชน์

กองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นแอสส์เซีทไทยเพื่อความยั่งยืน

งบแสดงฐานะการเงิน

ณ 31 พฤษภาคม 2568

	Unaudited (บาท)
สินทรัพย์	
เงินลงทุนตามราคายุติธรรม (ราคาทุน 1,268,293,656.61 บาท)	1,059,013,080.41
เงินฝากธนาคาร	23,811,580.21
ลูกหนี้	
จากดอกเบี้ย	53,052.05
จากการขายหน่วยลงทุน	624,800.00
จากเงินปันผล	899,267.50
รวมสินทรัพย์	<u>1,084,401,780.17</u>
หนี้สิน	
เจ้าหนี้	
จากการรับซื้อคืนหน่วยลงทุน	306,931.76
ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย	1,018,816.79
ภาษีเงินได้ค้างจ่าย	7,962.09
หนี้สินอื่น	22,535.00
รวมหนี้สิน	<u>1,356,245.64</u>
สินทรัพย์สุทธิ	<u>1,083,045,534.53</u>
สินทรัพย์สุทธิ:	
หน่วยลงทุนจดทะเบียน 300 ล้านหน่วย มูลค่าที่ตราไว้หน่วยละ 10 บาท	
ทุนที่ได้รับจากผู้ถือหน่วยลงทุน	1,313,906,769.30
กำไรสะสม	(195,291,443.57)
บัญชีปรับสมดุล	(35,569,791.20)
สินทรัพย์สุทธิ	<u>1,083,045,534.53</u>
ชนิดไทยเพื่อความยั่งยืนสะสมมูลค่า (KFTHAIESGA)	
สินทรัพย์สุทธิ	507,801,700.95
หน่วยลงทุนที่ออกจำหน่ายแล้ว ณ วันสิ้นปี (หน่วย)	61,604,388.9654
สินทรัพย์สุทธิต่อหน่วย	8.2429
ชนิดไทยเพื่อความยั่งยืนปันผล (KFTHAIESGD)	
สินทรัพย์สุทธิ	575,243,833.58
หน่วยลงทุนที่ออกจำหน่ายแล้ว ณ วันสิ้นปี (หน่วย)	69,786,287.9656
สินทรัพย์สุทธิต่อหน่วย	8.2429

กองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นแอสส์เซิทไทยเพื่อความยั่งยืน
งบกำไรขาดทุนเบ็ดเสร็จ
สำหรับงวดบัญชีสิ้นสุดวันที่ 31 พฤษภาคม 2568

	Unaudited (บาท)
รายได้จากการลงทุน	
รายได้ดอกเบี้ย	61,762.83
รายได้เงินปันผล	33,100,175.38
รวมรายได้	33,161,938.21
ค่าใช้จ่าย	
ค่าธรรมเนียมการจัดการ	3,629,177.28
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์	131,208.78
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน	837,502.45
ค่าธรรมเนียมวิชาชีพ	30,515.95
ค่าใช้จ่ายที่เกี่ยวข้องกับการจัดการกองทุน	154,741.30
ค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์	446,915.30
รวมค่าใช้จ่าย	5,230,061.06
รายได้จากการลงทุนสุทธิ	27,931,877.15
รายการกำไร (ขาดทุน) สุทธิจากเงินลงทุน	
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิที่เกิดขึ้นจากเงินลงทุน	(10,227,631.08)
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิที่ยังไม่เกิดขึ้นจากเงินลงทุน	(201,833,815.59)
รวมรายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิจากเงินลงทุนที่เกิดขึ้นและยังไม่เกิดขึ้น	(212,061,446.67)
หัก ภาษีเงินได้	(9,265.98)
การเพิ่มขึ้นในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงานหลังหักภาษีเงินได้	(184,138,835.50)
การเพิ่มขึ้นในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงานแยกตามชนิดหน่วยลงทุน มีดังนี้	
ชนิดไทยเพื่อความยั่งยืนสะสมมูลค่า (KFTHAIESGA)	(85,346,541.00)
ชนิดไทยเพื่อความยั่งยืนปันผล (KFTHAIESGD)	(98,792,294.50)
รวม	(184,138,835.50)

กองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นแอสแซนด์ไทยเพื่อความยั่งยืน

งบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน

ณ 31 พฤษภาคม 2568

การแสดงรายละเอียดเงินลงทุนใช้การจัดกลุ่มตามประเภทของเงินลงทุนและประเภทของอุตสาหกรรม

ประเภทเงินลงทุน/ผู้ออกตราสาร/ผู้ออกหลักทรัพย์	หมายเลขตราสาร	อัตราดอกเบี้ย (%)	วันครบอายุ	เงินต้น (บาท) / จำนวนหุ้น	มูลค่ายุติธรรม (บาท)	Unaudited ร้อยละของมูลค่าเงินลงทุน
หลักทรัพย์ในประเทศ						
เงินฝากออมทรัพย์						
บมจ.ยูโอบี		0.900000	เมื่อทวงถาม	5,039.01	5,039.01	0.00
หุ้นจดทะเบียน						
หุ้นสามัญ						
กลุ่มเกษตรและอุตสาหกรรมอาหาร						
หมวดธุรกิจการเกษตร						
บมจ.จีเอฟพีที	GFPT			114,800.00	1,136,520.00	0.11
บมจ.ศรีตรังแอโกรอินดัสทรี	STA			226,400.00	2,897,920.00	0.27
หมวดอาหารและเครื่องดื่ม						
บมจ.เบทาโกร	BTG			122,100.00	2,735,040.00	0.26
บมจ.การบาวากรุ๊ป	CBG			88,700.00	5,211,125.00	0.49
บมจ.เจริญโภคภัณฑ์อาหาร	CPF			903,300.00	22,130,850.00	2.09
บมจ. โอสดสภา	OSP			237,000.00	3,768,300.00	0.36
บมจ. อาร์ แอนด์ บี ฟู้ด ซัพพลาย	RBF			370,300.00	1,614,508.00	0.15
บมจ.เซ็ปเป้	SAPPE			36,100.00	1,055,925.00	0.10
บมจ.ไทยยูเนียน กัญญา	TU			153,500.00	1,535,000.00	0.14
กลุ่มสินค้าอุปโภคบริโภค						
หมวดของใช้ส่วนตัวและเวชภัณฑ์						
บมจ.นีโอ คอร์ปอเรท	NEO			65,800.00	1,809,500.00	0.17
บมจ.ศรีตรังโกลฟส์ (ประเทศไทย)	STGT			352,000.00	2,288,000.00	0.22
กลุ่มธุรกิจการเงิน						
หมวดธนาคาร						
บมจ.ร.กรุงเทพ	BBL			247,800.00	35,063,700.00	3.31
บมจ.ร.กสิกรไทย	KBANK			288,800.00	44,475,200.00	4.20
บมจ.ร.เกียรตินาคินภัทร	KKP			122,900.00	5,591,950.00	0.53
บมจ.ร.กรุงไทย	KTB			1,700,600.00	37,753,320.00	3.56
บมจ.เอสซีบี เอกซ์	SCB			324,600.00	38,465,100.00	3.63
บมจ.ร.ทหารไทยธนชาติ	TTB			9,642,300.00	18,513,216.00	1.75
หมวดเงินทุนและหลักทรัพย์						
บมจ.บริหารสินทรัพย์ กรุงเทพพาณิชย์	BAM			1,196,800.00	7,539,840.00	0.71
บมจ.บัวทอง	KTC			139,700.00	5,378,450.00	0.51
บมจ.เมืองไทย แคปปิตอล	MTC			385,000.00	16,073,750.00	1.52
บมจ.ศักดิ์สยามลิซซิ่ง	SAK			291,500.00	1,136,850.00	0.11
บมจ.ศรีสวัสดิ์ คอร์ปอเรชั่น	SAWAD			441,540.00	8,080,182.00	0.76
บมจ.ราชธานีลิซซิ่ง	THANI			1,668,300.00	2,719,329.00	0.26

กองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นแฮนซ์ซีทีไทยเพื่อความยั่งยืน

งบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน

ณ 31 พฤษภาคม 2568

การแสดงรายละเอียดเงินลงทุนใช้การจัดกลุ่มตามประเภทของเงินลงทุนและประเภทของอุตสาหกรรม

ประเภทเงินลงทุน/ผู้ออกตราสาร/ผู้ออกหลักทรัพย์	หมายเลขตราสาร	อัตราดอกเบี้ย (%)	วันครบอายุ	เงินต้น (บาท) / จำนวนหุ้น	มูลค่ายุติธรรม (บาท)	Unaudited ร้อยละของมูลค่าเงินลงทุน
หมวดประกันชีวิตและประกันภัย						1.29
บมจ.กรุงเทพประกันชีวิต	BLA			310,400.00	5,090,560.00	0.48
บมจ.ไทยประกันชีวิต	TLI			638,700.00	6,961,830.00	0.66
บมจ.ทีคิวเอ็ม อัลฟา	TQM			96,600.00	1,584,240.00	0.15
กลุ่มสินค้าอุตสาหกรรม						
หมวดบรรจุภัณฑ์						0.92
บมจ.เอสซีจี แพคเกจจิ้ง	SCGP			590,300.00	9,739,950.00	0.92
หมวดปิโตรเคมีและเคมีภัณฑ์						3.48
บมจ.อินโดรามา เวนเจอร์ส	IVL			798,100.00	16,201,430.00	1.53
บมจ.พีทีที โกลบอล เคมิคอล	PTTGC			992,100.00	20,635,680.00	1.95
กลุ่มอสังหาริมทรัพย์และก่อสร้าง						
หมวดวัสดุก่อสร้าง						2.83
บมจ.อีสเทิร์น โพลีเมอร์ กรู๊ป	EPG			704,300.00	1,746,664.00	0.16
บมจ.ปูนซิเมนต์ไทย	SCC			170,600.00	28,319,600.00	2.67
หมวดธุรกิจบริการรับเหมาก่อสร้าง						0.51
บมจ.ช.การช่าง	CK			363,900.00	5,422,110.00	0.51
หมวดพัฒนาอสังหาริมทรัพย์						5.99
บมจ.อมตะ คอร์ปอเรชัน	AMATA			236,900.00	3,435,050.00	0.32
บมจ.เอพี (ไทยแลนด์)	AP			823,000.00	5,596,400.00	0.53
บมจ.แอสเสท เวิร์ด คอร์ป	AWC			6,587,800.00	13,043,844.00	1.23
บมจ.เซ็นทรัลพัฒนา	CPN			540,700.00	24,601,850.00	2.32
บมจ.แลนด์แอนด์เอนด์เฮาส์	LH			1,627,600.00	6,542,952.00	0.62
บมจ.ศุภาลัย	SPALI			193,500.00	2,805,750.00	0.26
บมจ.ดับบลิวเอชเอ คอร์ปอเรชั่น	WHA			2,334,600.00	7,470,720.00	0.71
กลุ่มทรัพยากร						
หมวดพลังงานและสาธารณูปโภค						22.46
บมจ.บ้านปู	BANPU			1,668,900.00	7,743,696.00	0.73
บมจ.บางจาก คอร์ปอเรชั่น	BCP			90,100.00	3,266,125.00	0.31
บมจ.บี.กริม เพาเวอร์	BGRIM			615,000.00	5,996,250.00	0.57
บมจ.ซีเค เพาเวอร์	CKP			2,567,900.00	7,190,120.00	0.68
บมจ.ผลิตไฟฟ้า	EGCO			59,900.00	6,349,400.00	0.60
บมจ.โกลบอล เพาเวอร์ ซินเนอร์ยี	GPSC			494,700.00	16,077,750.00	1.52
บมจ.กัลฟ์ ดีเวลลอปเม้นท์	GULF			1,553,351.00	69,900,795.00	6.60
บมจ.ปตท. น้ำมันและการค้าปลีก	OR			1,359,600.00	16,043,280.00	1.51
บมจ.ปตท.	PTT			1,723,400.00	51,271,150.00	4.84
บมจ.ปตท.สำรวจและผลิตปิโตรเลียม	PTTEP			390,500.00	38,269,000.00	3.61
บมจ.ราช กรุ๊ป	RATCH			198,900.00	5,071,950.00	0.48
บมจ.ไทยออยล์	TOP			358,200.00	10,656,450.00	1.01

กองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นแอสแซนด์ไทยเพื่อความยั่งยืน

งบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน

ณ 31 พฤษภาคม 2568

การแสดงรายละเอียดเงินลงทุนใช้การจัดกลุ่มตามประเภทของเงินลงทุนและประเภทของอุตสาหกรรม

ประเภทเงินลงทุน/ผู้ออกตราสาร/ผู้ออกหลักทรัพย์	หมายเลขตราสาร	อัตราดอกเบี้ย (%)	วันครบอายุ	เงินต้น (บาท) / จำนวนหุ้น	มูลค่ายุติธรรม (บาท)	ร้อยละของมูลค่าเงินลงทุน	Unaudited
กลุ่มบริการ							
หมวดพาณิชย์							9.45
บมจ.เบอร์ลี่ ยุคเกอร์	BJC			410,000.00	8,118,000.00	0.77	
บมจ.คอมเซเว่น	COM7			272,600.00	5,424,740.00	0.51	
บมจ.ซีพี ออลล์	CPALL			1,179,000.00	55,413,000.00	5.23	
บมจ.ซีพี แอ็กซ์ตรา	CPAXT			9,373.00	176,212.40	0.02	
บมจ.เซ็นทรัล รีเทล คอร์ปอเรชั่น	CRC			688,600.00	12,876,820.00	1.22	
บมจ.สยาม โกลบอลเฮ้าส์	GLOBAL			704,568.00	3,875,124.00	0.37	
บมจ.โฮมโปร คัดส์ เซ็นเตอร์	HMPRO			1,764,600.00	13,587,420.00	1.28	
บมจ.โมชิ โมชิ รีเทล คอร์ปอเรชั่น	MOSHI			14,800.00	562,400.00	0.05	
หมวดการแพทย์							3.58
บมจ.บางกอก เชน ฮอस्पิตอล	BCH			65,900.00	902,830.00	0.09	
บมจ.กรุงเทพดุสิตเวชการ	BDMS			1,585,800.00	34,094,700.00	3.22	
บมจ.โรงพยาบาลบำรุงราษฎร์	BH			8,700.00	1,218,000.00	0.12	
บมจ.โรงพยาบาลจุฬารัตน์	CHG			1,036,200.00	1,616,472.00	0.15	
หมวดสื่อและสิ่งพิมพ์							0.60
บมจ.วีจี ไอ	VGI			2,884,100.00	6,345,020.00	0.60	
หมวดการท่องเที่ยวและสันทนาการ							2.77
บมจ.โรงแรมเซ็นทรัลพลาซา	CENTEL			210,000.00	4,536,000.00	0.43	
บมจ.ไมเนอร์ อินเตอร์เนชั่นแนล	MINT			972,600.00	24,120,480.00	2.28	
บมจ.สยามเวลเนสกรุ๊ป	SPA			218,400.00	659,568.00	0.06	
หมวดขนส่งและโลจิสติกส์							6.36
บมจ.ท่าอากาศยานไทย	AOT			1,354,600.00	45,040,450.00	4.25	
บมจ.การบินกรุงเทพ	BA			273,200.00	3,797,480.00	0.36	
บมจ.ทางด่วนและรถไฟฟ้ากรุงเทพ	BEM			729,200.00	3,901,220.00	0.37	
บมจ.บีทีเอส กรุ๊ป โฮลดิ้งส์	BTS			1,991,400.00	8,881,644.00	0.84	
บมจ.พีจีเอส ซิปปิง	PSL			376,000.00	2,425,200.00	0.23	
บมจ.เอสซีจี เจดับเบิลยูดี โลจิสติกส์	SJWD			379,700.00	3,265,420.00	0.31	
กลุ่มเทคโนโลยี							
หมวดชิ้นส่วนอิเล็กทรอนิกส์							8.50
บมจ.เคลต้า อิเล็กทรอนิกส์ (ประเทศไทย)	DELTA			791,400.00	82,305,600.00	7.77	
บมจ.ฮานา ไมโครอิเล็กทรอนิกส์	HANA			228,300.00	4,269,210.00	0.40	
บมจ.เคซีอี อิเล็กทรอนิกส์	KCE			219,700.00	3,471,260.00	0.33	
หมวดเทคโนโลยีสารสนเทศและการสื่อสาร							6.05
บมจ.แอดวานซ์ อินโฟร์ เซอร์วิส	ADVANC			207,100.00	59,230,600.00	5.59	
บมจ.ทรู คอร์ปอเรชั่น	TRUE			390,800.00	4,885,000.00	0.46	
					1,059,013,080.41	100.00	

กองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นแฮนซ์เซ็ทไทยเพื่อความยั่งยืน

รายละเอียดการลงทุน ณ 31 พฤษภาคม 2568

	มูลค่าตามราคาตลาด	% NAV
หลักทรัพย์หรือทรัพย์สินในประเทศ	1,082,877,712.67	99.98
หุ้นสามัญ		
จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์		
การท่องเที่ยวและสันทนาการ	29,316,048.00	2.71
การแพทย์	37,832,002.00	3.49
ขนส่งและโลจิสติกส์	67,311,414.00	6.21
ของใช้ส่วนตัวและเวชภัณฑ์	4,097,500.00	0.38
เงินทุนและหลักทรัพย์	40,928,401.00	3.78
ชิ้นส่วนอิเล็กทรอนิกส์	90,046,070.00	8.31
เทคโนโลยีสารสนเทศและการสื่อสาร	64,115,600.00	5.92
ธนาคาร	179,862,486.00	16.61
ธุรกิจการเกษตร	4,034,440.00	0.37
ธุรกิจบริการรับเหมาก่อสร้าง	5,422,110.00	0.50
บรรจุภัณฑ์	9,739,950.00	0.90
ประกันชีวิตและประกันภัย	13,636,630.00	1.26
ปิโตรเคมีและเคมีภัณฑ์	36,837,110.00	3.40
พลังงานและสาธารณูปโภค	237,835,966.00	21.96
พัฒนาอสังหาริมทรัพย์	63,496,566.00	5.86
พาณิชย์	100,033,716.40	9.24
วัสดุก่อสร้าง	30,066,264.00	2.78
สื่อและสิ่งพิมพ์	6,345,020.00	0.59
อาหารและเครื่องดื่ม	38,050,748.00	3.51
เงินฝากธนาคาร		
FITCH_TH-LONG		
Rate AAA	5,059.04	0.00
Rate BBB	23,864,612.23	2.20

กองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นแฮนซ์เซ็ทไทยเพื่อความยั่งยืน

รายละเอียดการลงทุน ณ 31 พฤษภาคม 2568

	มูลค่าตามราคาตลาด	% NAV
อื่นๆ	167,821.86	0.02
ลูกหนี้	1,524,067.50	0.14
เจ้าหนี้	(337,428.85)	(0.03)
ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย	(1,018,816.79)	(0.09)
มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ	1,083,045,534.53	100.00

คำอธิบายการจัดอันดับตราสารของสถาบันจัดอันดับความน่าเชื่อถือ

• ตราสารหนี้ระยะกลางและระยะยาว

Moody's	S&P	TRIS	Fitch	คำอธิบาย	
Aaa	AAA	AAA	AAA	ความน่าเชื่อถือสูงสุด และมีความเสี่ยงต่ำที่สุด	ระดับการลงทุน (investment grade)
Aa1	AA+	AA+	AA+	ความน่าเชื่อถือสูงมาก และมีความเสี่ยงต่ำมาก	
Aa2	AA	AA	AA		
Aa3	AA-	AA-	AA-		
A1	A+	A+	A+	ความน่าเชื่อถือสูง และมีความเสี่ยงต่ำ	
A2	A	A	A		
A3	A-	A-	A-		
Baa1	BBB+	BBB+	BBB+	ความน่าเชื่อถืออยู่ในเกณฑ์พอใช้	
Baa2	BBB	BBB	BBB		
Baa3	BBB-	BBB-	BBB-		
Ba1	BB+	BB+	BB+	ความน่าเชื่อถือต่ำกว่าระดับปานกลาง	ระดับเก็งกำไร (speculative grade)
Ba2	BB	BB	BB		
Ba3	BB-	BB-	BB-		
B1	B+	B+	B+	ความน่าเชื่อถืออยู่ในเกณฑ์ต่ำมาก	
B2	B	B	B		
B3	B-	B-	B-		
Caa1	CCC+	C+	CCC	มีความเสี่ยงในการผิดนัดชำระหนี้สูงที่สุด	
Caa2	CCC				
Caa3	CCC-				
Ca	CC	C	CC		
	C	C-	C		
C	SD	RD	RD	อยู่ในสภาวะผิดนัดชำระหนี้ โดยผู้ออกตราสารหนี้ไม่สามารถชำระดอกเบี้ยและคืนเงินต้นได้ตามกำหนด	
	D	D	D		

• ตราสารหนี้ระยะสั้น

Moody's	S&P	TRIS	Fitch	คำอธิบาย
P-1	A-1	T1	F1	ผู้ออกตราสารหนี้มีสถานะทั้งทางด้านการตลาดและการเงินที่แข็งแกร่งในระดับดีมาก มีสภาพคล่องที่ดีมาก และนักลงทุนจะได้รับความคุ้มครองจากการผิดนัดชำระหนี้ที่ต่ำกว่าอันดับเครดิตในระดับอื่น
P-2	A-2	T2	F2	ผู้ออกตราสารหนี้มีสถานะทั้งทางด้านการตลาดและการเงินที่แข็งแกร่งในระดับดี และมีความสามารถในการชำระหนี้ระยะสั้นในระดับที่น่าพอใจ
P-3	A-3	T3	F3	ผู้ออกตราสารหนี้มีความสามารถในการชำระหนี้ระยะสั้นในระดับที่ยอมรับได้
	B	T4	B	มีความสามารถในการชำระหนี้ระยะสั้นที่ค่อนข้างอ่อนแอ ผู้ออกแสดงถึงความไม่แน่นอนอย่างสูงของความสามารถในการชำระหนี้ได้ตรงตามกำหนดเวลาที่ระบุไว้
	C		C	
	D	D	D	เป็นระดับที่อยู่ในสภาวะผิดนัดชำระหนี้ โดยผู้ออกตราสารหนี้ไม่สามารถชำระดอกเบี้ยและคืนเงินต้นได้ตามกำหนด

หมายเหตุ

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

ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (Fund's Direct Expenses)

กองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นแอสส์เซีไทยเพื่อความยั่งยืน

ตั้งแต่วันที่ 1 ธันวาคม 2567 ถึงวันที่ 31 พฤษภาคม 2568

ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (Fund's Direct Expenses)	จำนวนเงิน (หน่วย:พันบาท)	ร้อยละของมูลค่า ทรัพย์สิน* (ต่อปี) 1/
ค่าธรรมเนียมการจัดการ (Management Fee)	3,629.18	0.6955
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ (Trustee Fee)	131.21	0.0251
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน (Registrar Fee)	837.50	0.1605
ค่าที่ปรึกษาการลงทุน (Advisory Fee)	-	-
ค่าธรรมเนียมสอบบัญชี (Auditing Fee)	30.52	0.0059
ค่าใช้จ่ายที่เกี่ยวข้องกับการปฏิบัติการกองทุน (Operating Fee) 2/	154.74	0.0296
ค่าใช้จ่ายอื่น ๆ (Others)	-	-
รวมค่าใช้จ่ายทั้งหมด 3/	4,783.15	0.9166

หมายเหตุ

- 1/ ค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวมข้างต้น เป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่มหรือภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว
- 2/ ปัจจุบันเรียกเก็บค่าใช้จ่ายที่เกี่ยวข้องกับการปฏิบัติการกองทุนในอัตราร้อยละ 0.0321 โดยมีผลตั้งแต่วันที่ 20 ธันวาคม 2567 เป็นต้นไป
- 3/ ไม่รวมค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ และค่าธรรมเนียมต่าง ๆ ที่เกิดขึ้นจากการซื้อขายหลักทรัพย์

* มูลค่าทรัพย์สิน ในที่นี้ หมายถึง มูลค่าทรัพย์สินทั้งหมด หักด้วย มูลค่าหนี้สินทั้งหมด

เว้นแต่ค่าธรรมเนียมการจัดการ ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ ค่าธรรมเนียมนายทะเบียนหน่วยลงทุน

ค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์
กองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นแฮนซ์เซ็ทไทยเพื่อความยั่งยืน / Krungsri Enhanced SET Thailand ESG Fund
ตั้งแต่วันที่ 1 ธันวาคม 2567 ถึงวันที่ 31 พฤษภาคม 2568

บริษัท	จำนวนเงิน (บาท)	อัตราส่วน (%)
บจ.หลักทรัพย์ ซีจีเอส อินเตอร์เนชั่นแนล (ประเทศไทย) / CGS International Securities (Thailand) Co.,Ltd.	180,103.79	33.91
บมจ.หลักทรัพย์ เคจีไอ (ประเทศไทย) / KGI Securities (Thailand) Plc.	124,068.18	23.36
บจ.หลักทรัพย์ กรุงไทย เอ็กซ์สปริง จำกัด / Krungthai XSpring Securities Co.,Ltd.	61,893.48	11.65
บมจ.หลักทรัพย์ เกียรตินาคินภัทร / Kiatnakin Phatra Securities Plc.	48,151.14	9.07
บจ.หลักทรัพย์ อินโนเวสต์ เอกซ์ / InnovestX Securities Co., Ltd.	34,659.99	6.53
บมจ.หลักทรัพย์ บัวหลวง / Bualuang Securities Plc.	16,001.44	3.01
บจ.หลักทรัพย์ ซิตี้คอร์ป (ประเทศไทย) / Citicorp Securities (Thailand) Ltd.	13,764.38	2.59
บมจ.หลักทรัพย์ กรุงศรี / Krungsri Securities Plc.	9,652.37	1.82
บมจ.หลักทรัพย์ ธนชาต / Thanachart Securities Plc.	9,490.70	1.79
บมจ.หลักทรัพย์ กสิกรไทย / Kasikorn Securities Plc.	9,490.50	1.79
อื่นๆ / Other	23,869.41	4.49
รวม / Total	531,145.38	100.00

ผลการดำเนินงานของกองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นแอสส์เซ็ทไทยเพื่อความยั่งยืน-ไทยเพื่อความยั่งยืนสะสมมูลค่า

ผลการดำเนินงาน สิ้นสุด ณ วันที่ 30 พฤษภาคม 2568	% ตามช่วงเวลา			% ต่อปี				นับจากวันเริ่ม โครงการ (20 ธันวาคม 2566)
	Year to Date	ย้อนหลัง 3 เดือน	ย้อนหลัง 6 เดือน	ย้อนหลัง 1 ปี	ย้อนหลัง 3 ปี	ย้อนหลัง 5 ปี	ย้อนหลัง 10 ปี	
KFTHAIESGA	-13.99%	-2.94%	-15.86%	-14.71%	N/A	N/A	N/A	-12.52%
ดัชนีชี้วัด (Benchmark)*	-13.27%	-2.24%	-14.91%	-12.93%	N/A	N/A	N/A	-10.58%
ความผันผวนของผลการดำเนินงาน	+21.60%	+24.40%	+20.67%	+17.44%	N/A	N/A	N/A	+15.67%
ความผันผวนของดัชนีชี้วัด	+21.34%	+24.29%	+20.43%	+17.13%	N/A	N/A	N/A	+15.35%

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 30 พฤษภาคม 2568	% ตามช่วงเวลา			% ต่อปี				นับจากวันเริ่ม โครงการ (20 ธันวาคม 2566)
	Year to Date	ย้อนหลัง 3 เดือน	ย้อนหลัง 6 เดือน	ย้อนหลัง 1 ปี	ย้อนหลัง 3 ปี	ย้อนหลัง 5 ปี	ย้อนหลัง 10 ปี	
KFTHAIESGD	-13.99%	-2.94%	-15.86%	-14.71%	N/A	N/A	N/A	-12.52%
ดัชนีชี้วัด (Benchmark)*	-13.27%	-2.24%	-14.91%	-12.93%	N/A	N/A	N/A	-10.58%
ความผันผวนของผลการดำเนินงาน	+21.60%	+24.39%	+20.67%	+17.44%	N/A	N/A	N/A	+15.66%
ความผันผวนของดัชนีชี้วัด	+21.34%	+24.29%	+20.43%	+17.13%	N/A	N/A	N/A	+15.35%

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 ที่ผู้ถือหน่วยลงทุนควรทราบ

(1) รายงานบุคคลที่เกี่ยวข้องที่มีการทำธุรกรรมในรอบเวลาที่ผ่านมา (วันที่ 1 ธันวาคม 2567 ถึงวันที่ 31 พฤษภาคม 2568)

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

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

(2) การรับผลประโยชน์ตอบแทนเนื่องจากการที่กองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นแอสแซ่ท์ไทยเพื่อความยั่งยืน 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 (มหาชน)	ข่าวสารและบทวิเคราะห์ต่างๆ	เพื่อประโยชน์ของกองทุน
5. บริษัทหลักทรัพย์ กรุงไทย เอ็กซ์สปริง จำกัด	ข่าวสารและบทวิเคราะห์ต่างๆ	เพื่อประโยชน์ของกองทุน
6. บริษัทหลักทรัพย์ กรุงศรี จำกัด (มหาชน)	ข่าวสารและบทวิเคราะห์ต่างๆ	เพื่อประโยชน์ของกองทุน
7. บริษัทหลักทรัพย์ กสิกรไทย จำกัด (มหาชน)	ข่าวสารและบทวิเคราะห์ต่างๆ	เพื่อประโยชน์ของกองทุน
8. บริษัทหลักทรัพย์ ซิตีคอร์ป (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 ทีเอสไอ จำกัด	ข่าวสารและบทวิเคราะห์ต่างๆ	เพื่อประโยชน์ของกองทุน
15. บริษัทหลักทรัพย์ ธนชาด จำกัด (มหาชน)	ข่าวสารและบทวิเคราะห์ต่างๆ	เพื่อประโยชน์ของกองทุน
16. บริษัทหลักทรัพย์ บัวหลวง จำกัด (มหาชน)	ข่าวสารและบทวิเคราะห์ต่างๆ	เพื่อประโยชน์ของกองทุน
17. บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)	ข่าวสารและบทวิเคราะห์ต่างๆ	เพื่อประโยชน์ของกองทุน
18. บริษัทหลักทรัพย์ ฟิลลิป (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)	ข่าวสารและบทวิเคราะห์ต่างๆ	เพื่อประโยชน์ของกองทุน
19. บริษัทหลักทรัพย์ ยูโอบี เคย์เฮียน (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)	ข่าวสารและบทวิเคราะห์ต่างๆ	เพื่อประโยชน์ของกองทุน
20. บริษัทหลักทรัพย์ ยูบีเอส (ประเทศไทย) จำกัด	ข่าวสารและบทวิเคราะห์ต่างๆ	เพื่อประโยชน์ของกองทุน
21. บริษัทหลักทรัพย์ อินโนเวสต์ เอกซ์ จำกัด	ข่าวสารและบทวิเคราะห์ต่างๆ	เพื่อประโยชน์ของกองทุน

(3) รายชื่อผู้จัดการกองทุน ณ วันที่ 31 พฤษภาคม 2568

1. นายทลิต โขลกทรัพย์พัฒนา
2. นายสาธิต บัวชู
3. นางสาวดาวิณี สุขศรีวงศ์
4. นายปิติ ประดิพัทธ์พงษ์
5. นายกวิพ เจริญเสาวภาคย์
6. นายเอกชัย บุญยะพงค์ไชย

(4) การเปิดเผยข้อมูลการถือหน่วยลงทุนเกิน 1 ใน 3 ณ วันที่ 31 พฤษภาคม 2568

ไม่มีการถือหน่วยลงทุนเกิน 1 ใน 3 ของบุคคลใดบุคคลหนึ่ง

ผู้ถือหน่วยลงทุนสามารถตรวจสอบข้อมูลสัดส่วนการถือหน่วยลงทุนโดยตรงได้ที่ www.krungsriasset.com

(5) อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุนของกองทุน (portfolio turnover ratio) ในรอบระยะเวลาที่ผ่านมา

- KFTHAIESGA (portfolio turnover ratio) 0.09 เท่า
- KFTHAIESGD (portfolio turnover ratio) 0.09 เท่า

รายงานการบริหารจัดการกองทุนรวมเพื่อความยั่งยืน

1. ถ้อยคำรับรองว่า บลจ.มีการบริหารจัดการกองทุนที่สอดคล้องกับการมุ่งความยั่งยืนตามหลักสากล

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด (“บลจ.”) ขอรับรองว่าบลจ. มีการบริหารจัดการกองทุนที่สอดคล้องกับการมุ่งความยั่งยืนตามหลักสากล โดยบลจ. ได้ประกาศรับการปฏิบัติตามหลักธรรมาภิบาลการลงทุน เมื่อวันที่ 29 มิถุนายน 2560 และได้กำหนดนโยบายธรรมาภิบาลการลงทุน (Investment Governance Policy: I-Code) เพื่อเป็นหลักปฏิบัติสำหรับการลงทุน ภายใต้แนวคิดว่าการลงทุนในกิจการที่มีกลยุทธ์การกำกับดูแลที่ดี และมีความรับผิดชอบต่อสังคมและสิ่งแวดล้อม จะนำมาซึ่งผลตอบแทนที่ดีและยั่งยืนของลูกค้าและ/หรือผู้ถือหุ้นรายลงทุน 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

2.1 ปัญหาหรือเหตุการณ์ร้ายแรงที่เกิดขึ้น และ การเปลี่ยนแปลงการลงทุนในทรัพย์สินที่ได้ลงทุนไปแล้ว

บลจ. ได้ติดตามข่าวสารเกี่ยวกับกิจการที่ลงทุนอย่างสม่ำเสมอ กรณีที่พบว่ามีประเด็นน่าสงสัยด้านหลักการกำกับดูแลกิจการที่ดี หรือมีประเด็นเกี่ยวกับความรับผิดชอบต่อสังคมและสิ่งแวดล้อม รวมถึงความยั่งยืนของกิจการ ที่ผู้จัดการลงทุนได้ดำเนินการติดตามสถานการณ์อย่างใกล้ชิด รวมถึงสอบถามไปยังกิจการที่ลงทุนอยู่ เพื่อขอรับคำชี้แจงถึงประเด็นดังกล่าว รวมถึงแนวทางการแก้ไขและป้องกันการเกิดปัญหาซ้ำ ทั้งนี้ ในรอบ 6 เดือนที่ผ่านมา มีข่าวสารที่เกี่ยวข้องกับประเด็นด้านความยั่งยืนในหลายมิติ ไม่ว่าจะเป็นผลกระทบในเชิงลบต่อสิ่งแวดล้อม สังคม หรือการกำกับดูแลกิจการที่ดี อาทิเช่น น้ำมันรั่วไหลสู่ทะเล ซึ่งเป็นอุบัติเหตุที่เกิดขึ้นและส่งผลกระทบเป็นการชั่วคราว หรือการเข้าทำรายการที่มีประเด็นข้อสงสัยด้านการทำรายการกับบุคคลที่เกี่ยวข้องกัน หรือประเด็นการละเมิดสิทธิบัตร รวมถึงประเด็นขายสินค้าที่ไม่ได้มาตรฐาน และประเด็นด้านความโปร่งใสของการคัดเลือกผู้รับเหมาฯ ซึ่ง บลจ. ได้เข้าไปตรวจสอบเหตุการณ์ที่กล่าวมานี้ตามกระบวนการ โดยการเข้าพบปะผู้บริหารของบริษัทที่มีประเด็น ซึ่งพบว่าส่วนใหญ่ไม่ถือเป็นเหตุการณ์ร้ายแรง หรือเป็นความเข้าใจที่คลาดเคลื่อนจากการสื่อสารที่ผิดพลาด และได้รับการแก้ไขอย่างทันท่วงที หรือมีมาตรการป้องกันไม่ให้เกิดปัญหาเรื่องเดิมขึ้นอีกในอนาคต อย่างไรก็ตาม ยังมีบางรายการที่ยังอยู่ในระหว่างกระบวนการสอบสวน ซึ่งได้รับคำชี้แจงถึงความโปร่งใสในการทำรายการจากบริษัทเป็นอย่างดี โดยบลจ. ยังคงติดตามความคืบหน้าอย่างใกล้ชิดต่อไป ทั้งนี้ บลจ. ได้มีการหยุดการลงทุนเพิ่ม และลดสัดส่วนการลงทุนในบางบริษัทที่มีประเด็นข้อสงสัยเกี่ยวกับเรื่องธรรมาภิบาล จนกว่าจะมีความมั่นใจว่าประเด็นดังกล่าวได้คลี่คลายอย่างแท้จริง

2.2 ลักษณะเหตุผล และ ความจำเป็นในการพบปะผู้บริหารของกิจการ หรือผู้ออกตราสารที่กองทุนรวมเพื่อความยั่งยืนไปลงทุน รวมถึงผลจากการพบปะดังกล่าว

ในรอบ 6 เดือนที่ผ่านมา บลจ. ได้เข้าพบปะผู้บริหารของกิจการ และสอบถามเกี่ยวกับประเด็นนำสงสัย ด้านความยั่งยืนของกิจการ โดยกิจการที่มีประเด็นนำสงสัยดังกล่าว ได้ให้ความร่วมมือในการชี้แจงปัญหาที่เกิดขึ้นและมีแนวทางในการแก้ไขเพื่อลดผลกระทบต่อกิจการของบริษัทและผู้มีส่วนได้เสียที่เกี่ยวข้อง รวมถึงการป้องกันการเกิดปัญหาซ้ำเป็นอย่างดี ส่งผลให้บลจ. มีความเชื่อมั่นว่ากิจการที่บลจ. ลงทุนอยู่ยังคงมีความยั่งยืนตามหลักสากล

2.3 ความเสี่ยงที่เกี่ยวข้องกับความยั่งยืน และการนำปัจจัยความเสี่ยงดังกล่าวมาประกอบการตัดสินใจลงทุน

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

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

2.4 ผลจากการบริหารจัดการลงทุนอย่างยั่งยืน

บลจ. มีความเชื่อมั่นว่าการดำเนินการตามหลักการบริหารการลงทุนอย่างยั่งยืน ภายใต้แนวคิดที่ว่า การลงทุนในกิจการที่มีกลยุทธ์การกำกับดูแลที่ดี และมีความรับผิดชอบต่อสังคมและสิ่งแวดล้อม จะนำมาซึ่งผลตอบแทนที่ดีและยั่งยืนแก่ผู้ลงทุน และมั่นใจได้ว่ากิจการที่บลจ. ลงทุนอยู่มีความยั่งยืนตามหลักสากล