

รายงานรอบระยะเวลา 6 เดือน

รอบระยะเวลาบัญชีสิ้นสุดวันที่ 31 ตุลาคม 2562

ระดับความเสี่ยงของกองทุน

ต่ำ	1	2	3	4	5	6	7	8	8+	สูง
-----	---	---	---	---	---	---	---	---	----	-----

เรียน ท่านผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุน
กองทุนเปิดกรุงไทย SET50

บริษัทขอจัดส่ง “รายงานสรุปสถานะการลงทุน” เพื่อรายงานผลการดำเนินงานของกองทุนตั้งแต่วันที่ 1 พฤษภาคม 2562 ถึงวันที่ 31 ตุลาคม 2562 มาเพื่อโปรดทราบ

บริษัทขอขอบพระคุณท่านผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุนเป็นอย่างสูงที่ได้มอบความไว้วางใจให้บริษัทบริหารเงินลงทุนของท่าน บริษัทยังคงยืนยันในความตั้งใจและทุ่มเทความสามารถเพื่อบริหารเงินของท่านอย่างมีประสิทธิภาพที่สุดต่อไป

ขอแสดงความนับถือ
บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงไทย จำกัด (มหาชน)

ตารางเปรียบเทียบผลการดำเนินงานของ

กองทุนเปิดกรุงไทย SET50

กองทุนรวม	วันจดทะเบียน/ วันเปลี่ยนแปลง นโยบายการ ลงทุน	ราคา ต่อหน่วย (บาท)	ผลการดำเนินงาน (สิ้นสุด ณ 31 ตุลาคม 2562)							
			% ตามช่วงเวลา			% ต่อปี				
			Year to Date	ย้อนหลัง 3 เดือน	ย้อนหลัง 6 เดือน	ย้อนหลัง 1 ปี	ย้อนหลัง 3 ปี	ย้อนหลัง 5 ปี	ย้อนหลัง 10 ปี	ตั้งแต่วัน จดทะเบียน กองทุน
KT-SET50-A	30 พ.ค.2560	11.3997	5.07%	-4.32%	-2.54%	-0.29%	N/A	N/A	N/A	5.55%
Benchmark	-	-	5.56%	-4.24%	-2.35%	0.20%	N/A	N/A	N/A	6.26%
ความผันผวนของ ผลการดำเนินงาน	-	-	10.34%	12.95%	11.46%	10.93%	N/A	N/A	N/A	11.08%
ความผันผวนของ ตัวชี้วัด	-	-	10.36%	12.86%	11.42%	10.98%	N/A	N/A	N/A	11.26%

Benchmark = ดัชนีผลตอบแทนรวม SET50 (SET50 TRI)

ความผันผวนคำนวณเป็น % ต่อปี

Tracking Different (TD) ย้อนหลัง 1 ปี ของกองทุนเท่ากับ -0.51% ต่อปี

Tracking Error (TE) ย้อนหลัง 1 ปี ของกองทุนเท่ากับ 0.29% ต่อปี

การแสดงผลการดำเนินงานของกองทุนรวมด้วยวิธีการตามปีปฏิทิน

เปรียบเทียบกับตัวชี้วัด และค่าความเสี่ยงของกองทุนรวม (SD)

ปี	% ต่อปี									
	2552	2553	2554	2555	2556	2557	2558	2559	2560	2561
KT-SET50-A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	15.03%	-5.68%
Benchmark	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	15.82%	-5.23%
ความผันผวนของ ผลการดำเนินงาน	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	7.37%	13.27%
ความผันผวนของตัวชี้วัด	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	7.56%	13.57%

* ผลการดำเนินงานปี 2560 เป็น % ตามช่วงเวลา

Benchmark = ดัชนีผลตอบแทนรวม SET50 (SET50 TRI)

ความผันผวนคำนวณเป็น % ต่อปี

Tracking Different (TD) ย้อนหลัง 1 ปี ของกองทุนเท่ากับ -0.51% ต่อปี

Tracking Error (TE) ย้อนหลัง 1 ปี ของกองทุนเท่ากับ 0.29% ต่อปี

- เอกสารการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวมฉบับนี้ได้จัดทำขึ้นตามมาตรฐานการวัดผลการดำเนินงานของ กองทุนรวมของ สมาคมบริษัทจัดการลงทุน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวมไม่ได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต
- การลงทุนมีความเสี่ยง ผู้ลงทุนควรศึกษาข้อมูลก่อนตัดสินใจลงทุน

แบบแสดงค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม

กองทุนเปิดกรุงไทย SET50

ของรอบบัญชีตั้งแต่วันที่ 1 พฤษภาคม 2562 ถึงวันที่ 31 ตุลาคม 2562

ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม * (fund's direct expenses)	จำนวนเงิน หน่วย : พันบาท	ร้อยละของ มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ
ค่าธรรมเนียมการจัดการ	4,910.92	0.22
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์	294.66	0.01
ค่าใช้จ่ายอื่น ๆ**	334.06	0.01
รวมค่าใช้จ่ายทั้งหมด***	5,539.64	0.24

*เป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่มแล้ว

**ค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายที่แต่ละรายการมีมูลค่าน้อยกว่าร้อยละ 0.01 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิ

***ไม่รวมค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์และค่าธรรมเนียมต่างๆ ที่เกิดขึ้นจากการซื้อขายหลักทรัพย์

บริษัทนายหน้าที่ได้รับค่านายหน้าสูงสุดสิบอันดับแรก

กองทุนเปิดกรุงไทย SET50

ระหว่างวันที่ 1 พฤษภาคม 2562 ถึงวันที่ 31 ตุลาคม 2562

อันดับ	ชื่อ	ค่านายหน้า (บาท)	อัตราส่วน ค่านายหน้า
1	บริษัทหลักทรัพย์ เคทีบี (ประเทศไทย) จำกัด	295,807.60	29.56%
2	บริษัทหลักทรัพย์ กรุงศรี จำกัด (มหาชน)	237,628.33	23.75%
3	บริษัทหลักทรัพย์ คันทรี กรุ๊ป จำกัด (มหาชน)	194,738.36	19.46%
4	บริษัทหลักทรัพย์ ยูโอบี เคย์เฮียน(ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)	143,260.41	14.32%
5	บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)	126,169.82	12.61%
6	บริษัทหลักทรัพย์ ไทยพาณิชย์ จำกัด	2,221.88	0.22%
7	บริษัทหลักทรัพย์ กสิกรไทย จำกัด (มหาชน)	564.13	0.06%
8	บริษัทหลักทรัพย์ โนมูระ พัฒนสิน จำกัด (มหาชน)	249.61	0.02%
รวม		1,000,640.14	100.00%

ข้อมูลอัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน (Portfolio Turnover Ratio : PTR)

กองทุนเปิดกรุงไทย SET50

ระหว่างวันที่ 1 พฤษภาคม 2562 ถึงวันที่ 31 ตุลาคม 2562

PTR = 29.21%

รายงานสถานะการลงทุนการกู้ยืมเงินและการก่อภาระผูกพัน

กองทุนเปิดกรุงไทย SET50

มูลค่า ณ วันที่ 31 ตุลาคม 2562

รายละเอียดการลงทุน	มูลค่าตามราคาตลาด	%NAV
หลักทรัพย์หรือทรัพย์สินในประเทศ	2,538,710,945.45	99.55
หุ้นสามัญ		
หมวดเกษตรและอุตสาหกรรมอาหาร	144,061,330.00	5.65
หมวดทรัพยากร	700,883,418.25	27.48
หมวดเทคโนโลยี	272,930,100.00	10.70
หมวดธุรกิจการเงิน	390,464,800.00	15.31
หมวดบริการ	688,761,407.20	27.01
หมวดสินค้าอุตสาหกรรม	83,823,000.00	3.29
หมวดอสังหาริมทรัพย์และก่อสร้าง	257,786,890.00	10.11
อื่นๆ	11,355,157.72	0.45
ประเภทหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินอื่นตามที่สำนักงานกำหนด	22,026,815.43	0.87
ประเภทรายการค้างรับอื่นๆ	126,855.47	0.00
ประเภทรายการค้างจ่ายหรือหนี้สินอื่นๆ	-10,798,513.18	-0.42
มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ	2,550,066,103.17	100.00

รายงานสรุปจำนวนเงินลงทุนในตราสารแห่งนี้ เงินฝาก หรือตราสารกึ่งหนี้กึ่งทุน

กองทุนเปิดกรุงไทย SET50

มูลค่า ณ วันที่ 31 ตุลาคม 2562

กลุ่มของตราสาร	มูลค่าตามราคาตลาด	%NAV
(ก) ตราสารภาครัฐไทย/ตราสารภาครัฐต่างประเทศ	0.00	0.00
(ข) ตราสารที่ธนาคารที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้น ธนาคารพาณิชย์ หรือบริษัทเงินทุนเป็นผู้ออก/ผู้รับรอง/อวัล/สลักหลัง/ค้ำประกัน	0.00	0.00
(ค) ตราสารหรือผู้ออกที่มีบริษัทที่ได้รับ rating ในระดับ investment grade เป็นผู้ออก/ผู้รับรอง/อวัล/สลักหลัง/ค้ำประกัน	0.00	0.00
(ง) ตราสารหรือผู้ออกที่มีบริษัทที่ได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือในระดับที่ต่ำกว่า investment grade หรือไม่มี rating เป็นผู้ออก/ผู้รับรอง/อวัล/สลักหลัง/ค้ำประกัน	0.00	0.00
สัดส่วนสูงสุด (upper limit) ที่บริษัทจัดการ คาดว่าจะลงทุนในกลุ่ม (ง)	15.00%	NAV

รายละเอียดตัวตราสารและอันดับความน่าเชื่อถือของตราสารทุกตัวใน port

กองทุนเปิดกรุงไทย SET50

มูลค่า ณ วันที่ 31 ตุลาคม 2562

ประเภท	ผู้ออก	มูลค่าตาม ราคาตลาด
หุ้นสามัญ	บมจ. ดับบลิวเอชเอ คอร์ปอเรชั่น	14,905,800.00
หุ้นสามัญ	บมจ. บ้านปู เพาเวอร์	11,494,440.00
หุ้นสามัญ	บมจ. บ้านปู	12,965,320.00
หุ้นสามัญ	บมจ. บัตรกรุงไทย	23,165,300.00
หุ้นสามัญ	บมจ. ไทยออยล์	30,263,300.00
หุ้นสามัญ	บมจ. ไทยยูเนี่ยน กรุ๊ป	15,086,180.00
หุ้นสามัญ	บมจ. โทเทิล แอ็คเซียส คอมมูนิเคชั่น	31,787,400.00
หุ้นสามัญ	บมจ. ทูมออนไลน์	13,382,500.00
หุ้นสามัญ	บมจ. ทีโอเอ เพ้นท์ (ประเทศไทย)	19,773,000.00
หุ้นสามัญ	บมจ. ทีเอสโก้ ไฟแนนซ์เชียลกรุ๊ป	16,877,250.00
หุ้นสามัญ	บมจ. ท่าอากาศยานไทย	241,988,125.00
หุ้นสามัญ	ธนาคารกรุงเทพ จำกัด (มหาชน)	71,862,000.00
หุ้นสามัญ	บมจ. เติลต้า อีเลคโทรนิคส์ (ประเทศไทย)	11,888,800.00
หุ้นสามัญ	บมจ. เบอร์ลี่ ยุคเกอร์	42,285,750.00
หุ้นสามัญ	บมจ. เซ็นทรัลพัฒนา	62,188,800.00
หุ้นสามัญ	บมจ. ซีพี ออลล์	151,686,600.00
หุ้นสามัญ	บมจ. เจริญโภคภัณฑ์อาหาร	47,076,100.00
หุ้นสามัญ	บมจ. คาราบาวกรุ๊ป	18,248,550.00
หุ้นสามัญ	บมจ. โกลบอล เพาเวอร์ ซินเนอร์ยี	50,198,573.25
หุ้นสามัญ	บมจ. กรุงเทพดุสิตเวชการ	82,572,000.00
หุ้นสามัญ	ธนาคารไทยพาณิชย์ จำกัด (มหาชน)	82,308,800.00
หุ้นสามัญ	ธนาคารทหารไทย จำกัด (มหาชน)	13,672,080.00
หุ้นสามัญ	ธนาคารกสิกรไทย จำกัด (มหาชน)	71,988,100.00
หุ้นสามัญ	ธนาคารกรุงไทย จำกัด (มหาชน)	50,226,620.00
หุ้นสามัญ	บมจ. ทูม คอร์ปอเรชั่น	36,121,000.00
หุ้นสามัญ	บมจ. ศรีสวัสดิ์ คอร์ปอเรชั่น	18,517,950.00
หุ้นสามัญ	บริษัท กัลฟ์ โคเจนเนอเรชั่น จำกัด	74,779,200.00
หุ้นสามัญ	บมจ. อินโดรามา เวนเจอร์ส	34,036,800.00
หุ้นสามัญ	บมจ. แลนด์แอนด์เฮ้าส์	25,097,780.00
หุ้นสามัญ	บมจ. เมืองไทย แคปปิตอล	28,464,200.00
หุ้นสามัญ	บมจ. ทางด่วนและรถไฟฟ้ากรุงเทพ	35,740,440.00

รายละเอียดตัวตราสารและอันดับความน่าเชื่อถือของตราสารทุกตัวใน port (ต่อ)

กองทุนเปิดกรุงไทย SET50

มูลค่า ณ วันที่ 31 ตุลาคม 2562

ประเภท	ผู้ออก	มูลค่าตาม ราคาตลาด
หุ้นสามัญ	บมจ. โฮม โปรดักส์ เซ็นเตอร์	48,971,840.00
หุ้นสามัญ	บมจ. ไออาร์พีซี	15,042,960.00
หุ้นสามัญ	บมจ. โอเอสสุภา	27,650,500.00
หุ้นสามัญ	บมจ. แอสเสท เวิร์ด คอร์ป	40,548,310.00
หุ้นสามัญ	บมจ. แอดวานซ์ อินโฟร์ เซอร์วิส	147,315,700.00
หุ้นสามัญ	บมจ. บี.กริม เพาเวอร์	27,100,800.00
หุ้นสามัญ	บมจ. สยามโกลบอลเฮ้าส์	13,829,127.20
หุ้นสามัญ	บมจ. บีทีเอส กรุ๊ป โฮลดิ้งส์	37,004,100.00
หุ้นสามัญ	บมจ. โรบินสัน	15,692,625.00
หุ้นสามัญ	บมจ. โรงพยาบาลบำรุงราษฎร์	18,990,800.00
หุ้นสามัญ	บมจ. ไมเนอร์ อินเตอร์เนชั่นแนล	36,000,000.00
หุ้นสามัญ	บมจ. พีทีที โกลบอล เคมิคอล	49,786,200.00
หุ้นสามัญ	บมจ. พลังงานบริสุทธิ์	33,111,600.00
หุ้นสามัญ	บมจ. ผลิตไฟฟ้าราชบุรีโฮลดิ้ง	23,079,000.00
หุ้นสามัญ	บมจ. ผลิตไฟฟ้า	39,523,300.00
หุ้นสามัญ	บมจ. ปูนซิเมนต์ไทย	95,273,200.00
หุ้นสามัญ	บมจ. ปตท. สำรวจและผลิตปิโตรเลียม	103,521,550.00
หุ้นสามัญ	บมจ. ปตท.	279,803,375.00
หุ้นสามัญ	บมจ. อินทัช โฮลดิ้งส์	45,817,200.00

สถาบันการจัดอันดับความน่าเชื่อถือ Tris Rating

ทริสเรตติ้งใช้สัญลักษณ์ตัวอักษรแสดงผลการจัดอันดับเครดิตองค์กรและตราสารหนี้ระยะกลางและระยะยาวที่มีอายุตั้งแต่ 1 ปีขึ้นไป จำนวน 8 อันดับ โดยเริ่มจาก AAA ซึ่งเป็นอันดับเครดิตสูงสุด จนถึง D ซึ่งเป็นอันดับต่ำสุดซึ่งแต่ละสัญลักษณ์มีความหมายดังนี้

- AAA** อันดับเครดิตองค์กรหรือตราสารหนี้มีความเสี่ยงต่ำที่สุด ผู้ออกตราสารหนี้มีความสามารถในการชำระดอกเบี้ยและคืนเงินต้นในเกณฑ์สูงสุด และได้รับผลกระทบน้อยมากจากการเปลี่ยนแปลงทางธุรกิจ เศรษฐกิจ และสิ่งแวดล้อมอื่นๆ
- AA** องค์กรหรือตราสารหนี้มีความเสี่ยงต่ำมาก ผู้ออกตราสารหนี้มีความสามารถในการชำระดอกเบี้ยและคืนเงินต้นในเกณฑ์สูงมาก แต่อาจได้รับผลกระทบจากการเปลี่ยนแปลงทางธุรกิจ เศรษฐกิจ และสิ่งแวดล้อมอื่นๆ มากกว่าอันดับเครดิตที่อยู่ในระดับ AAA
- A** องค์กรหรือตราสารหนี้มีความเสี่ยงในระดับต่ำ ผู้ออกตราสารหนี้มีความสามารถในการชำระดอกเบี้ยและคืนเงินต้นในเกณฑ์สูง แต่อาจได้รับผลกระทบจากการเปลี่ยนแปลงทางธุรกิจ เศรษฐกิจ และสิ่งแวดล้อมอื่นๆ มากกว่าอันดับเครดิตที่อยู่ในระดับสูงกว่า
- BBB** องค์กรหรือตราสารหนี้มีความเสี่ยงในระดับปานกลาง ผู้ออกตราสารหนี้มีความสามารถในการชำระดอกเบี้ยและคืนเงินต้นในเกณฑ์ที่เพียงพอ แต่มีความอ่อนไหวต่อการเปลี่ยนแปลงทางธุรกิจ เศรษฐกิจ และสิ่งแวดล้อมอื่นๆ มากกว่า และอาจมีความสามารถในการชำระหนี้อ่อนแอลงเมื่อเทียบกับอันดับเครดิตที่อยู่ในระดับสูงกว่า
- BB** องค์กรหรือตราสารหนี้มีความเสี่ยงในระดับสูง ผู้ออกตราสารหนี้มีความสามารถในการชำระดอกเบี้ยและคืนเงินต้นในเกณฑ์ต่ำกว่าระดับปานกลาง และจะได้รับผลกระทบจากการเปลี่ยนแปลงที่รุนแรง (Adverse changes) ทางธุรกิจ เศรษฐกิจ และสิ่งแวดล้อมอื่นๆ ซึ่งอาจส่งผลให้ความสามารถในการชำระหนี้อยู่ในเกณฑ์ที่ไม่เพียงพอ
- B** องค์กรหรือตราสารหนี้มีความเสี่ยงในระดับสูงมาก ผู้ออกตราสารหนี้มีความสามารถในการชำระดอกเบี้ยและคืนเงินต้นในเกณฑ์ต่ำและอาจจะหมดความสามารถหรือความตั้งใจในการชำระหนี้ได้ตามการเปลี่ยนแปลงของสถานการณ์ทางธุรกิจ เศรษฐกิจ และสิ่งแวดล้อมอื่นๆ
- C** องค์กรหรือตราสารหนี้มีความเสี่ยงในการผิดนัดชำระหนี้สูงที่สุด ผู้ออกตราสารหนี้ไม่มีความสามารถในการชำระดอกเบี้ยและคืนเงินต้นตามกำหนดอย่างชัดเจน โดยต้องอาศัยเงื่อนไขที่เอื้ออำนวยทางธุรกิจ เศรษฐกิจ และสิ่งแวดล้อมอื่นๆ อย่างมากจึงจะมีสามารถในการชำระหนี้ได้
- D** องค์กรหรือตราสารหนี้อยู่ในสถานะผิดนัดชำระหนี้ โดยผู้ออกตราสารหนี้ไม่สามารถชำระดอกเบี้ยและคืนเงินต้นได้ตามกำหนด อันดับเครดิตจาก AA ถึง C อาจมีเครื่องหมายบวก (+) หรือลบ (-) ต่อท้ายเพื่อจำแนกความแตกต่างของคุณภาพของอันดับเครดิตภายในระดับเดียวกัน

สำหรับการจัดอันดับเครดิตตราสารหนี้ระยะสั้น ทริสเรตติ้งจะเน้นการวิเคราะห์โอกาสที่จะเกิดการผิดนัดชำระหนี้ (Default Probability) เป็นสำคัญโดยมิได้คำนึงถึงระดับของการชดเชยความเสียหายที่จะเกิดขึ้นจากการผิดนัดชำระหนี้ (Recovery After Default) แต่อย่างใด โดยตราสารหนี้ระยะสั้นมีอายุต่ำกว่า 1 ปี สัญลักษณ์และนิยามอันดับเครดิตตราสารหนี้ระยะสั้นจำแนกเป็น 5 ระดับ ดังนี้

- T1** ผู้ออกตราสารหนี้มีสถานะทั้งทางด้านการตลาดและการเงินที่แข็งแกร่งในระดับดีมาก มีสภาพคล่องที่ดีมาก และนักลงทุนจะได้รับ ความคุ้มครองจากการผิดนัดชำระหนี้ที่ดีกว่าอันดับเครดิตในระดับอื่น ผู้ออกตราสารหนี้ที่ได้รับอันดับเครดิตในระดับดังกล่าวซึ่งมี เครื่องหมาย “+” ด้วยจะได้รับความคุ้มครองด้านการผิดนัดชำระหนี้ที่สูงยิ่งขึ้น
- T2** ผู้ออกตราสารหนี้มีสถานะทั้งทางด้านการตลาดและการเงินที่แข็งแกร่งในระดับดี และมีความสามารถในการชำระหนี้ระยะสั้นใน ระดับที่น่าพอใจ
- T3** ผู้ออกตราสารหนี้มีความสามารถในการชำระหนี้ระยะสั้นในระดับที่ยอมรับได้
- T4** ผู้ออกตราสารหนี้มีความสามารถในการชำระหนี้ระยะสั้นที่ค่อนข้างอ่อนแอ
- D** เป็นระดับที่อยู่ในสถานะผิดนัดชำระหนี้ โดยผู้ออกตราสารหนี้ไม่สามารถชำระดอกเบี้ยและคืนเงินต้นได้ตามกำหนด

อันดับเครดิตทุกประเภทที่จัดโดยทริสเรตติ้งเป็นอันดับเครดิตตราสารหนี้ในสกุลเงินบาท ซึ่งสะท้อนความสามารถในการชำระหนี้ของผู้ออกตราสารหนี้โดยไม่รวมความเสี่ยงจากการแปลงค่าเงินสกุลเงินบาทเป็นสกุลเงินตราต่างประเทศ

นอกจากนี้ทริสเรตติ้งยังใช้เครื่องหมาย “(sf)” ต่อท้ายสัญลักษณ์อันดับเครดิตตราสารหนี้เพื่อระบุว่าตราสารหนี้ที่มีเครื่องหมายดังกล่าวเป็นตราสารที่มีโครงสร้างซับซ้อน (Structured Finance Product) ตามเกณฑ์ของคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ (ก.ล.ต.) ด้วย โดยที่ความหมายของสัญลักษณ์อันดับเครดิตยังคงเหมือนเดิมตามนิยามข้างต้น

ทริสเรตติ้งยังกำหนด “แนวโน้มอันดับเครดิต” (Rating Outlook) เพื่อสะท้อนความเป็นไปได้ของการเปลี่ยนแปลงอันดับเครดิตของผู้ออกตราสารหนี้ในระยะปานกลางหรือระยะยาว โดยทริสเรตติ้งจะพิจารณาถึงโอกาสที่จะเกิดการเปลี่ยนแปลงของภาวะอุตสาหกรรมและสภาพแวดล้อมทางธุรกิจในอนาคตของผู้ออกตราสารหนี้ที่อาจกระทบต่อความสามารถในการชำระหนี้ ส่วนแนวโน้มอันดับเครดิตของตราสารหนี้โดยส่วนใหญ่จะเท่ากับแนวโน้มอันดับเครดิตขององค์กรผู้ออกตราสารหนี้ฯ หรือองค์กรซึ่งรับภาระผูกพันในการชำระหนี้ของตราสารหนี้ฯ ทั้งนี้ แนวโน้มอันดับเครดิตแบ่งออกเป็น 4 ระดับ ได้แก่

Positive หมายถึง อันดับเครดิตอาจปรับขึ้น

Stable หมายถึง อันดับเครดิตอาจไม่เปลี่ยนแปลง

Negative หมายถึง อันดับเครดิตอาจปรับลดลง

Developing หมายถึง อันดับเครดิตอาจปรับขึ้น ปรับลดลง หรือไม่เปลี่ยนแปลง

ทริสเรตติ้งอาจประกาศ “เครดิตพิบินจ” (CreditAlert) ซึ่งเป็นขั้นตอนหนึ่งของการทบทวนอันดับเครดิตที่ทริสเรตติ้งประกาศผลต่อสาธารณะไปแล้วในกรณีเมื่อเกิดเหตุการณ์สำคัญซึ่งทริสเรตติ้งพิจารณาแล้วเห็นว่าอาจส่งผลกระทบต่อธุรกิจหรือการเงินขององค์กรที่ทริสเรตติ้งจัดอันดับ แต่ข้อมูลดังกล่าวยังไม่ชัดเจน หรืออาจจะยังสรุปผลไม่ได้ เช่น การควบรวมกิจการ การลงทุนใหม่ การเปลี่ยนแปลงโครงสร้างเงินทุน หรือแผนงานต่างๆ ฯลฯ โดยจะยังไม่มีการเปลี่ยนแปลงผลอันดับเครดิตเดิมแต่อย่างใด ทั้งนี้ เพื่อเตือนให้นักลงทุนระมัดระวังในการที่จะลงทุนในตราสารหนี้ขององค์กรนั้นๆ รายงานเครดิตพิบินจประกอบด้วย เหตุผล (Rationale) ที่แจ้งเหตุในการออกประกาศเตือนพร้อมระบุ “เครดิตพิบินจ” (CreditAlert Designation) ไว้พร้อมกับอันดับเครดิตปัจจุบัน โดยงดการระบุ “แนวโน้มอันดับเครดิต” (Rating Outlook)

เครดิตพิบินจ เป็นการบอกทิศทางของการเปลี่ยนแปลงอันดับเครดิตในระยะอันใกล้ ซึ่งมี 3 รูปแบบ คือ (1) Positive (*บวก*) (2) Negative (*ลบ*) และ (3) Developing (*ยังไม่ชัดเจน*)

สถาบันการจัดอันดับความน่าเชื่อถือ Fitch Rating

คำอธิบายการจัดอันดับความน่าเชื่อถือระยะยาว สำหรับประเทศไทย

AAA (tha) แสดงถึงระดับความน่าเชื่อถือขั้นสูงสุดของอันดับความน่าเชื่อถือภายในประเทศไทยซึ่งกำหนดโดย Fitch โดยอันดับความน่าเชื่อถือนี้จะมอบให้กับอันดับความน่าเชื่อถือที่มีความเสี่ยง “น้อยที่สุด” เมื่อเปรียบเทียบกับผู้ออกตราสารหรือตราสารอื่นในประเทศไทย และโดยปกติแล้วจะกำหนดให้แก่ตราสารทางการเงินที่ออกหรือค้ำประกันโดยรัฐบาล

AA (tha) แสดงถึงระดับความน่าเชื่อถือขั้นสูงมากเปรียบเทียบกับผู้ออกตราสารหรือตราสารอื่นในประเทศไทยโดยระดับความน่าเชื่อถือของตราสารทางการเงินขั้นนี้ต่างจากผู้ออกตราสารหรือตราสารอื่นที่ได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือขั้นสูงสุดของประเทศไทยเพียงเล็กน้อย

BBB (tha) แสดงถึงระดับความน่าเชื่อถือขั้นปานกลางเมื่อเปรียบเทียบกับผู้ออกตราสารอื่นในประเทศไทย อย่างไรก็ตามมีความเป็นไปได้มากกว่าการเปลี่ยนแปลงของสถานการณ์หรือสภาพทางเศรษฐกิจจะมีผลกระทบต่อความสามารถในการชำระหนี้ได้ตรงตามกำหนดเวลาของตราสารทางการเงินเหล่านี้มากกว่าตราสารหนี้อื่นที่ได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือในประเภทที่สูงกว่า

- BB (tha)** แสดงถึงระดับความน่าเชื่อถือค่อนข้างต่ำเมื่อเปรียบเทียบกับผู้ออกตราสารอื่นในประเทศไทย การชำระหนี้ตามเงื่อนไขของตราสารเหล่านี้ภายในประเทศนั้นๆ มีความไม่แน่นอนในระดับหนึ่งและความสามารถในการชำระหนี้ขึ้นตามกำหนดเวลาจะมีความไม่แน่นอนมากขึ้นตามการเปลี่ยนแปลงของเศรษฐกิจในทางลบ
- B (tha)** แสดงถึงระดับความน่าเชื่อถือค่อนข้างต่ำอย่างมีนัยสำคัญเมื่อเปรียบเทียบกับผู้ออกตราสารหนี้อื่นๆ ในประเทศไทยการปฏิบัติตามเงื่อนไขของตราสารหนี้และข้อผูกพันทางการเงินยังคงเป็นไปได้ในปัจจุบัน แต่ความมั่นคงยังจำกัดอยู่ในระดับหนึ่งเท่านั้น และความสามารถในการชำระหนี้ตามกำหนดอย่างต่อเนื่องเท่านั้น และความสามารถในการชำระหนี้ตามกำหนดอย่างต่อเนื่องนั้น ไม่แน่นอนขึ้นอยู่กับสถานะที่เอื้อต่อการดำเนินธุรกิจและสภาพทางเศรษฐกิจ
- CCC (tha), CC (tha), C (tha)** แสดงถึงระดับความน่าเชื่อถือค่อนข้างต่ำมากเมื่อเปรียบเทียบกับผู้ออกตราสารหรือตราสารอื่นในประเทศไทยความสามารถในการปฏิบัติตามข้อผูกพันทางการเงินขึ้นอยู่กับสถานะที่เอื้อต่อการดำเนินธุรกิจและการพัฒนาทางเศรษฐกิจเพียงอย่างเดียว
- D (tha)** อันดับความน่าเชื่อถือเหล่านี้ จะถูกกำหนดให้สำหรับองค์กรหรือตราสารหนี้ซึ่งกำลังอยู่ในภาวะผิดนัดชำระหนี้ในปัจจุบัน

คำอธิบายการจัดอันดับความน่าเชื่อถือระยะสั้น สำหรับประเทศไทย

- F1 (tha)** แสดงถึงระดับความสามารถขั้นสูงสุดในการชำระหนี้ตามเงื่อนไขของตราสารตรงตามกำหนดเมื่อเปรียบเทียบกับผู้ออกตราสารหรือตราสารอื่นๆ ในประเทศไทยภายใต้อันดับความน่าเชื่อถือนั้นจะมอบให้สำหรับอันดับความน่าเชื่อถือที่มีความเสี่ยง “น้อยที่สุด” เมื่อเปรียบเทียบกับผู้ออกตราสารอื่นในประเทศเดียวกัน และโดยปกติแล้วจะกำหนดให้กับตราสารทางการเงินที่ออกหรือค้ำประกันโดยรัฐบาล ในกรณีที่มีระดับความน่าเชื่อถือสูงเป็นพิเศษจะมีสัญลักษณ์ “+” แสดงไว้เพิ่มเติมจากอันดับความน่าเชื่อถือที่กำหนด
- F2 (tha)** แสดงถึงระดับความสามารถในการชำระหนี้ตามเงื่อนไขทางการเงินตามกำหนดเวลาในระดับที่น่าพอใจเมื่อเปรียบเทียบกับผู้ออกตราสารหนี้ในประเทศเดียวกัน อย่างไรก็ตาม ระดับของความน่าเชื่อถือดังกล่าวยังไม่อาจเทียบเท่ากับกรณีที่ได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือที่สูงกว่า
- F3 (tha)** แสดงถึงระดับความสามารถในการชำระหนี้ตามเงื่อนไขของตราสารการเงินตามกำหนดเวลาในระดับปานกลางเมื่อเปรียบเทียบกับผู้ออกตราสารอื่นหรือตราสารอื่นในประเทศเดียวกัน อย่างไรก็ตาม ความสามารถในการชำระหนี้ดังกล่าวจะมีความไม่แน่นอนมากขึ้นไปตามความเปลี่ยนแปลงในทางลบในระยะสั้นมากกว่าตราสารที่ได้รับการจัดอันดับที่สูงกว่า
- B (tha)** แสดงถึงระดับความสามารถในการชำระหนี้ตามเงื่อนไขของตราสารการเงินตามกำหนดเวลาที่ไม่แน่นอน เมื่อเปรียบเทียบกับผู้ออกตราสารอื่นในประเทศไทย ความสามารถในการชำระหนี้ดังกล่าวจะไม่แน่นอนมากขึ้นตามการเปลี่ยนแปลงทางเศรษฐกิจและการเงินในทางลบระยะสั้น
- C (tha)** แสดงถึงระดับความสามารถในการชำระหนี้ตามเงื่อนไขของตราสารการเงินตามกำหนดเวลาที่ไม่แน่นอนสูง เมื่อเปรียบเทียบกับผู้ออกตราสารอื่นในประเทศไทยความสามารถในการปฏิบัติตามข้อผูกพันทางการเงินขึ้นอยู่กับสถานะที่เอื้อต่อการดำเนินธุรกิจและสภาพการณ์ทางเศรษฐกิจเท่านั้น
- D (tha)** แสดงถึงการผิดนัดชำระหนี้ที่เกิดขึ้นแล้วหรือกำลังจะเกิดขึ้น

หมายเหตุประกอบการจัดอันดับความน่าเชื่อถือในระยะยาว ในระยะสั้น สำหรับประเทศไทย

เครื่องบ่งชี้พิเศษสำหรับประเทศไทย “tha” จะถูกระบุไว้ต่อจากอันดับความน่าเชื่อถือทุกระดับ เพื่อแยกความแตกต่างออกจากการจัดอันดับความน่าเชื่อถือระดับสากล เครื่องหมาย “+” หรือ “-” อาจจะถูกระบุไว้เพิ่มเติมต่อจากอันดับความน่าเชื่อถือสำหรับประเทศหนึ่งๆ เพื่อแสดงถึงสถานะย่อยโดยเปรียบเทียบกันภายในอันดับความน่าเชื่อถือชั้นหลัก ทั้งนี้ จะไม่มีการระบุสัญลักษณ์ ต่อท้ายดังกล่าว สำหรับอันดับความน่าเชื่อถืออันดับ “AAA (tha)” หรืออันดับที่ต่ำกว่า “CCC (tha)”

สำหรับอันดับความน่าเชื่อถือในระยะยาวและจะไม่มีการระบุสัญลักษณ์ต่อท้ายดังกล่าวสำหรับอันดับความน่าเชื่อถือในระยะสั้น นอกเหนือจาก “F1(tha)”

สัญญาณการปรับอันดับความน่าเชื่อถือ (Rating Watch) : สัญญาณการปรับอันดับความน่าเชื่อถือจะถูกใช้เพื่อแจ้งให้นักลงทุนทราบว่ามีความเป็นไปได้ที่จะมีการเปลี่ยนแปลงอันดับความน่าเชื่อถือและแจ้งแนวโน้มทิศทางของการเปลี่ยนแปลงดังกล่าว สัญญาณดังกล่าวอาจระบุเป็น “สัญญาณบวก” ซึ่งบ่งชี้แนวโน้มในการปรับอันดับความน่าเชื่อถือให้สูงขึ้น “สัญญาณลบ” จะบ่งชี้แนวโน้มในการปรับอันดับความน่าเชื่อถือให้ต่ำลง หรือ “สัญญาณวิวัฒน์” ในกรณีที่อันดับความน่าเชื่อถืออาจจะได้รับการปรับขึ้นปรับลงหรือคงที่โดยปกติ สัญญาณการปรับอันดับความน่าเชื่อถือนักจะถูกระบุไว้สำหรับช่วงระยะเวลาสั้นๆ

กองทุนเปิดกรุงไทย SET50

งบดุล

ณ วันที่ 31 ตุลาคม 2562

(บาท)

สินทรัพย์

เงินลงทุนตามราคายุติธรรม (ราคาทุน 2,584,430,737.35 บาท)	2,538,710,945.45
เงินสดและเงินฝากธนาคาร	21,999,882.10
ลูกหนี้	
จากเงินปันผลและดอกเบี้ย	50,046.38
ค่าใช้จ่ายรอการตัดบัญชี	93,742.42
รวมสินทรัพย์	2,560,864,616.35

หนี้สิน

เจ้าหนี้	
จากการซื้อเงินลงทุน	9,081,979.40
จากการรับคืนหรือรับซื้อคืนหน่วยลงทุน	404,711.21
ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย	1,311,822.57
หนี้สินรวม	10,798,513.18

สินทรัพย์สุทธิ

2,550,066,103.17

สินทรัพย์สุทธิ :

ทุนที่ได้รับจากผู้ถือหน่วยลงทุน	2,236,956,757.57
กำไรสะสม	20,438,051.60
บัญชีปรับสมดุล	292,671,294.00
สินทรัพย์สุทธิ	2,550,066,103.17

จำนวนหน่วยลงทุนที่ออกจำหน่ายแล้วทั้งหมด(หน่วย)	223,695,675.6466
สินทรัพย์สุทธิต่อหน่วยลงทุน (บาท)	11.3997

กองทุนเปิดกรุงไทย SET50

งบกำไรขาดทุน

สำหรับรอบระยะเวลาบัญชี ตั้งแต่ วันที่ 1 พฤษภาคม 2562 ถึงวันที่ 31 ตุลาคม 2562

	(บาท)
รายได้จากการลงทุน	
รายได้เงินปันผล	27,182,208.92
รายได้ดอกเบี้ย	67,909.31
รายได้ทั้งสิ้น	27,250,118.23
ค่าใช้จ่าย	
ค่าธรรมเนียมการจัดการ	4,910,919.65
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์	294,655.16
ค่าธรรมเนียมวิชาชีพ	
ค่าธรรมเนียมการสอบบัญชี	25,136.98
ค่าใช้จ่ายในการดำเนินโครงการ	308,929.30
ค่าใช้จ่ายทั้งสิ้น	5,539,641.09
รายได้จากการลงทุนสุทธิ	21,710,477.14
รายการกำไรหรือขาดทุนสุทธิจากเงินลงทุน	
รายการกำไรหรือขาดทุนสุทธิที่เกิดขึ้นทั้งสิ้น	651,658.48
รายการกำไรหรือขาดทุนสุทธิที่ยังไม่เกิดขึ้นทั้งสิ้น (ระหว่างปี)	(63,308,126.39)
รวมรายการกำไรหรือขาดทุนจากการลงทุนที่เกิดขึ้นและที่ยังไม่เกิดขึ้น	(62,656,467.91)
การเพิ่มขึ้นในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงานก่อนหักเงินปันผลจ่าย	(40,945,990.77)

กองทุนเปิดกรุงไทย SET50

งบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน

ณ วันที่ 31 ตุลาคม 2562

จัดการโดย บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงไทย จำกัด (มหาชน)

	มูลค่าที่ตราไว้/ จำนวนหน่วย	ราคาทุน	ดอกเบี้ย / เงินปันผล ค้างรับ	มูลค่ายุติธรรม	อัตราส่วน ของมูลค่า ยุติธรรม
หุ้นและใบสำคัญแสดงสิทธิที่จะซื้อหุ้น					
หุ้นสามัญ					
<u>หมวดธนาคาร (B0)</u>					
BBL - ธนาคารกรุงเทพ จำกัด (มหาชน)	413,000.00	80,304,266.59	0.00	71,862,000.00	2.83%
KBANK - ธนาคารกรุงไทย จำกัด (มหาชน)	517,900.00	97,757,576.26	0.00	71,988,100.00	2.84%
KTB - ธนาคารกรุงไทย จำกัด (มหาชน)	3,025,700.00	56,247,362.18	0.00	50,226,620.00	1.98%
SCB - ธนาคารไทยพาณิชย์ จำกัด (มหาชน)	734,900.00	97,377,248.02	0.00	82,308,800.00	3.24%
TCAP - บมจ. ทูน่าชานด	252,500.00	13,442,305.64	0.00	13,382,500.00	0.53%
TISCO - บมจ. ทีเอสไอไฟแนนเชียลกรุ๊ป	173,100.00	15,373,206.09	0.00	16,877,250.00	0.66%
TMB - ธนาคารทหารไทย จำกัด (มหาชน)	9,494,500.00	18,805,965.46	0.00	13,672,080.00	0.54%
รวม หมวดธนาคาร (B0)	14,611,600.00	379,307,930.24	0.00	320,317,350.00	12.62%
<u>หมวดวัสดุก่อสร้าง (B5)</u>					
SCC - บมจ. ปูนซิเมนต์ไทย	259,600.00	115,203,026.40	0.00	95,273,200.00	3.75%
TOA - บมจ. ทีโอเอ เพ้นท์ (ประเทศไทย)	439,400.00	16,308,848.37	0.00	19,773,000.00	0.78%
รวม หมวดวัสดุก่อสร้าง (B5)	699,000.00	131,511,874.77	0.00	115,046,200.00	4.53%
<u>หมวดปิโตรเคมีและเคมีภัณฑ์ (C0)</u>					
IVL - บมจ. อินโดรามา เวนเจอร์ส	1,215,600.00	58,377,182.36	0.00	34,036,800.00	1.34%
PTTGC - บมจ. พีทีที โกลบอล เคมิคอล	976,200.00	70,156,816.08	0.00	49,786,200.00	1.96%
รวม หมวดปิโตรเคมีและเคมีภัณฑ์ (C0)	2,191,800.00	128,533,998.44	0.00	83,823,000.00	3.30%
<u>หมวดพาณิชย์ (C5)</u>					
BJC - บมจ. เบอร์ลี่ ยุคเกอร์	867,400.00	45,800,148.38	0.00	42,285,750.00	1.67%
CPALL - บมจ. ซีพี ออลล์	1,944,700.00	152,372,872.93	0.00	151,686,600.00	5.97%
GLOBAL - บมจ. สยามโกลบอลเฮ้าส์	909,811.00	14,940,712.06	0.00	13,829,127.20	0.54%
HMPRO - บมจ. โฮม โปรดักส์ เซ็นเตอร์	2,847,200.00	43,647,889.82	0.00	48,971,840.00	1.93%
ROBINS - บมจ. โรบินสัน	240,500.00	15,219,619.94	0.00	15,692,625.00	0.62%
รวม หมวดพาณิชย์ (C5)	6,809,611.00	271,981,243.13	0.00	272,465,942.20	10.73%
<u>หมวดเทคโนโลยีสารสนเทศและการสื่อสาร (D0)</u>					
ADVANC - บมจ. แอดวานซ์ อินโฟร์ เซอร์วิส	643,300.00	127,621,360.46	0.00	147,315,700.00	5.80%
DTAC - บมจ. โทเทิล แอ็คเซ็ส คอมมูนิเคชั่น	512,700.00	25,476,327.45	0.00	31,787,400.00	1.25%
INTUCH - บมจ. อินทัช โฮลดิ้งส์	694,200.00	39,802,494.89	0.00	45,817,200.00	1.80%
TRUE - บมจ.ทรู คอร์ปอเรชั่น	7,224,200.00	42,752,370.28	0.00	36,121,000.00	1.42%
รวม หมวดเทคโนโลยีสารสนเทศและการสื่อสาร (D0)	9,074,400.00	235,652,553.08	0.00	261,041,300.00	10.28%

กองทุนเปิดกรุงไทย SET50

งบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน (ต่อ)

ณ วันที่ 31 ตุลาคม 2562

จัดการโดย บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงไทย จำกัด (มหาชน)

	มูลค่าที่ตราไว้/ จำนวนหน่วย	ราคาทุน	ดอกเบี้ย / เงินปันผล ค้างรับ	มูลค่ายุติธรรม	อัตราส่วน ของมูลค่า ยุติธรรม
หมวดหุ้นส่วนอิเล็กทรอนิกส์ (E0)					
DELTA - บมจ. เดลต้า อีเลคโทรนิคส์ (ประเทศไทย)	270,200.00	16,259,938.17	0.00	11,888,800.00	0.47%
รวม หมวดหุ้นส่วนอิเล็กทรอนิกส์ (E0)	270,200.00	16,259,938.17	0.00	11,888,800.00	0.47%
หมวดพลังงานและสาธารณูปโภค (E5)					
BANPU - บมจ. บ้านปู	1,117,700.00	18,649,244.59	0.00	12,965,320.00	0.51%
BGRIM - บมจ. บี.กริม เพาเวอร์	564,600.00	16,812,410.90	0.00	27,100,800.00	1.07%
BPP - บมจ. บ้านปู เพาเวอร์	660,600.00	14,860,392.55	0.00	11,494,440.00	0.45%
EA - บมจ. พลังงานบริสุทธิ์	807,600.00	36,843,162.79	0.00	33,111,600.00	1.30%
EGCO - บมจ. ผลิตไฟฟ้า	113,900.00	30,514,207.80	0.00	39,523,300.00	1.56%
GPSC - บมจ. โกลบอล เพาเวอร์ ซินเนอร์ยี่	610,317.00	38,291,982.04	0.00	50,198,573.25	1.98%
GULF - บมจ. กัลฟ์ เอ็นเนอร์จี ดีเวลลอปเม้นท์	461,600.00	46,107,279.14	0.00	74,779,200.00	2.95%
IRPC - บมจ. ไออาร์พีซี	4,424,400.00	24,416,052.00	0.00	15,042,960.00	0.59%
PTT - บมจ. ปตท.	6,183,500.00	298,335,989.85	0.00	279,803,375.00	11.02%
PTTEP - บมจ. ปตท. สำรวจและผลิตปิโตรเลียม	859,100.00	108,542,865.44	0.00	103,521,550.00	4.08%
RATCH - บมจ. ผลิตไฟฟ้าราชบุรีโฮลดิ้ง	314,000.00	18,132,377.14	0.00	23,079,000.00	0.91%
TOP - บมจ. ไทยออยล์	441,800.00	33,439,640.27	0.00	30,263,300.00	1.19%
รวม หมวดพลังงานและสาธารณูปโภค (E5)	16,559,117.00	684,945,604.51	0.00	700,883,418.25	27.61%
หมวดเงินทุนและหลักทรัพย์ (F5)					
KTC - บมจ. บัตรกรุงไทย	558,200.00	20,569,967.66	0.00	23,165,300.00	0.91%
MTC - บมจ. เมืองไทย แคปปิตอล	459,100.00	21,281,781.13	0.00	28,464,200.00	1.12%
SAWAD - บมจ. ศรีสวัสดิ์ คอร์ปอเรชั่น	287,100.00	16,074,135.68	0.00	18,517,950.00	0.73%
รวม หมวดเงินทุนและหลักทรัพย์ (F5)	1,304,400.00	57,925,884.47	0.00	70,147,450.00	2.76%
หมวดอาหารและเครื่องดื่ม (G0)					
CBG - บมจ. คาราบาวกรุ๊ป	216,600.00	15,113,872.92	0.00	18,248,550.00	0.72%
CPF - บมจ. เจริญโภคภัณฑ์อาหาร	1,864,400.00	48,520,479.56	0.00	47,076,100.00	1.85%
MINT - บมจ. ไมเนอร์ อินเตอร์เนชั่นแนล	1,000,000.00	37,295,184.11	0.00	36,000,000.00	1.42%
OSP - บมจ. โอสดสกา	650,600.00	22,975,204.79	0.00	27,650,500.00	1.09%
TU - บมจ. ไทยยูเนี่ยน กรุ๊ป	1,033,300.00	18,320,212.86	0.00	15,086,180.00	0.59%
รวม หมวดอาหารและเครื่องดื่ม (G0)	4,764,900.00	142,224,954.24	0.00	144,061,330.00	5.67%
หมวดการแพทย์ (G5)					
BDMS - บมจ. กรุงเทพดุสิตเวชการ	3,440,500.00	83,565,158.94	0.00	82,572,000.00	3.25%
BH - บมจ. โรงพยาบาลบำรุงราษฎร์	157,600.00	27,503,269.06	0.00	18,990,800.00	0.75%
รวม หมวดการแพทย์ (G5)	3,598,100.00	111,068,428.00	0.00	101,562,800.00	4.00%

กองทุนเปิดกรุงไทย SET50

งบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน (ต่อ)

ณ วันที่ 31 ตุลาคม 2562

จัดการโดย บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงไทย จำกัด (มหาชน)

	มูลค่าที่ตราไว้/ จำนวนหน่วย	ราคาทุน	ดอกเบี้ย / เงินปันผล ค้างรับ	มูลค่ายุติธรรม	อัตราส่วน ของมูลค่า ยุติธรรม
หมวดพัฒนาอสังหาริมทรัพย์ (M0)					
AWC - บมจ. แอสเสท เวิร์ด คอร์ป	6,702,200.00	42,505,004.36	0.00	40,548,310.00	1.60%
CPN - บมจ. เซ็นทรัลพัฒนา	971,700.00	71,636,818.06	0.00	62,188,800.00	2.45%
LH - บมจ. แลนด์แอนด์เฮ้าส์	2,587,400.00	27,596,738.96	0.00	25,097,780.00	0.99%
WHA - บมจ. ดับบลิวเอชเอ คอร์ปอเรชั่น	3,185,000.00	13,962,573.08	0.00	14,905,800.00	0.59%
รวม หมวดพัฒนาอสังหาริมทรัพย์ (M0)	13,446,300.00	155,701,134.46	0.00	142,740,690.00	5.62%
หมวดขนส่งและโลจิสติกส์ (N5)					
AOT - บมจ. ท่าอากาศยานไทย	3,092,500.00	209,160,551.46	0.00	241,988,125.00	9.53%
BEM - บมจ. ทางด่วนและรถไฟฟ้ากรุงเทพ	3,309,300.00	30,857,948.80	0.00	35,740,440.00	1.41%
BTS - บมจ. บีทีเอส กรุ๊ป โฮลดิ้งส์	2,761,500.00	29,298,693.58	0.00	37,004,100.00	1.46%
รวม หมวดขนส่งและโลจิสติกส์ (N5)	9,163,300.00	269,317,193.84	0.00	314,732,665.00	12.40%
รวม หุ้นสามัญ	82,492,728.00	2,584,430,737.35	0.00	2,538,710,945.45	100.00%
รวม หุ้นและใบสำคัญแสดงสิทธิที่จะซื้อหุ้น	82,492,728.00	2,584,430,737.35	0.00	2,538,710,945.45	100.00%
รวมเงินลงทุน	82,492,728.00	2,584,430,737.35	0.00	2,538,710,945.45	100.00%

**ความเห็นของบริษัทจัดการกองทุนรวมเกี่ยวกับการลงทุน
เพื่อเป็นทรัพย์สินของ
กองทุนเปิดกรุงไทย SET50**

สรุปภาวะการลงทุนในตลาดหลักทรัพย์ระหว่างวันที่ 1 พฤษภาคม 2562 ถึงวันที่ 31 ตุลาคม 2562

ดัชนีตลาดหลักทรัพย์ ณ วันที่ 31 ตุลาคม 2562 ปิดที่ 1,601.49 จุด ปรับตัวลดลง 72.03 จุด หรือ 4.30% เมื่อเทียบกับวันที่ 30 มิถุนายน 2562 โดยมีจุดสูงสุดของปีในเดือนกรกฎาคม 2562 ที่ระดับ 1,748.15 จุด และมีจุดต่ำสุดของปีในเดือนตุลาคม 2562 ที่ระดับ 1,579.13 จุด มีมูลค่าการซื้อขายเฉลี่ย 58,892.72 ล้านบาท นักลงทุนต่างชาติมียอดขายสุทธิ 3,365.60 ล้านบาท นักลงทุนสถาบันมียอดขายสุทธิ 19,640.16 ล้านบาท นักลงทุนรายย่อยมียอดซื้อสุทธิ 19,381.38 ล้านบาท และบัญชีหลักทรัพย์มียอดซื้อสุทธิ 3,624.38 ล้านบาท กลุ่มอุตสาหกรรมที่มีการปรับตัวเพิ่มขึ้นมากที่สุด คือ กลุ่มกองทุนรวมอสังหาริมทรัพย์และกองทรัสต์ฯ ปรับตัวเพิ่มขึ้น 13.74% กลุ่มอุตสาหกรรมที่มีการปรับตัวลดลงมากที่สุด คือ กลุ่มเหมืองแร่ปรับตัวลดลง 37.91% สำหรับการปรับตัวของดัชนี กลุ่มอุตสาหกรรมที่สำคัญ ได้แก่ กลุ่มเทคโนโลยีฯ เพิ่มขึ้น 12.35% กลุ่มขนส่งและโลจิสติกส์เพิ่มขึ้น 8.08% กลุ่มพาณิชย์เพิ่มขึ้น 3.03% และกลุ่มพลังงานฯ ลดลง 1.60%

ปัจจัยที่มีผลต่อตลาดหลักทรัพย์ระหว่างวันที่ 1 พฤษภาคม 2562 ถึงวันที่ 31 ตุลาคม 2562 ได้แก่

1. ความกังวลเกี่ยวกับปัญหาทางการค้าระหว่างสหรัฐฯ และจีน ที่กลับมาทวีความรุนแรง ในเดือนสิงหาคม 2562 เมื่อ ประธานาธิบดีสหรัฐฯ นายโดนัลด์ ทรัมป์ จะเรียกเก็บภาษีสินค้านำเข้าจากจีนเพิ่มขึ้น ขณะที่จีนปล่อยให้หยวนอ่อนค่าลงสู่ระดับต่ำสุดในรอบ 11 ปี และประกาศระงับการนำเข้าสินค้าเกษตรจากสหรัฐฯ เพื่อตอบโต้รัฐบาลสหรัฐฯ ที่ขู่เรียกเก็บภาษีสินค้านำเข้าจากจีน
2. ความกังวลต่อภาวะเศรษฐกิจถดถอยมีเพิ่มขึ้นเมื่ออัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลสหรัฐฯ เกิดภาวะ inverted yield curve ซึ่งเป็นภาวะที่อัตราผลตอบแทนพันธบัตรระยะสั้นอยู่สูงกว่าพันธบัตรระยะยาวหลายรอบในเดือนสิงหาคม 2562 อีกทั้งการชะลอตัวทางเศรษฐกิจส่งผลให้ราคาน้ำมันปรับตัวลงแรง กระทบต่อหุ้นในกลุ่มพลังงาน และกลุ่มปิโตรเคมี
3. คณะกรรมการนโยบายการเงิน (กนง.) ประกาศปรับลดดอกเบี้ยลง 0.25% ในการประชุมวันที่ 7 สิงหาคม 2562 มาอยู่ที่ระดับ 1.5% กระทบต่อการลงทุนในหุ้นกลุ่มธนาคาร รวมทั้งในเดือนกันยายน 2562 ธนาคารแห่งประเทศไทยได้ปรับลดประมาณการ GDP ปีนี้ลงเหลือ 2.8% จากตัวเลขการส่งออกที่ลดลง
4. การออกมาตรการกระตุ้นเศรษฐกิจมูลค่า 3.16 แสนล้าน ที่สามารถกระตุ้นการลงทุนในหุ้นได้เพียงบางกลุ่มที่ได้ประโยชน์
5. MSCI ปรับสัดส่วนหุ้นที่อยู่ในดัชนี MSCI Emerging Market (MSCI EM) รอบใหม่ ซึ่งมีผลหลังราคาปิดวันที่ 27 สิงหาคม 2562 โดยปรับเพิ่มหุ้น 5% ของ China A-Share และเพิ่มหุ้นประเทศซาอุดีอาระเบียส่งผลต่อหุ้นไทยที่เงินลงทุนต่างชาติทยอยไหลออก

คาดการณ์แนวโน้มตลาดหลักทรัพย์ในปี 2562

1. เศรษฐกิจโลกยังไม่มีแนวโน้มฟื้นตัว จากสงครามการค้าระหว่างจีนและสหรัฐฯ ที่ยังไม่มีความชัดเจน และอาจลามไปสู่ประเทศอื่นๆ รวมถึงการชุมนุมประท้วงที่ฮ่องกง และความเสี่ยงเรื่อง no-deal Brexit ของอังกฤษ ซึ่งอาจนำไปสู่เศรษฐกิจโลกที่ชะลอตัวลงได้
2. คาดประเทศเศรษฐกิจหลักๆ ของโลกจะดำเนินนโยบายการเงินผ่อนคลายต่อเนื่อง ซึ่งจะส่งผลดีต่อตลาด

3. คาดมาตรการกระตุ้นเศรษฐกิจของรัฐบาลจะช่วยการบริโภค และการลงทุนของภาคเอกชนเป็นหลัก เพื่อชดเชยในภาคส่งออกที่หดตัวลง
4. งบประมาณรายจ่ายปี 2563 ที่จะเริ่มใช้ตั้งแต่เดือนตุลาคม 2562 คาดว่าล่าช้าไปเป็นช่วงต้นปี 2563 แต่คาดว่าจะยังไม่ส่งผลกระทบต่อเสถียรภาพของรัฐบาลปัจจุบัน
5. ตลาดจะได้รับแรงกดดันจากการปรับลดประมาณการผลประกอบการของบริษัทจดทะเบียนในตลาด และการปรับลดน้ำหนักในตลาดหุ้นไทยของ ดัชนี MSCI Emerging Market รอบใหม่ หลังจากการเพิ่ม China inclusion factor จาก 5% เป็น 20% ของ MSCI ในเดือนพฤศจิกายน 2562 จะทำให้เกิดแรงขายจากนักลงทุนต่างชาติเพื่อทำการปรับพอร์ตตามดัชนี

การเปลี่ยนแปลงที่เกิดขึ้นในรอบบัญชีที่ผ่านมาเมื่อเทียบกับรอบปีบัญชีก่อนหน้า

สัดส่วนการลงทุนระหว่างวันที่ 1 พฤษภาคม 2562 ถึงวันที่ 31 ตุลาคม 2562 กองทุนเปิดกรุงไทย SET50 มีการลงทุนในตราสารทุน ณ วันที่ 31 ตุลาคม 2562 เพิ่มขึ้นจาก 98.82% เป็น 99.55% ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน ทั้งนี้ เนื่องจากกองทุนเปิดกรุงไทย SET50 เป็นกองทุนที่มีวัตถุประสงค์ในการสร้างผลตอบแทนใกล้เคียงกับดัชนี SET50 ดังนั้นสัดส่วนการลงทุนในตราสารทุนทั้งหมดจะเป็นการลงทุนในดัชนี SET50

รายงานรายชื่อบุคคลที่เกี่ยวข้อง

กองทุนเปิดกรุงไทย SET50

สิ้นสุด ณ วันที่ 31 ตุลาคม 2562

ลำดับ	รายชื่อบุคคลที่เกี่ยวข้อง	ลำดับ	รายชื่อบุคคลที่เกี่ยวข้อง
1	กองทุนเพื่อการฟื้นฟูและพัฒนาระบบสถาบันการเงิน	28	นางสาวอสมมา เลิศลดาคักดิ์
2	ธนาคาร กรุงไทย จำกัด (มหาชน) *	29	นายเฉลิม โลกิจแสงทอง
3	บจก.กรุงไทย คอมพิวเตอร์ เซอร์วิสเชส	30	นางรุ่งตะวัน อิศรพันธุ์
4	บจก.กรุงไทยกฎหมาย	31	นางสาวประไพ กวีวงศ์ประเสริฐ
5	บจก.กรุงไทยธุรกิจบริการ	32	นายเทอดยศ ผงศิลป์วิวัฒน์
6	บมจ.หลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงไทย	33	นายเสรี ระเบิดทศพร
7	บจก.กรุงไทยธุรกิจสีสิ่ง	34	นายกานต์ ลขิตากุล
8	บจก.กรุงไทยแอตไวซ์เซอร์รี่	35	นายยืนยง เทพจำนงค์
9	นายวัชรดา ตันตริยานนท์	36	นายสมภพ ประกายรุ่งทอง
10	นายธวัช อยู่ยอด	37	นายอมรศักดิ์ วงษ์แข็ง
11	นายวิเชียร ศิริเวชวรารุส	38	นายสมคิด ลิขิตปริญญา
12	นายลารณ แสงสนิท	39	นางสาวสุวรรณา ตัญยาธิคม
13	นายสุรพล โอภาสเสถียร	40	นายเอกกมล ณ ระนอง
14	นายธนธัช หงษ์คู่	41	นางสุณี แนวพานิช
15	นางรุ่ง มัลลิกะมาส	42	นายณัฏฐาวิทย์ มาไพศาลสิน
16	นายจากรวัฒน์ ไวศยะ	43	นายเทิดศักดิ์ แสงวิมล
17	นางชวินดา หาญรัตนกุล	44	นายสมเกียรติ เรื่องอุดม
18	นายวิโรจน์ ตั้งเจริญ	45	นายมนตรี ทวีวิทยากุล
19	นายวีระ วุฒิกงศิริกุล	46	นายชัชพล สิวลิพันธ์
20	นางสาวดารบุษย์ ปภาพจน์	47	นายกิตติศักดิ์ บุญราศรี
21	นางสาวหัสวรา แสงรุจิ	48	นายศรฤทธิ์ เตรียมวรกุล
22	นางสาววรรรณี ตั้งศิริกุลวงศ์	49	นางพรพิมพ์ โชคเหรียญสุขชัย
23	นางแสงจันทร์ ลี	50	นายศราวุฒิ อีรนพไพบูลย์
24	นายกฤษณ์ ณ สงขลา	51	นายณัฐธนะ มัทธนา
25	นางสาวพิไลวรรณ อ่องธรรมกุล	52	นางสาวอชรา เฉลิมมุข
26	นายไพรัช มิคะเสน	53	นางจุฑามาส นุชประยูร
27	นายสมชัย อมรธรรม	54	นางสาวศิวพร วุฒานพันธ์

รายงานรายชื่อบุคคลที่เกี่ยวข้อง (ต่อ)

กองทุนเปิดกรุงไทย SET50

สิ้นสุด ณ วันที่ 31 ตุลาคม 2562

ลำดับ	รายชื่อบุคคลที่เกี่ยวข้อง	ลำดับ	รายชื่อบุคคลที่เกี่ยวข้อง
55	นางสาวอนุดตมา บำรุงศิริ	70	นายเอกรินทร์ ปล้องอ้วน
56	นางสุภากร สุจิรัตน์วิมล	71	นายชนะวิช เลิศล้ำอำไพ
57	นายกิตติเชษฐ์ สุรเชษฐพาณิชย์	72	นางบัวทิพย์ จันทรวงศ์
58	นางสาวนิสาวิมล กฤตย์พรายภา	73	นางสาวพิรภาว สุโขรัตน์รัตน์
59	นางสาววิลาสินี อัครวงกูร	74	นางสาวนฤมล ธนสุวรรณเกษม
60	นางสาวชนิดา โอภาณูรักษ์	75	นายฤทธิศักดิ์ คังคายะ
61	นางสาวมณีนพร ดวงมณี	76	นางสาวนงค์นุช ทองสิน
62	นายศักดิ์ชัย วิมลไชยจิต	77	นางสาวอริจิต มนุษย์
63	นางจันทร์เพ็ญ มลายสุวรรณ	78	นายชนัด คงพัฒนศิริ
64	นายวิชูพงศ์ เจริญเอี่ยม	79	นางสาวตรีรัตน์ ธีญวานิช
65	นางสาวอรรพรรณ เกียรติพิศาลสกุล	80	นายรัชวุฒิ ชัยทรัพย์อนันต์
66	นางสาวอภิญา เทียนชัยโรจน์	81	กองทุนสำรองเลี้ยงชีพ ไทยมั่นคง มาสเตอร์พูล ฟันด์ ซึ่งจดทะเบียนแล้ว
67	นางณัฐชนัน วังธนากร		
68	นายพิรพงศ์ กิจจาการ	82	กองทุนเปิดกรุงไทยมั่งคั่ง
69	นางสาวกุลณัฐรา อภิปรีกิตติชัย		

* เป็นบุคคลที่เกี่ยวข้องที่ทำธุรกรรมกับกองทุน

ผู้ลงทุนสามารถตรวจสอบรายละเอียดการทำธุรกรรมกับบุคคลที่เกี่ยวข้องกับกองทุนรวมได้ที่บริษัทจัดการโดยตรง

หรือที่ website ของบลจ.ที่ <http://www.ktam.co.th>หรือที่ website ของสำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ต.ที่ <http://www.sec.or.th>

รายงานการลงทุนที่ไม่เป็นไปตามนโยบายการลงทุน

กองทุนเปิดกรุงไทย SET50

รอบปีบัญชีระหว่าง วันที่ 1 พฤษภาคม 2562 ถึงวันที่ 31 ตุลาคม 2562

วันที่	รายละเอียด	การดำเนินการแก้ไข
	การลงทุนเป็นไปตามนโยบายการลงทุน	

เงื่อนไขการรับผลประโยชน์ตอบแทน

เพื่อกองทุนจากบุคคลที่เป็นผู้ให้บริการในการจัดการกองทุน (Soft/hard dollar)

(1) บริษัทจัดการจะรับผลประโยชน์ตอบแทนจากการที่กองทุนใช้บริการบุคคลอื่น โดยเฉพาะบริษัทนายหน้าได้ โดยผลประโยชน์นั้นต้องเป็นทรัพย์สินที่มีมูลค่าทางเศรษฐกิจและเป็นประโยชน์โดยตรงต่อกองทุน เช่น บทวิเคราะห์ บทวิจัยต่างๆ ที่ใช้ในการประกอบการตัดสินใจลงทุนของกองทุน อุปกรณ์อิเล็กทรอนิกส์ หรือซอฟต์แวร์ เพื่ออำนวยความสะดวกในการรับบทวิเคราะห์ บทวิจัย ดังกล่าว บริษัทไม่มีเจตนาในการใช้บริการจากบุคคลดังกล่าวที่บ่งชี้ถึงความจำเป็นเพื่อจุดประสงค์ในการรับผลประโยชน์จากผู้ให้บริการ บริษัทจัดการจะจัดสรรการรับผลประโยชน์ตอบแทนด้วยความเป็นธรรม โดยคำนึงถึงประโยชน์ของกองทุนเป็นหลัก

(2) บริษัทจัดการไม่สามารถรับ (soft/hard dollar) เพื่อประโยชน์ของบริษัทจัดการได้ เนื่องจากเป็นข้อห้ามตามกฎหมายและโดยวิชาชีพเป็นสิ่งที่ไม่พึงกระทำ เว้นแต่ เป็นการรับผลประโยชน์ที่ผู้ให้บริการจัดให้แก่บริษัทจัดการหรือพนักงานของบริษัทจัดการตามเทศกาลที่เป็นประเพณีนิยมตามแนวทางปฏิบัติที่บริษัทประกาศไว้ภายในบริษัท ซึ่งกองทุนอาจขอข้อมูลแนวทางนี้ได้ที่ website ของบริษัท

การรับผลประโยชน์ตอบแทน เนื่องจากการใช้บริการบุคคลอื่น ๆ (Soft/hard dollar) ของ

กองทุนเปิดกรุงไทย SET50

[illegible]



รายงานความเห็นของผู้ดูแลผลประโยชน์

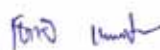
เสนอ ผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุนกองทุนเปิดกรุงไทย SET50

ตามที่ธนาคารไทยพาณิชย์ จำกัด (มหาชน) ในฐานะผู้ดูแลผลประโยชน์กองทุนเปิดกรุงไทย SET50 ซึ่งมีบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงไทย จำกัด (มหาชน) เป็นผู้จัดการกองทุนได้ปฏิบัติหน้าที่ดูแลผลประโยชน์ของกองทุนดังกล่าว สำหรับระยะเวลาตั้งแต่วันที่ 1 พฤษภาคม 2562 ถึงวันที่ 31 ตุลาคม 2562 แล้วนั้น

ธนาคารฯ เห็นว่าบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงไทย จำกัด (มหาชน) ได้ปฏิบัติหน้าที่ในการจัดการกองทุนเปิดกรุงไทย SET50 โดยถูกต้องตามที่ควรตามวัตถุประสงค์ที่ได้กำหนดไว้ในโครงการจัดการที่ได้รับอนุมัติจากสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ และภายใต้พระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535

ขอแสดงความนับถือ

ธนาคารไทยพาณิชย์ จำกัด (มหาชน)



(นางสาวเชาวนี แสงพงษ์นภา)

ผู้จัดการบริหารผู้ดูแลผลประโยชน์