

รายงานรอบระยะเวลา 6 เดือน

รอบระยะเวลาบัญชีสิ้นสุดวันที่ 31 ตุลาคม 2564

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

เรียน ท่านผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุน
กองทุนเปิดกรุงไทย SET50

บริษัทขอนำเสนอ “รายงานสรุปสถานะการลงทุน” เพื่อรายงานผลการดำเนินงานของกองทุนตั้งแต่วันที่ 1 พฤษภาคม 2564 ถึงวันที่ 31 ตุลาคม 2564 มาเพื่อโปรดทราบ

บริษัทขอขอบพระคุณท่านผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุนเป็นอย่างสูงที่ได้มอบความไว้วางใจให้บริษัทบริหารเงินลงทุนของท่าน บริษัทยังคงยืนยันในความตั้งใจและทุ่มเทความสามารถเพื่อบริหารเงินของท่านอย่างมีประสิทธิภาพที่สุดต่อไป

ขอแสดงความนับถือ
บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงไทย จำกัด (มหาชน)

ตารางเปรียบเทียบผลการดำเนินงานของ

กองทุนเปิดกรุงไทย SET50

กองทุนรวม	วันจดทะเบียน/ วันเปลี่ยนแปลง นโยบายการ ลงทุน	ราคา ต่อหน่วย (บาท)	ผลการดำเนินงาน (สิ้นสุด ณ 29 ตุลาคม 2564)							
			% 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	10.8674	9.47%	7.98%	3.05%	33.53%	-1.68%	N/A	N/A	1.90%
Benchmark	-	-	9.89%	8.12%	3.28%	34.23%	-1.28%	N/A	N/A	2.44%
ความผันผวนของ ผลการดำเนินงาน	-	-	14.02%	11.46%	12.46%	18.24%	21.97%	N/A	N/A	19.13%
ความผันผวนของ ตัวชี้วัด	-	-	14.09%	11.51%	12.51%	18.32%	22.18%	N/A	N/A	19.34%

หมายเหตุ Benchmark = ดัชนีผลตอบแทนรวม SET50 (SET50 TRI)

ความผันผวนคำนวณเป็น % ต่อปี

Tracking Different (TD) ย้อนหลัง 1 ปี ของกองทุนเท่ากับ -0.73% ต่อปี

Tracking Error (TE) ย้อนหลัง 1 ปี ของกองทุนเท่ากับ 0.09% ต่อปี

การแสดงผลการดำเนินงานของกองทุนรวมด้วยวิธีการตามปีปฏิทิน

เปรียบเทียบกับตัวชี้วัด และค่าความเสี่ยงของกองทุนรวม (SD)

ปี	% ต่อปี									
	2554	2555	2556	2557	2558	2559	2560	2561	2562	2563
KT-SET50-A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	15.03%	-5.68%	4.65%	-12.57%
Benchmark	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	15.82%	-5.23%	5.32%	-12.41%
ความผันผวนของ ผลการดำเนินงาน	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	7.37%	13.27%	10.54%	33.80%
ความผันผวนของตัวชี้วัด	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	7.56%	13.57%	10.56%	34.16%

* ผลการดำเนินงานปี 2560 เป็น % ตามช่วงเวลา

หมายเหตุ Benchmark = ดัชนีผลตอบแทนรวม SET50 (SET50 TRI)

ความผันผวนคำนวณเป็น % ต่อปี

Tracking Different (TD) ย้อนหลัง 1 ปี ของกองทุนเท่ากับ -0.73% ต่อปี

Tracking Error (TE) ย้อนหลัง 1 ปี ของกองทุนเท่ากับ 0.09% ต่อปี

- เอกสารการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวมฉบับนี้ได้จัดทำขึ้นตามมาตรฐานการวัดผลการดำเนินงานของ กองทุนรวมของ สมาคมบริษัทจัดการลงทุน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวมไม่ได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต
- การลงทุนมีความเสี่ยง ผู้ลงทุนควรศึกษาข้อมูลก่อนตัดสินใจลงทุน

แบบแสดงค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม

กองทุนเปิดกรุงไทย SET50

ของรอบปีบัญชีตั้งแต่วันที่ 1 พฤษภาคม 2564 ถึงวันที่ 31 ตุลาคม 2564

ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม * (fund's direct expenses)	จำนวนเงิน หน่วย : พันบาท	ร้อยละของ มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ
ค่าธรรมเนียมการจัดการ	4,702.48	0.22
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์	282.15	0.01
ค่าตอบแทนสัญญาอนุญาตให้ใช้สิทธิในดัชนีหลักทรัพย์	441.20	0.02
ค่าใช้จ่ายอื่น ๆ**	101.49	0.00
รวมค่าใช้จ่ายทั้งหมด***	5,527.32	0.25

*เป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่มแล้ว

**ค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายที่แต่ละรายการมีมูลค่าน้อยกว่าร้อยละ 0.01 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิ

***ไม่รวมค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์และค่าธรรมเนียมต่างๆ ที่เกิดขึ้นจากการซื้อขายหลักทรัพย์

บริษัทนายหน้าที่ได้รับค่านายหน้าสูงสุดสิบอันดับแรก

กองทุนเปิดกรุงไทย SET50

ระหว่างวันที่ 1 พฤษภาคม 2564 ถึงวันที่ 31 ตุลาคม 2564

อันดับ	ชื่อ	ค่านายหน้า (บาท)	อัตราส่วน ค่านายหน้า
1	บริษัทหลักทรัพย์ กรุงศรี จำกัด (มหาชน)	133,291.53	37.55%
2	บริษัทหลักทรัพย์ ทีเอสไอ จำกัด	92,308.74	26.01%
3	บริษัทหลักทรัพย์ บัวหลวง จำกัด (มหาชน)	83,508.63	23.53%
4	บริษัทหลักทรัพย์ เคทีบีเอสที (มหาชน)	35,535.56	10.01%
5	บริษัทหลักทรัพย์ ยูโอบี เคย์เฮียน(ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)	6,453.35	1.82%
6	บริษัทหลักทรัพย์ เคจีไอ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)	3,848.70	1.08%
รวม		354,946.51	100.00%

ข้อมูลอัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน (Portfolio Turnover Ratio : PTR)

กองทุนเปิดกรุงไทย SET50

ระหว่างวันที่ 1 พฤษภาคม 2564 ถึงวันที่ 31 ตุลาคม 2564

PTR = 12.37%

รายงานสถานะการลงทุนการกู้ยืมเงินและการก่อภาระผูกพัน

กองทุนเปิดกรุงไทย SET50

มูลค่า ณ วันที่ 29 ตุลาคม 2564

รายละเอียดการลงทุน	มูลค่าตามราคาตลาด	%NAV
หลักทรัพย์หรือทรัพย์สินในประเทศ	2,449,254,968.45	99.66
หุ้นสามัญ		
หมวดเกษตรและอุตสาหกรรมอาหาร	153,391,263.25	6.24
หมวดทรัพยากร	671,503,716.00	27.32
หมวดเทคโนโลยี	333,127,750.00	13.55
หมวดธุรกิจการเงิน	344,521,615.00	14.02
หมวดบริการ	598,914,079.20	24.37
หมวดสินค้าอุตสาหกรรม	160,445,375.00	6.53
หมวดสินค้าอุปโภคบริโภค	17,610,700.00	0.72
หมวดอสังหาริมทรัพย์และก่อสร้าง	169,740,470.00	6.91
อื่นๆ	8,581,874.94	0.34
ประเภทหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินอื่นตามที่สำนักงานกำหนด	11,665,851.87	0.47
ประเภทรายการค้างรับอื่นๆ	8,063.22	0.00
ประเภทรายการค้างจ่ายหรือหนี้สินอื่นๆ	-3,092,040.15	-0.13
มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ	2,457,836,843.39	100.00

รายงานสรุปจำนวนเงินลงทุนในตราสารแห่งนี้ เงินฝาก หรือตราสารกึ่งหนี้กึ่งทุน

กองทุนเปิดกรุงไทย SET50

มูลค่า ณ วันที่ 29 ตุลาคม 2564

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 29 ตุลาคม 2564

ประเภท	ผู้ออก	มูลค่าตาม ราคาตลาด
หุ้นสามัญ	บมจ. เจริญโภคภัณฑ์อาหาร	43,899,650.00
หุ้นสามัญ	บมจ. บีทีเอส กรุ๊ป โฮลดิ้งส์	25,390,585.00
หุ้นสามัญ	บมจ. บี.กริม เพาเวอร์	22,372,000.00
หุ้นสามัญ	บมจ. บัตรกรุงไทย	30,064,650.00
หุ้นสามัญ	บมจ. ไทยออยล์	23,002,450.00
หุ้นสามัญ	บมจ. ไทยยูเนี่ยน กรุ๊ป	20,147,600.00
หุ้นสามัญ	บมจ. โทเทิล แอ็คเซ็ส คอมมูนิเคชั่น	18,302,625.00
หุ้นสามัญ	บมจ. ทีสโก้ ไฟแนนท์เซอร์กรุ๊ป	14,953,725.00
หุ้นสามัญ	บมจ. ท่าอากาศยานไทย	186,063,150.00
หุ้นสามัญ	บมจ. ทู คอร์ปอเรชั่น	27,364,400.00
หุ้นสามัญ	บมจ. เอลต้า อิเล็คโทรนิคส์ (ประเทศไทย)	104,499,200.00
หุ้นสามัญ	ธนาคารกรุงเทพ จำกัด (มหาชน)	47,150,250.00
หุ้นสามัญ	บมจ. ซีพี ออลล์	116,102,400.00
หุ้นสามัญ	บมจ. ปตท. น้ำมันและการค้าปลีก	66,629,750.00
หุ้นสามัญ	บมจ. เคซีอี อิเล็คโทรนิคส์	20,784,300.00
หุ้นสามัญ	บมจ. คาราบาวกรุ๊ป	25,023,200.00
หุ้นสามัญ	บมจ. คอมเซเว่น	17,420,900.00
หุ้นสามัญ	บมจ. โกลบอล เพาเวอร์ ซินเนอร์ยี	44,398,926.00
หุ้นสามัญ	บมจ. กัลฟ์ เอ็นเนอร์จี ดีเวลลอปเม้นท์	102,473,090.00
หุ้นสามัญ	บมจ. กรุงเทพดุสิตเวชการ	75,411,500.00
หุ้นสามัญ	ธนาคารไทยพาณิชย์ จำกัด (มหาชน)	86,234,400.00
หุ้นสามัญ	ธนาคารทหารไทยธนชาต จำกัด (มหาชน)	22,586,940.00
หุ้นสามัญ	ธนาคารกสิกรไทย จำกัด (มหาชน)	67,369,800.00
หุ้นสามัญ	ธนาคารกรุงไทย จำกัด (มหาชน)	32,458,750.00
หุ้นสามัญ	บมจ. เซ็นทรัลพัฒนา	53,716,050.00
หุ้นสามัญ	บมจ. สยามโกลบอลเฮ้าส์	18,961,249.20
หุ้นสามัญ	บมจ. ราช กรุ๊ป	13,317,850.00
หุ้นสามัญ	บมจ. อินโดรามา เวนเจอร์ส	47,619,600.00
หุ้นสามัญ	บมจ. แลนด์แอนด์เฮ้าส์	20,394,920.00
หุ้นสามัญ	บมจ. เมืองไทย แคปปิตอล	25,930,300.00
หุ้นสามัญ	บมจ. ทางด่วนและรถไฟฟ้ากรุงเทพ	27,791,100.00

รายละเอียดตัวตราสารและอันดับความน่าเชื่อถือของตราสารทุกตัวใน port (ต่อ)

กองทุนเปิดกรุงไทย SET50

มูลค่า ณ วันที่ 29 ตุลาคม 2564

ประเภท	ผู้ออก	มูลค่าตาม ราคาตลาด
หุ้นสามัญ	บมจ. เซ็นทรัล รีเทล คอร์ปอเรชั่น	42,325,500.00
หุ้นสามัญ	บมจ. โฮม โปรดักส์ เซ็นเตอร์	38,787,820.00
หุ้นสามัญ	บมจ. ไออาร์พีซี	17,752,550.00
หุ้นสามัญ	บมจ. โอเอสสุภา	19,875,975.00
หุ้นสามัญ	บมจ. แอควานซ์ อินโฟร เซอร์วิส	113,437,800.00
หุ้นสามัญ	บมจ. เบอร์ลี่ ยุคเกอร์	27,307,125.00
หุ้นสามัญ	บมจ. อินทัช โฮลดิ้งส์	48,739,425.00
หุ้นสามัญ	บมจ. ปตท	219,142,200.00
หุ้นสามัญ	บมจ. ศรีสวัสดิ์ คอร์ปอเรชั่น	17,772,800.00
หุ้นสามัญ	บมจ. ศรีตรังแอโกรอินดัสทรี	10,084,750.00
หุ้นสามัญ	บมจ. ศรีตรังโกลฟส์ (ประเทศไทย)	17,610,700.0
หุ้นสามัญ	บมจ. โรงพยาบาลบำรุงราษฎร์	23,352,750.00
หุ้นสามัญ	บมจ. ไมเนอร์ อินเตอร์เนชั่นแนล	34,360,088.25
หุ้นสามัญ	บมจ. พีทีที โกลบอล เคมิคอล	57,133,875.00
หุ้นสามัญ	บมจ. พลังงานบริสุทธิ์	49,334,600.00
หุ้นสามัญ	บมจ. ผลิตไฟฟ้า	18,974,550.00
หุ้นสามัญ	บมจ. ปูนซิเมนต์ไทย	95,629,500.00
หุ้นสามัญ	บมจ. ปตท. สำรวจและผลิตปิโตรเลียม	94,105,750.00
หุ้นสามัญ	บมจ. เอสซีจี แพคเกจจิ้ง	55,691,900.00

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 โดยตราสารหนี้ระยะสั้นที่มีอายุต่ำกว่า 1 ปี สัญลักษณ์และนิยามอันดับเครดิตตราสารหนี้ระยะสั้นจำแนกเป็น 5 ระดับ ดังนี้

- T1** ผู้ออกตราสารหนี้มีสถานะทั้งทางด้านการตลาดและการเงินที่แข็งแกร่งในระดับดีมาก มีสภาพคล่องที่ดีมาก และนักลงทุนจะได้รับ ความคุ้มครองจากการผิดนัดชำระหนี้ที่ดีกว่าอันดับเครดิตในระดับอื่น ผู้ออกตราสารหนี้ได้รับอันดับเครดิตในระดับดังกล่าวซึ่งมี 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 ส่วนแนวโน้มอันดับเครดิตของตราสารหนี้โดยส่วนใหญ่จะเท่ากับแนวโน้มอันดับเครดิตขององค์กรผู้ออกตราสารหนี้ หรือองค์กรซึ่งรับภาระผูกพันในการชำระหนี้ของตราสารหนี้ๆ 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 ในประเทศไทยภายใต้อันดับความน่าเชื่อถือนี้จะมอบให้สำหรับอันดับความน่าเชื่อถือที่มีความเสี่ยง “น้อยที่สุด” เมื่อเปรียบเทียบกับผู้ออกตราสารอื่นในประเทศเดียวกัน และโดยปกติแล้วจะกำหนดให้กับตราสารทางการเงินที่ออกหรือค้ำประกันโดยรัฐบาล ในกรณีที่มิระดับความน่าเชื่อถือสูงเป็นพิเศษจะมีสัญลักษณ์ “+” แสดงไว้เพิ่มเติมจากอันดับความน่าเชื่อถือที่กำหนด
- F2 (tha)** แสดงถึงระดับความสามารถในการชำระหนี้ตามเงื่อนไขทางการเงินตามกำหนดเวลาในระดับที่น่าพอใจเมื่อเปรียบเทียบกับผู้ออกตราสารหนี้อื่นในประเทศเดียวกัน 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 สัญญาณการปรับอันดับความน่าเชื่อถือมักจะถูกระบุไว้สำหรับช่วงระยะเวลาสั้นๆ

กองทุนเปิดกรุงไทย SET50

งบแสดงฐานะการเงิน

ณ วันที่ 31 ตุลาคม 2564

(บาท)

สินทรัพย์

เงินลงทุนตามราคายุติธรรม (ราคาทุน 2,464,999,161.80 บาท)	2,449,254,968.45
เงินสดและเงินฝากธนาคาร	11,654,713.10
ลูกหนี้	
จากเงินปันผลและดอกเบี้ย	11,298.42
จากการขายหน่วยลงทุน	(13,056.22)
ค่าใช้จ่ายรอการตัดบัญชี	20,920.20
รวมสินทรัพย์	2,460,928,843.95

หนี้สิน

เจ้าหนี้	
จากการรับคืนหรือรับซื้อคืนหน่วยลงทุน	561,790.41
ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย	2,596,606.30
หนี้สินรวม	3,158,396.71

สินทรัพย์สุทธิ

2,457,770,447.24

สินทรัพย์สุทธิ :

ทุนที่ได้รับจากผู้ถือหน่วยลงทุน	2,261,642,537.86
กำไรสะสม	(199,259,382.45)
บัญชีปรับสมดุลย์	395,387,291.83
สินทรัพย์สุทธิ	2,457,770,447.24

จำนวนหน่วยลงทุนที่ออกจำหน่ายแล้วทั้งหมด(หน่วย)

226,164,253.6553

สินทรัพย์สุทธิต่อหน่วยลงทุน (บาท)

10.8671

กองทุนเปิดกรุงไทย SET50

งบกำไรขาดทุนเบ็ดเสร็จ

สำหรับรอบระยะเวลาบัญชีตั้งแต่วันที่ 1 พฤษภาคม 2564 ถึงวันที่ 31 ตุลาคม 2564

	(บาท)
รายได้จากการลงทุน	
รายได้เงินปันผล	27,739,360.75
รายได้ดอกเบี้ย	16,718.42
รายได้ทั้งสิ้น	27,756,079.17
ค่าใช้จ่าย	
ค่าธรรมเนียมการจัดการ	4,702,476.46
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์	282,148.55
ค่าธรรมเนียมวิชาชีพ	
ค่าธรรมเนียมการสอบบัญชี	41,204.81
ค่าใช้จ่ายในการดำเนินโครงการ	881,456.91
ค่าใช้จ่ายทั้งสิ้น	5,907,286.73
รายได้จากการลงทุนสุทธิ	21,848,792.44
รายการกำไรหรือขาดทุนสุทธิจากเงินลงทุน	
รายการกำไรหรือขาดทุนสุทธิที่เกิดขึ้นทั้งสิ้น	(18,008,445.73)
รายการกำไรหรือขาดทุนสุทธิที่ยังไม่เกิดขึ้นทั้งสิ้น (ระหว่างปี)	60,143,594.97
รวมรายการกำไรหรือขาดทุนจากการลงทุนที่เกิดขึ้นและที่ยังไม่เกิดขึ้น	42,135,149.24
การเพิ่มขึ้นในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงานก่อนหักเงินปันผลจ่าย	63,983,941.68

กองทุนเปิดกรุงไทย SET50

งบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน

ณ วันที่ 31 ตุลาคม 2564

จัดการโดย บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงไทย จำกัด (มหาชน)

	มูลค่าที่ตราไว้/ จำนวนหน่วย	ราคาทุน	ดอกเบี้ย / เงินปันผล ค้างรับ	มูลค่ายุติธรรม	อัตราส่วน ของมูลค่า ยุติธรรม
หุ้นและใบสำคัญแสดงสิทธิที่จะซื้อหุ้น					
ใบสำคัญแสดงสิทธิที่จะซื้อหุ้นสามัญ					
หมวดขนส่งและโลจิสติกส์ (N5)					
BTS-W7 - บมจ.บีทีเอส กรุ๊ป โฮลดิ้งส์	233,280.00	0.00	0.00	0.00	
BTS-W8 - บมจ.บีทีเอส กรุ๊ป โฮลดิ้งส์	466,560.00	0.00	0.00	0.00	
รวม หมวดขนส่งและโลจิสติกส์ (N5)	699,840.00	0.00	0.00	0.00	
รวม ใบสำคัญแสดงสิทธิที่จะซื้อหุ้นสามัญ	699,840.00	0.00	0.00	0.00	
หุ้นสามัญ					
หมวดธุรกิจการเกษตร (A5)					
STA - บมจ. ศรีตรังแอโกรอินดัสทรี	310,300.00	12,273,205.74	0.00	10,084,750.00	0.41%
รวม หมวดธุรกิจการเกษตร (A5)	310,300.00	12,273,205.74	0.00	10,084,750.00	0.41%
หมวดธนาคาร (B0)					
BBL - ธนาคารกรุงเทพ จำกัด (มหาชน)	384,900.00	57,468,367.52	0.00	47,150,250.00	1.93%
KBANK - ธนาคารกสิกรไทย จำกัด (มหาชน)	477,800.00	69,980,725.88	0.00	67,369,800.00	2.75%
KTB - ธนาคารกรุงไทย จำกัด (มหาชน)	2,822,500.00	40,758,055.84	0.00	32,458,750.00	1.33%
SCB - ธนาคารไทยพาณิชย์ จำกัด (มหาชน)	684,400.00	75,363,654.85	0.00	86,234,400.00	3.52%
TISCO - บมจ. ทีเอสไอไฟแนนเชียลกรุ๊ป	162,100.00	14,444,890.64	0.00	14,953,725.00	0.61%
TTB - TMBThanachart Bank Public Company Limited	19,471,500.00	27,212,714.97	0.00	22,586,940.00	0.92%
รวม หมวดธนาคาร (B0)	24,003,200.00	285,228,409.70	0.00	270,753,865.00	11.05%
หมวดวัสดุก่อสร้าง (B5)					
SCC - บมจ. ปูนซิเมนต์ไทย	242,100.00	98,228,773.36	0.00	95,629,500.00	3.90%
รวม หมวดวัสดุก่อสร้าง (B5)	242,100.00	98,228,773.36	0.00	95,629,500.00	3.90%
หมวดปิโตรเคมีและเคมีภัณฑ์ (C0)					
IVL - บมจ. อินโดรามา เวนเจอร์ส	1,133,800.00	45,533,943.35	0.00	47,619,600.00	1.94%
PTTGC - บมจ. พีทีที โกลบอล เคมิคอล	910,500.00	55,719,165.24	0.00	57,133,875.00	2.33%
รวม หมวดปิโตรเคมีและเคมีภัณฑ์ (C0)	2,044,300.00	101,253,108.59	0.00	104,753,475.00	4.28%
หมวดพาณิชย์ (C5)					
BJC - บมจ. เบอร์ลี่ ยุคเกอร์	809,100.00	34,529,509.13	0.00	27,307,125.00	1.11%
COM7 - บมจ. คอมเซเว่น	242,800.00	11,520,701.24	0.00	17,420,900.00	0.71%

กองทุนเปิดกรุงไทย SET50
 งบประมาณรายละเอียดเงินลงทุน (ต่อ)
 ณ วันที่ 31 ตุลาคม 2564
 จัดการโดย บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงไทย จำกัด (มหาชน)

	มูลค่าที่ตราไว้/ จำนวนหน่วย	ราคาทุน	ดอกเบี้ย / เงินปันผล ค้างรับ	มูลค่ายุติธรรม	อัตราส่วน ของมูลค่า ยุติธรรม
CPALL - บมจ. ซีพี ออลล์	1,814,100.00	126,165,064.58	0.00	116,102,400.00	4.74%
CRC - บมจ. เซ็นทรัล รีเทล คอร์ปอเรชั่น	1,218,000.00	42,028,204.76	0.00	42,325,500.00	1.73%
GLOBAL - บมจ. สยามโกลบอลเฮาส์	929,473.00	15,659,572.38	0.00	18,961,249.20	0.77%
HMPRO - บมจ. โฮมโปร คัสตัม เซ็นเตอร์	2,656,700.00	38,834,201.66	0.00	38,787,820.00	1.58%
รวม หมวดพาณิชย์ (C5)	7,670,173.00	268,737,253.75	0.00	260,904,994.20	10.65%
หมวดเทคโนโลยีสารสนเทศและการสื่อสาร (D0)					
ADVANC - บมจ. แอดวานซ์ อินโฟร์ เซอร์วิส	600,200.00	115,791,363.42	0.00	113,437,800.00	4.63%
DTAC - บมจ. โทเทิล แอ็คเซ็ส คอมมูนิเคชั่น	478,500.00	20,402,082.74	0.00	18,302,625.00	0.75%
INTUCH - บมจ. อินทัช โฮลดิ้งส์	647,700.00	39,503,842.34	0.00	48,739,425.00	1.99%
TRUE - บมจ. ทรู คอร์ปอเรชั่น	6,740,000.00	29,590,840.27	0.00	27,364,400.00	1.12%
รวม หมวดเทคโนโลยีสารสนเทศและการสื่อสาร (D0)	8,466,400.00	205,288,128.77	0.00	207,844,250.00	8.49%
หมวดชิ้นส่วนอิเล็กทรอนิกส์ (E0)					
DELTA - บมจ. เดลต้า อิเล็คโทรนิคส์ (ประเทศไทย)	251,200.00	125,224,074.06	0.00	104,499,200.00	4.27%
KCE - บมจ. เคซีอี อิเล็คโทรนิคส์	238,900.00	18,506,856.04	0.00	20,784,300.00	0.85%
รวม หมวดชิ้นส่วนอิเล็กทรอนิกส์ (E0)	490,100.00	143,730,930.10	0.00	125,283,500.00	5.12%
หมวดพลังงานและสาธารณูปโภค (E5)					
BGRIM - บมจ. บี.กริม เพาเวอร์	526,400.00	21,473,391.64	0.00	22,372,000.00	0.91%
EA - บมจ. พลังงานบริสุทธิ์	753,200.00	38,046,724.06	0.00	49,334,600.00	2.01%
EGCO - บมจ. ผลิตไฟฟ้า	106,300.00	25,458,605.86	0.00	18,974,550.00	0.77%
GPSC - บมจ. โกลบอล เพาเวอร์ ซินเนอร์ยี่	569,217.00	40,480,583.08	0.00	44,398,926.00	1.81%
GULF - บมจ. กัลฟ์ เอ็นเนอร์จี ดีเวลลอปเม้นท์	2,369,320.00	72,847,829.34	0.00	102,473,090.00	4.18%
IRPC - บมจ. ไออาร์พีซี	4,128,500.00	15,995,653.22	0.00	17,752,550.00	0.72%
OR - บมจ. ปตท. น้ำมันและการค้าปลีก	2,422,900.00	76,994,820.82	0.00	66,629,750.00	2.72%
PTT - บมจ. ปตท.	5,766,900.00	246,155,413.09	0.00	219,142,200.00	8.95%
PTTEP - บมจ. ปตท.สำรวจและผลิตปิโตรเลียม	800,900.00	91,990,117.86	0.00	94,105,750.00	3.84%
RATCH - บมจ. ผลิตไฟฟ้าราชบุรีโฮลดิ้ง	292,700.00	16,383,584.88	0.00	13,317,850.00	0.54%
TOP - บมจ. ไทยออยล์	412,600.00	24,893,967.07	0.00	23,002,450.00	0.94%
รวม หมวดพลังงานและสาธารณูปโภค (E5)	18,148,937.00	670,720,690.92	0.00	671,503,716.00	27.42%

กองทุนเปิดกรุงไทย SET50

งบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน (ต่อ)

ณ วันที่ 31 ตุลาคม 2564

จัดการโดย บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงไทย จำกัด (มหาชน)

	มูลค่าที่ตราไว้/ จำนวนหน่วย	ราคาทุน	ดอกเบี้ย / เงินปันผล ค้างรับ	มูลค่ายุติธรรม	อัตราส่วน ของมูลค่า ยุติธรรม
หมวดเงินทุนและหลักทรัพย์ (F5)					
KTC - บมจ. บัตรกรุงไทย	520,600.00	24,560,479.60	0.00	30,064,650.00	1.23%
MTC - บมจ. เมืองไทย แคปปิตอล	428,600.00	23,368,401.27	0.00	25,930,300.00	1.06%
SAWAD - บมจ. ศรีสวัสดิ์ คอร์ปอเรชั่น	277,700.00	17,176,531.01	0.00	17,772,800.00	0.73%
รวม หมวดเงินทุนและหลักทรัพย์ (F5)	1,226,900.00	65,105,411.88	0.00	73,767,750.00	3.01%
หมวดอาหารและเครื่องดื่ม (G0)					
CBG - บมจ. คาราบาวกรุ๊ป	201,800.00	19,420,159.99	0.00	25,023,200.00	1.02%
CPF - บมจ. เจริญโภคภัณฑ์อาหาร	1,738,600.00	46,948,130.47	0.00	43,899,650.00	1.79%
MINT - บมจ. ไมเนอร์ อินเตอร์เนชั่นแนล	1,049,163.00	31,890,428.88	0.00	34,360,088.25	1.40%
OSP - บมจ. โอสดสภา	606,900.00	22,193,746.47	0.00	19,875,975.00	0.81%
TU - บมจ. ไทยยูเนี่ยน กรุ๊ป	964,000.00	16,214,127.47	0.00	20,147,600.00	0.82%
รวม หมวดอาหารและเครื่องดื่ม (G0)	4,560,463.00	136,666,593.28	0.00	143,306,513.25	5.85%
หมวดการแพทย์ (G5)					
BDMS - บมจ. กรุงเทพดุสิตเวชการ	3,209,000.00	73,828,687.59	0.00	75,411,500.00	3.08%
BH - บมจ. โรงพยาบาลบำรุงราษฎร์	160,500.00	23,138,491.14	0.00	23,352,750.00	0.95%
รวม หมวดการแพทย์ (G5)	3,369,500.00	96,967,178.73	0.00	98,764,250.00	4.03%
หมวดบรรจุภัณฑ์ (K0)					
SCGP - บมจ. เอสซีจี แพคเกจจิ้ง	866,800.00	37,496,216.37	0.00	55,691,900.00	2.27%
รวม หมวดบรรจุภัณฑ์ (K0)	866,800.00	37,496,216.37	0.00	55,691,900.00	2.27%
หมวดเวชภัณฑ์และเครื่องสำอาง (K5)					
STGT - บมจ. ศรีตรังโกลฟ์ (ประเทศไทย)	577,400.00	23,336,950.03	0.00	17,610,700.00	0.72%
รวม หมวดเวชภัณฑ์และเครื่องสำอาง (K5)	577,400.00	23,336,950.03	0.00	17,610,700.00	0.72%
หมวดพัฒนาอสังหาริมทรัพย์ (M0)					
CPN - บมจ. เซ็นทรัลพัฒนา	906,600.00	54,799,412.61	0.00	53,716,050.00	2.19%
LH - บมจ. แลนด์แอนด์เฮาส์	2,413,600.00	21,998,442.64	0.00	20,394,920.00	0.83%
รวม หมวดพัฒนาอสังหาริมทรัพย์ (M0)	3,320,200.00	76,797,855.25	0.00	74,110,970.00	3.03%

กองทุนเปิดกรุงไทย SET50

งบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน (ต่อ)

ณ วันที่ 31 ตุลาคม 2564

จัดการโดย บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงไทย จำกัด (มหาชน)

	มูลค่าที่ตราไว้/ จำนวนหน่วย	ราคาทุน	ดอกเบี้ย / เงินปันผล ค้างรับ	มูลค่ายุติธรรม	อัตราส่วน ของมูลค่า ยุติธรรม
หมวดขนส่งและโลจิสติกส์ (N5)					
AOT - บมจ. ท่าอากาศยานไทย	2,884,700.00	187,083,864.28	0.00	186,063,150.00	7.60%
BEM - บมจ. ทางด่วนและรถไฟฟ้ากรุงเทพ	3,087,900.00	28,155,556.99	0.00	27,791,100.00	1.13%
BTS - บมจ. บีทีเอส กรุ๊ป โฮลดิ้งส์	2,658,700.00	27,929,034.06	0.00	25,390,585.00	1.04%
รวม หมวดขนส่งและโลจิสติกส์ (N5)	8,631,300.00	243,168,455.33	0.00	239,244,835.00	9.77%
รวม หุ้นสามัญ	83,928,073.00	2,464,999,161.80	0.00	2,449,254,968.45	100.00%
รวม หุ้นและใบสำคัญแสดงสิทธิที่จะซื้อหุ้น	84,627,913.00	2,464,999,161.80	0.00	2,449,254,968.45	100.00%
รวมเงินลงทุน	84,627,913.00	2,464,999,161.80	0.00	2,449,254,968.45	100.00%

ความเห็นของบริษัทจัดการกองทุนรวมเกี่ยวกับการลงทุน

เพื่อเป็นทรัพย์สินของ

กองทุนเปิดกรุงไทย SET50

สรุปภาวะการลงทุนในตลาดหลักทรัพย์ระหว่างวันที่ 1 พฤษภาคม 2564 ถึงวันที่ 31 ตุลาคม 2564

ณ วันที่ 29 ตุลาคม 2564 ปิดที่ 1,623.43 จุด ปรับตัวเพิ่มขึ้น 40.30 จุด หรือเพิ่มขึ้น 2.55% เมื่อเทียบกับวันที่ 30 เมษายน 2564 โดยมีจุดสูงสุดของปีในเดือนกันยายน 2564 ที่ระดับ 1,658.08 จุด และมีจุดต่ำสุดของปีในเดือนพฤษภาคม 2564 ที่ระดับ 1,501.02 จุด มีมูลค่าการซื้อขายเฉลี่ย 89,078.70 ล้านบาท นักลงทุนทั่วไปซื้อสุทธิ 34,694.28 ล้านบาท บัญชีบริษัทหลักทรัพย์ซื้อสุทธิ 15,103.20 ล้านบาท นักลงทุนต่างชาติขายสุทธิ 27,790.69 ล้านบาท นักลงทุนสถาบันขายสุทธิ 22,006.77 ล้านบาท กลุ่มอุตสาหกรรมที่มีการปรับตัวเพิ่มขึ้นมากที่สุด คือ กลุ่มชิ้นส่วนอิเล็กทรอนิกส์เพิ่มขึ้น 22.33% กลุ่มอุตสาหกรรมที่มีการปรับตัวลดลงมากที่สุด คือ กลุ่มกระดาษและวัสดุการพิมพ์ลดลง 25.68% สำหรับการปรับตัวของดัชนีกลุ่มอุตสาหกรรมที่สำคัญ ได้แก่ กลุ่มเทคโนโลยีฯ เพิ่มขึ้น 15.15% กลุ่มธนาคารเพิ่มขึ้น 3.99% กลุ่มขนส่งและโลจิสติกส์เพิ่มขึ้น 3.62% กลุ่มพาณิชย์เพิ่มขึ้น 3.14% กลุ่มอาหารและเครื่องดื่มเพิ่มขึ้น 1.54% และกลุ่มพลังงานฯเพิ่มขึ้น 1.10%

ปัจจัยที่มีผลต่อตลาดหลักทรัพย์ระหว่างวันที่ 1 พฤษภาคม 2564 ถึงวันที่ 31 ตุลาคม 2564 ได้แก่

1. สถานการณ์การแพร่ระบาดของ COVID-19 ที่เริ่มดีขึ้นและผ่านจุดเลวร้ายที่สุดไปแล้วในหลายประเทศ ทำให้มีการผ่อนคลายมาตรการ Lockdown เริ่มเปิดเมือง เปิดประเทศ ส่งผลกระทบทางบวกต่อกิจกรรมทางเศรษฐกิจ
2. ประสิทธิภาพของวัคซีนและการกระจายวัคซีนให้ประชากรได้ทั่วถึงมากขึ้นในแต่ละประเทศ ช่วยเพิ่มความเชื่อมั่นและหนุนให้เศรษฐกิจทั่วโลกทยอยฟื้นตัว
3. สภาพคล่องในตลาดการเงินที่มีอยู่สูง จากการอัดฉีดสภาพคล่องและนโยบายอัตราดอกเบี้ยต่ำที่ยาวนาน ส่งผลบวกต่อภาวะการเก็งกำไรและการลงทุนในสินทรัพย์เสี่ยงสูง
4. ปัจจัยที่ส่งผลต่อความไม่แน่นอนของเศรษฐกิจโลกเพิ่มเติม ได้แก่ ช่วงเวลาการลดขนาด QE และการขึ้นดอกเบี้ยของ Fed รวมถึงปัญหาน้ำท่วมของ China Evergrande Group
5. ราคาพลังงานที่ปรับตัวสูงขึ้นจากอุปทานที่ขาดแคลนทั่วโลก ทำให้เกิดความกังวลต่อการเร่งตัวของอัตราเงินเฟ้อและการชะลอตัวทางเศรษฐกิจ

คาดการณ์แนวโน้มตลาดหลักทรัพย์ในปี 2564

1. เศรษฐกิจไทยเริ่มฟื้นตัว หลังสถานการณ์การระบาดของโควิด-19 คลี่คลาย การจัดหาและการได้รับวัคซีนปรับตัวดีขึ้นต่อเนื่อง การผ่อนคลายให้ทำกิจกรรมทางเศรษฐกิจในระดับที่ใกล้เคียงระดับก่อนการระบาดของโควิด-19 รวมถึงมาตรการกระตุ้นการบริโภคและการท่องเที่ยวภายในประเทศที่คาดว่าจะทยอยประกาศออกมาในช่วงไตรมาสสุดท้ายของปี ซึ่งหุ้นที่จะได้รับประโยชน์ เช่น กลุ่มท่องเที่ยว กลุ่มขนส่ง กลุ่มค้าปลีก และกลุ่มธนาคารพาณิชย์
2. ธนาคารกลางเริ่มลดมาตรการผ่อนคลายบางส่วน เช่น การเข้าซื้อสินทรัพย์ผ่าน PEPP ของ ECB ที่จะหมดอายุลงเดือน มีนาคม 2565 และการประกาศ QE Tapering ของ Fed โดยจะปรับลดวงเงิน QE เดือนละ 15,000 ล้านดอลลาร์ จนถึงสิ้นปี 2565

3. วิฤติพลังงาน การขาดแคลนไฟฟ้าในจีนและยุโรป จากราคาวัตถุดิบที่ใช้ในการผลิตที่ปรับตัวสูงขึ้น กระทบภาคการผลิตและครัวเรือน ส่งผลให้คาดการณ์อัตราเงินเฟ้อเพิ่มขึ้นและการขยายตัวทางเศรษฐกิจลดลง ซึ่งหุ้นในกลุ่มพลังงาน กลุ่มปิโตรเคมีฯ เป็นกลุ่มหลักทรัพย์ที่มีปรับตัวขึ้นได้ดีในภาวะที่อัตราเงินเฟ้อเร่งตัวขึ้น (Inflation Hedge)
4. นโยบายคุมเข้มของจีน อย่างการเพิ่มความเข้มงวดในภาคอสังหาริมทรัพย์ บริษัทเทคโนโลยี และการไม่หนุนรัฐวิสาหกิจที่ไม่ทำกำไร ส่งผลกระทบต่อการเติบโตของเศรษฐกิจจีนในระยะยาว และการฟื้นตัวของเศรษฐกิจโลกได้
5. ผลประกอบการของบริษัทจดทะเบียนในไตรมาส 3 คาดว่าจะแย่ลงจากไตรมาสก่อน รวมถึงไตรมาสเดียวกันในปีที่ผ่านมา เนื่องจากการระบาดของไวรัส COVID-19 ที่รุนแรง และการประกาศใช้มาตรการควบคุมการระบาดสูงสุดในพื้นที่สีแดงเข้ม ยกเว้นกิจการที่ได้ประโยชน์จากการแพร่ระบาด เช่น กลุ่มโรงพยาบาล เครื่องมือแพทย์ และบรรจุภัณฑ์ ในขณะที่ไตรมาส 4 มองว่าผลประกอบการจะเริ่มกลับมาฟื้นตัวดีขึ้น หลังการประกาศผ่อนคลายมาตรการ Lockdown และแนวทางการเปิดประเทศ

การเปลี่ยนแปลงที่เกิดขึ้นในรอบบัญชีที่ผ่านมาเมื่อเทียบกับรอบปีบัญชีก่อนหน้า

สัดส่วนการลงทุนระหว่างวันที่ 1 พฤษภาคม 2564 ถึง 31 ตุลาคม 2564 กองทุนเปิดกรุงไทย SET50 มีการลงทุนในตราสารทุน ณ วันที่ 29 ตุลาคม 2564 เพิ่มขึ้นจาก 99.20% เป็น 99.65% ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน ทั้งนี้ เนื่องจากกองทุนเป็นกองทุนที่มีวัตถุประสงค์ในการสร้างผลตอบแทนใกล้เคียงกับดัชนี SET50 ดังนั้นสัดส่วนการลงทุนในตราสารทุนทั้งหมดจะเป็นการลงทุนในดัชนี SET50

รายงานรายชื่อบุคคลที่เกี่ยวข้อง

กองทุนเปิดกรุงไทย SET50

สิ้นสุด ณ วันที่ 31 ตุลาคม 2564

ลำดับ	รายชื่อบุคคลที่เกี่ยวข้อง	ลำดับ	รายชื่อบุคคลที่เกี่ยวข้อง
1	กองทุนเพื่อการฟื้นฟูและพัฒนาระบบสถาบันการเงิน	29	นางสาวอสมมา เลิศลดาคักดี
2	ธนาคาร กรุงไทย จำกัด (มหาชน) *	30	นายเทอดยศ ผจงศิลป์วิวัฒน์
3	บจก.กรุงไทย คอมพิวเตอร์ เซอร์วิสเชส	31	นายณัฐภินท์ มาไพศาลสิน
4	บจก.กรุงไทยกฎหมาย	32	นายศรชัย เตรียมวรกุล
5	บจก.กรุงไทยธุรกิจบริการ	33	นายอมรศักดิ์ วงษ์แข็ง
6	บมจ.หลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงไทย	34	นายสมภพ ประกายรุ่งทอง
7	บจก.กรุงไทยธุรกิจโลจิสติกส์	35	นายเทิดศักดิ์ แสงวิมล
8	บจก.กรุงไทยแอดไวซ์เซอร์รี่	36	นายสมเกียรติ เรืองอุดม
9	นายวัชรดา ตันตริยานนท์	37	นายยืนยง เทพจำนงค์
10	นายสุรพล โอภาสเสถียร	38	นายศราวุฒิ อีรนพไพบุลย์
11	นายธนธัช หงษ์คู่	39	นายกิตติศักดิ์ บุญราศรี
12	นายจารุวัฒน์ ไวกษะ	40	นายศักดิ์ชัย วิมลไชยจิต
13	นายล้อมชัย ชัยปริญญา	41	นายพีรพงศ์ กิจจาการ
14	นายชาญวิทย์ รุ่งเรืองลดดา	42	นางสุณี แนวพานิช
15	นายอนามัย ดำเนตร	43	นางสาววิลาสินี อัครวงกูร
16	นางชวินดา หาญรัตนกุล	44	นางสุภากร สุจิรัตนวิมล
17	นายวิโรจน์ ตั้งเจริญ	45	นางสาวศิวพร วุฒานุพันธ์
18	นางสาวดารบุษย์ ปภาพจน์	46	นายมนตรี ทวีวิทยากุล
19	นางสาวหัสวรา แสงรุจิ	47	นางพรพิมพ์ โชคเหรียญสุขชัย
20	นางสาววรรณิ ตั้งศิริกุลวงศ์	48	นางสาวกุลณัฐฐา อภิปรีกิตต์ชัย
21	นางสาวพิไลวรรณ อ่องธรรมกุล	49	นายเอกกมล ณ ระนอง
22	นางรุ่งตะวัน อิศรพันธุ์	50	นางสาวทิวารินทร์ วัชรินทรานนท์
23	นางแสงจันทร์ ลี	51	นายศรฤทธิ์ เตรียมวรกุล
24	นายเสรี ระบิลทศพร	52	นายณัฐฐะ มหัทธนา
25	นายชัยพล สีวลีพันธ์	53	นางสาวทิพวัลย์ ภัทรกิจนิธิกุล
26	ดร.สมชัย อมรธรรม	54	นางสาวอชรา เกลิมมูข
27	นายไพรัช มิคะเสน	55	นางสุมาลี มีแกม
28	นายกานต์ ลขิตากุล	56	นางสาวรณิดา สถาณพงษ์

รายงานรายชื่อบุคคลที่เกี่ยวข้อง (ต่อ)

กองทุนเปิดกรุงไทย SET50

สิ้นสุด ณ วันที่ 31 ตุลาคม 2564

ลำดับ	รายชื่อบุคคลที่เกี่ยวข้อง	ลำดับ	รายชื่อบุคคลที่เกี่ยวข้อง
57	นางจิราภา กำพูสิริ	71	นางสาวพีรภาว สุขโรจน์รัตน์
58	นายภากร ธรรมกุล	72	นายกิตติเชษฐ์ สุรเชษฐพานิช
59	นางจุฑามาส นุชประยูร	73	นางจันทร์เพ็ญ มาลัยสุวรรณ
60	นางณัฐชนัน วัจนกร	74	นางสาวนิสวาสน์ กฤตย์พรายภา
61	นายวิษณุพงศ์ เจริญเยี่ยม	75	นางสาวอรรณณ เกียรติพิศาลสกุล
62	นางสาวอริจิต มนุษย์	76	นางสาวพรพรรณ มาโนชญ์กุล
63	นางสาวอนุตตมา บำรุงศิริ	77	นางสาวมณีนพร ดวงมณี
64	นางสาวชนิดา โอภาณุรักษ์	78	นางสาวนงค์นุช ทองสิน
65	นายคนธพงษ์ คุณสัตยานนท์	79	นางสาวพิมพ์สุภาว วงศ์เมืองแก่น
66	นางสาววราภรณ์ ทองผิว	80	นางสาวภัทรมน วรสหัสวัฒน์
67	นายเอกรินทร์ ปล้องอ้วน	81	นายชนัด คงพัฒนศิริ
68	นายชนะวิทย์ เลิศล้ำอำไพ	82	นายรัชวุฒิ ชัยทรัพย์อนันต์
69	นายเดชานันต์ ธนภพ	83	นางสาวชัชชนก ศรีปราโมช
70	นางบัวทิพย์ จันทรวงศ์		

หมายเหตุ * เป็นบุคคลที่เกี่ยวข้องที่ทำธุรกรรมกับกองทุน

ผู้ลงทุนสามารถตรวจสอบรายละเอียดการทำธุรกรรมกับบุคคลที่เกี่ยวข้องกับกองทุนรวมได้ที่บริษัทจัดการโดยตรง

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

รายงานการลงทุนไม่เป็นไปตามนโยบายการลงทุนเฉลี่ยในรอบปีบัญชี

กองทุนเปิดกรุงไทย SET50

รอบปีบัญชีระหว่าง วันที่ 1 พฤษภาคม 2564 ถึงวันที่ 31 ตุลาคม 2564

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 2564 ถึงวันที่ 31 ตุลาคม 2564 แล้วนั้น

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

ขอแสดงความนับถือ

ธนาคารไทยพาณิชย์ จำกัด (มหาชน)



(นางสาวกรรณจิต อ่ำบุญธรรม)

ผู้จัดการบริการผู้ดูแลผลประโยชน์และบริหารบัญชีกองทุน