

รายงานรอบระยะเวลา 6 เดือน

รอบระยะเวลาบัญชีสิ้นสุดวันที่ 31 มีนาคม 2567

ระดับความเสี่ยงของกองทุน

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

เรียน ท่านผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุน
กองทุนเปิดกรุงไทย เอไอ เบรน

บริษัทขอจัดส่ง “รายงานสรุปสถานะการลงทุน” เพื่อรายงานผลการดำเนินงานของกองทุนเปิดกรุงไทย เอไอ เบรน ตั้งแต่วันที่ 1 ตุลาคม 2566 ถึงวันที่ 31 มีนาคม 2567 มาเพื่อโปรดทราบ

บริษัทขอขอบพระคุณท่านผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุนเป็นอย่างสูง ที่ได้มอบความไว้วางใจให้บริษัทบริหารเงินลงทุนของท่าน บริษัทยังคงยืนยันในความตั้งใจและทุ่มเทความสามารถเพื่อบริหารเงินของท่านอย่างมีประสิทธิภาพที่สุดต่อไป

ขอแสดงความนับถือ

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงไทย จำกัด (มหาชน)

ตารางเปรียบเทียบผลการดำเนินงานของ
 กองทุนเปิดกรุงไทย เอไอ เบรน (ชนิดสะสมมูลค่า)

กองทุน	วันจดทะเบียน/ วันเปลี่ยนแปลง นโยบายการ ลงทุน	ราคา ต่อหน่วย (บาท)	ผลการดำเนินงาน (สิ้นสุด ณ 29 มีนาคม 2567)							
			% ตามช่วงเวลา			% ต่อปี				
			YTD	ย้อนหลัง 3 เดือน	ย้อนหลัง 6 เดือน	ย้อนหลัง 1 ปี	ย้อนหลัง 3 ปี	ย้อนหลัง 5 ปี	ย้อนหลัง 10 ปี	ตั้งแต่วันที่ จดทะเบียน กองทุน
KT-BRAIN-A	12 ตุลาคม 2561	6.8076	-3.19%	-3.19%	-9.51%	-16.85%	-7.99%	-5.88%	N/A	-6.79%
Benchmark			-1.62%	-1.62%	-5.00%	-11.71%	-1.79%	-0.45%	N/A	-0.68%
ความผันผวนของ ผลการดำเนินงาน			9.33%	9.33%	10.28%	10.88%	11.20%	16.47%	N/A	16.17%
ความผันผวนของ ตัวชี้วัด			9.99%	9.99%	11.64%	11.28%	11.29%	16.69%	N/A	16.29%

Benchmark = ดัชนีผลตอบแทนรวมตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET TRI)

ความผันผวนคำนวณเป็น % ต่อปี

การแสดงผลการดำเนินงานของกองทุนรวมด้วยวิธีการตามปีปฏิทิน
 เปรียบเทียบกับตัวชี้วัด และค่าความเสี่ยงของกองทุนรวม (SD)

ปี	% ต่อปี									
	2557	2558	2559	2560	2561	2562	2563	2564	2565	2566
KT-BRAIN-A	N/A	N/A	N/A	N/A	-8.46%	0.24%	-14.30%	4.44%	5.20%	-18.70%
Benchmark	N/A	N/A	N/A	N/A	-6.86%	4.29%	-5.24%	17.67%	3.53%	-12.73%
ความผันผวนของ ผลการดำเนินงาน	N/A	N/A	N/A	N/A	15.62%	11.06%	28.93%	11.83%	11.20%	11.48%
ความผันผวนของ ตัวชี้วัด	N/A	N/A	N/A	N/A	13.53%	9.40%	29.92%	12.05%	11.02%	11.74%

* ผลการดำเนินงานปี 2561 เป็น % ตามช่วงเวลา

Benchmark = ดัชนีผลตอบแทนรวมตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET TRI)

ความผันผวนคำนวณเป็น % ต่อปี

- เอกสารการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวมฉบับนี้ได้จัดทำขึ้นตามมาตรฐานการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวมของสมาคมบริษัทจัดการลงทุน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวมไม่ได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต
- การลงทุนมีความเสี่ยง ผู้ลงทุนควรศึกษาข้อมูลก่อนตัดสินใจลงทุน

แบบแสดงค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม
กองทุนเปิดกรุงไทย เอไอ เบรน (ชนิดสะสมมูลค่า)
ของรอบปีบัญชีตั้งแต่วันที่ 1 ตุลาคม 2566 ถึงวันที่ 31 มีนาคม 2567

ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม* (fund's direct expenses)	จำนวนเงิน หน่วย : พันบาท	ร้อยละของ มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ
ค่าธรรมเนียมการจัดการ	857.20	1.6050
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์	14.29	0.0267
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน	114.29	0.2140
ค่าธรรมเนียมค่าใช้จ่ายการใช้งานโปรแกรมเพื่อการลงทุน	34.01	0.0640
ค่าสอบบัญชี	27.50	0.0517
ค่าโฆษณาประชาสัมพันธ์ในช่วงเสนอขายหน่วยลงทุนครั้งแรก	9.91	0.0186
ค่าใช้จ่ายอื่น ๆ**	1.95	0.0037
รวมค่าใช้จ่ายทั้งหมด***	1,059.15	1.9837

* เป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่มแล้ว

** ค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายที่แต่ละรายการมีมูลค่าน้อยกว่าร้อยละ 0.01 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิ

*** ไม่รวมค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์และค่าธรรมเนียมต่างๆ ที่เกิดขึ้นจากการซื้อขายหลักทรัพย์

**** ไม่รวมค่าภาษีเงินได้นิติบุคคลสำหรับเงินได้ตามมาตรา 40 (4) (ก) แห่งประมวลรัษฎากร

บริษัทนายหน้าที่ได้รับค่านายหน้าสูงสุดลิบอันดับแรก
กองทุนเปิดกรุงไทย เอไอ เบรน
ระหว่างวันที่ 1 ตุลาคม 2566 ถึงวันที่ 31 มีนาคม 2567

อันดับ	ชื่อ	ค่านายหน้า (บาท)	อัตราส่วน ค่านายหน้า
1	บริษัทหลักทรัพย์ หยวนต้า (ประเทศไทย) จำกัด	111,459.76	58.35%
2	บริษัทหลักทรัพย์ ทีเอสโก้ จำกัด	36,716.67	19.22%
3	บริษัทหลักทรัพย์ ดาโอ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)	24,080.08	12.61%
4	บริษัทหลักทรัพย์ กรุงไทย เอ็กซ์สปริง จำกัด	18,754.14	9.82%
	รวม	191,010.65	100.00%

ข้อมูลอัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน (Portfolio Turnover Ratio : PTR)

กองทุนเปิดกรุงไทย เอไอ เบรน
ระหว่างวันที่ 1 ตุลาคม 2566 ถึงวันที่ 31 มีนาคม 2567

PTR = 204.07%

รายงานสถานะการลงทุนการกู้ยืมเงินและการก่อภาระผูกพัน

กองทุนเปิดกรุงไทย เอไอ เบรน

มูลค่า ณ วันที่ 29 มีนาคม 2567

รายละเอียดการลงทุน	มูลค่าตามราคาตลาด	%NAV
หลักทรัพย์หรือทรัพย์สินในประเทศ	100,891,881.16	98.94
หุ้นสามัญ		
หมวดเกษตรและอุตสาหกรรมอาหาร	15,907,510.00	15.60
หมวดทรัพยากร	11,275,630.00	11.06
หมวดเทคโนโลยี	2,159,255.00	2.12
หมวดธุรกิจการเงิน	17,603,003.00	17.26
หมวดบริการ	25,703,284.00	25.21
หมวดสินค้าอุตสาหกรรม	429,765.00	0.42
หมวดอสังหาริมทรัพย์และก่อสร้าง	8,505,140.00	8.34
เงินฝากธนาคาร		
อันดับความน่าเชื่อถือ : AA	19,308,294.16	18.93
อื่นๆ	1,084,214.96	1.06
ประเภทรายการค้างรับอื่นๆ	1,306,238.44	1.28
ประเภทรายการค้างจ่ายหรือหนี้สินอื่นๆ	-222,023.48	-0.22
มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ	101,976,096.12	100.00

รายงานสรุปจำนวนเงินลงทุนในตราสารแห่งนี้ เงินฝาก หรือตราสารกึ่งหนี้กึ่งทุน

กองทุนเปิดกรุงไทย เอไอ เบรน

มูลค่า ณ วันที่ 29 มีนาคม 2567

กลุ่มของตราสาร	มูลค่าตามราคาตลาด	%NAV
(ก) ตราสารภาครัฐไทย/ตราสารภาครัฐต่างประเทศ	0.00	0.00
(ข) ตราสารที่ธนาคารที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้น ธนาคารพาณิชย์ หรือบริษัทเงินทุนเป็นผู้ออก/ผู้รับรอง/อวัล/สลักหลัง/ค้ำประกัน	19,308,294.16	18.93
(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 เอไอ เบรน
มูลค่า ณ วันที่ 29 มีนาคม 2567

ประเภท	ผู้ออก	อันดับความ น่าเชื่อถือ	มูลค่าตาม ราคาตลาด
หุ้นสามัญ	บมจ. ซีพี ออลล์		514,650.00
หุ้นสามัญ	บมจ. บีทีเอส กรุ๊ป โฮลดิ้งส์		78,535.00
หุ้นสามัญ	บมจ. บี.กริม เพาเวอร์		74,250.00
หุ้นสามัญ	บมจ. บ้านปู		60,495.00
หุ้นสามัญ	บมจ. บัตรกรุงไทย		118,950.00
หุ้นสามัญ	บมจ. ไทยออยล์		8,383,550.00
หุ้นสามัญ	บมจ. ไทยยูเนี่ยน กรุ๊ป		72,500.00
หุ้นสามัญ	บมจ. ทีเอสโก้ ไฟแนนซ์เซียลกรุ๊ป		69,650.00
หุ้นสามัญ	บมจ. ท่าอากาศยานไทย		969,400.00
หุ้นสามัญ	บมจ. ทูร์ คอร์ปอเรชั่น		275,880.00
หุ้นสามัญ	บมจ. เดลต้า อีเลคโทรนิคส์ (ประเทศไทย)		968,500.00
หุ้นสามัญ	บมจ. ดับบลิวเอชเอ คอร์ปอเรชั่น		73,780.00
หุ้นสามัญ	ธนาคารกรุงเทพ จำกัด (มหาชน)		264,100.00
หุ้นสามัญ	บมจ. เซ็นทรัลพัฒนา		296,100.00
หุ้นสามัญ	บมจ. ปตท. สำรวจและผลิตปิโตรเลียม		612,000.00
หุ้นสามัญ	บมจ. ช.การช่าง		7,598,220.00
หุ้นสามัญ	บมจ. เจริญโภคภัณฑ์อาหาร		159,100.00
หุ้นสามัญ	บมจ. เคซีอี อีเลคโทรนิคส์		51,675.00
หุ้นสามัญ	บมจ. คาราบาวกรุ๊ป		63,250.00
หุ้นสามัญ	บมจ. คอมเซเว่น		43,930.00
หุ้นสามัญ	บมจ. โกลบอล เพาเวอร์ ซินเนอร์ยี		152,975.00
หุ้นสามัญ	บมจ. การบินกรุงเทพ		7,681,960.00
หุ้นสามัญ	บมจ. กัลฟ์ เอ็นเนอร์จี ดีเวลลอปเมนท์		529,375.00
หุ้นสามัญ	บมจ. กรุงเทพดุสิตเวชการ		470,250.00
หุ้นสามัญ	ธนาคารทหารไทยธนชาติ จำกัด (มหาชน)		7,844,928.00
หุ้นสามัญ	ธนาคารกสิกรไทย จำกัด (มหาชน)		297,600.00
หุ้นสามัญ	ธนาคารกรุงไทย จำกัด (มหาชน)		248,200.00

รายละเอียดตัวตราสารและอันดับความน่าเชื่อถือของตราสารทุกตัวใน port (ต่อ)

กองทุนเปิดกรุงไทย เอไอ เบรน
มูลค่า ณ วันที่ 29 มีนาคม 2567

ประเภท	ผู้ออก	อันดับความ น่าเชื่อถือ	มูลค่าตาม ราคาตลาด
หุ้นสามัญ	บมจ. เซ็ปปะ		8,198,400.00
หุ้นสามัญ	บมจ. อินทัช โฮลดิ้งส์		227,700.00
หุ้นสามัญ	บมจ. ราช กรุ๊ป		55,500.00
หุ้นสามัญ	บมจ. เอสไอเอสบี		7,587,650.00
หุ้นสามัญ	บมจ. อินโดรามา เวนเจอร์ส		135,090.00
หุ้นสามัญ	บมจ. แลนด์แอนด์เฮ้าส์		88,800.00
หุ้นสามัญ	บมจ. เมืองไทย แคปปิตอล		8,193,150.00
หุ้นสามัญ	บมจ. ไทยประกันชีวิต		112,500.00
หุ้นสามัญ	บมจ. ทางด่วนและรถไฟฟ้ากรุงเทพ		134,460.00
หุ้นสามัญ	บมจ. เซ็นทรัล รีเทล คอร์ปอเรชั่น		218,075.00
หุ้นสามัญ	บมจ. โฮม โปรตักส์ เซ็นเตอร์		145,220.00
หุ้นสามัญ	บมจ. โอสภสภ		60,900.00
หุ้นสามัญ	บมจ. แอสเสท เวิร์ด คอร์ป		141,040.00
หุ้นสามัญ	บมจ. แอดวานซ์ อินโฟร์ เซอร์วิส		635,500.00
หุ้นสามัญ	บมจ. ปตท		1,013,200.00
หุ้นสามัญ	บมจ. เอสซีจี แพคเกจจิ้ง		122,550.00
หุ้นสามัญ	บมจ. ปตท. น้ำมันและการค้าปลีก		221,960.00
หุ้นสามัญ	บมจ. อิชิตัน กรุ๊ป		7,353,360.00
หุ้นสามัญ	บมจ. สยามโกลบอลเฮ้าส์		89,364.00
หุ้นสามัญ	บมจ. ศรีสวัสดิ์ คอร์ปอเรชั่น		54,925.00
หุ้นสามัญ	บมจ. โรงแรมเซ็นทรัลพลาซา		55,900.00
หุ้นสามัญ	บมจ. โรงพยาบาลบำรุงราษฎร์		179,200.00
หุ้นสามัญ	บมจ. ไมเนอร์ อินเตอร์เนชั่นแนล		192,850.00
หุ้นสามัญ	บมจ. แม็คกรุ๊ป		7,341,840.00
หุ้นสามัญ	บมจ. พีทีที โกลบอล เคมิคอล		172,125.00
หุ้นสามัญ	บมจ. พลังงานบริสุทธิ์		126,725.00

รายละเอียดตัวตราสารและอันดับความน่าเชื่อถือของตราสารทุกตัวใน port (ต่อ)

กองทุนเปิดกรุงไทย เอไอ เบรน
มูลค่า ณ วันที่ 29 มีนาคม 2567

ประเภท	ผู้ออก	อันดับความ น่าเชื่อถือ	มูลค่าตาม ราคาตลาด
หุ้นสามัญ	บมจ. ผลิตไฟฟ้า		45,600.00
หุ้นสามัญ	บมจ. ปูนซิเมนต์ไทย		307,200.00
หุ้นสามัญ	บมจ. เอสซีบี เอกซ์		399,000.00
เงินฝากธนาคาร	ธนาคารกรุงเทพ จำกัด (มหาชน)	AA+	19,308,294.16

สถาบันการจัดอันดับความน่าเชื่อถือ Tris Rating

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

- AAA** อันดับเครดิตองค์กรหรือตราสารหนี้ที่มีความเสี่ยงต่ำที่สุด 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 อย่างมากจึงจะมีความสามารถในการชำระหนี้ได้
- D** องค์กรหรือตราสารหนี้อยู่ในสถานะผิดนัดชำระหนี้ โดยผู้ออกตราสารหนี้ไม่สามารถชำระดอกเบี้ยและคืนเงินต้นได้ตามกำหนด อันดับเครดิตจาก AA ถึง C อาจมีเครื่องหมายบวก (+) หรือลบ (-) ต่อท้ายเพื่อจำแนกความแตกต่างของคุณภาพของอันดับเครดิตภายในระดับเดียวกัน

สำหรับการจัดอันดับเครดิตตราสารหนี้ระยะสั้น ทริสเรทติ้งจะเน้นการวิเคราะห์โอกาสที่จะเกิดการผิดนัดชำระหนี้ (Default Probability) เป็นสำคัญโดยมิได้คำนึงถึงระดับของการชดเชยความเสียหายที่จะเกิดขึ้นจากการผิดนัดชำระหนี้ (Recovery After Default) แต่อย่างไรก็ตาม โดยตราสารหนี้ระยะสั้นมีอายุต่ำกว่า 1 ปี สัญลักษณ์และนิยามอันดับเครดิตตราสารหนี้ระยะสั้นจำแนกเป็น 5 ระดับ ดังนี้

- T1** ผู้ออกตราสารหนี้มีสถานะทั้งทางด้านการตลาดและการเงินที่แข็งแกร่งในระดับดีมาก มีสภาพคล่องที่ดีมาก และนักลงทุนจะได้รับความคุ้มครองจากการผิดนัดชำระหนี้ที่ต่ำกว่าอันดับเครดิตในระดับอื่น ผู้ออกตราสารหนี้ได้รับอันดับเครดิตในระดับดังกล่าว ซึ่งมีเครื่องหมาย “+” ด้วยจะได้รับความคุ้มครองด้านการผิดนัดชำระหนี้ที่สูงยิ่งขึ้น
- T2** ผู้ออกตราสารหนี้มีสถานะทั้งทางด้านการตลาดและการเงินที่แข็งแกร่งในระดับดี และมีความสามารถในการชำระหนี้ระยะสั้นในระดับที่น่าพอใจ
- 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 ส่วนแนวโน้มอันดับเครดิตของตราสารหนี้โดยส่วนใหญ่จะเท่ากับแนวโน้มอันดับเครดิตขององค์กรผู้ออกตราสารหนี้ๆ หรือองค์กรซึ่งรับภาระผูกพันในการชำระหนี้ของตราสารหนี้ๆ ทั้งนี้ แนวโน้มอันดับเครดิตแบ่งออกเป็น 4 ระดับ ได้แก่

Positive หมายถึง อันดับเครดิตอาจปรับขึ้น

Stable หมายถึง อันดับเครดิตอาจไม่เปลี่ยนแปลง

Negative หมายถึง อันดับเครดิตอาจปรับลดลง

Developing หมายถึง อันดับเครดิตอาจปรับขึ้น ปรับลดลง หรือไม่เปลี่ยนแปลง

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

เครดิตพินิจ 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) แสดงถึงระดับความน่าเชื่อถือขั้นสูงมากเปรียบเทียบกับผู้ออกตราสารหรือตราสารอื่นในประเทศโดยระดับความน่าเชื่อถือของตราสารทางการเงินขั้นนี้ต่างจากผู้ออกตราสารหรือตราสารอื่นที่ได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือขั้นสูงสุดของประเทศไทยเพียงเล็กน้อย

BBB (tha) แสดงถึงระดับความน่าเชื่อถือขั้นปานกลางเมื่อเปรียบเทียบกับผู้ออกตราสารอื่นในประเทศไทย อย่างไรก็ตามมีความเป็นไปได้มากกว่าการเปลี่ยนแปลงของสถานการณ์หรือสภาพทางเศรษฐกิจจะมีผลกระทบต่อความสามารถในการชำระหนี้ได้ตรงตามกำหนดเวลาของตราสารทางการเงินเหล่านี้มากกว่าตราสารหนี้อื่นที่ได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือในประเภทที่สูงกว่า

- BB (tha)** แสดงถึงระดับความน่าเชื่อถือค่อนข้างต่ำเมื่อเปรียบเทียบกับผู้ออกตราสารอื่นในประเทศไทย การชำระหนี้ตามเงื่อนไขของตราสารเหล่านี้ภายในประเทศนั้นๆ มีความไม่แน่นอนในระดับหนึ่งและความสามารถในการชำระหนี้ขึ้นอยู่กับกำหนดเวลาจะมีความไม่แน่นอนมากขึ้นตามการเปลี่ยนแปลงของเศรษฐกิจในทางลบ
- B (tha)** แสดงถึงระดับความน่าเชื่อถือค่อนข้างต่ำอย่างมีนัยสำคัญเมื่อเปรียบเทียบกับผู้ออกตราสารหนี้อื่นๆ ในประเทศไทยการปฏิบัติตามเงื่อนไขของตราสารหนี้และข้อผูกพันทางการเงินยังคงเป็นไปได้ในปัจจุบัน แต่ความมั่นคงยังจำกัดอยู่ในระดับหนึ่งเท่านั้น และความสามารถในการชำระหนี้ตามกำหนดอย่างต่อเนื่องเท่านั้น และความสามารถในการชำระหนี้ตามกำหนดอย่างต่อเนื่องนั้น ไม่แน่นอนขึ้นอยู่กับสภาวะที่เอื้อต่อการดำเนินธุรกิจและสภาพทางเศรษฐกิจ
- CCC (tha), CC (tha), C (tha)** แสดงถึงระดับความน่าเชื่อถือค่อนข้างต่ำมากเมื่อเปรียบเทียบกับผู้ออกตราสารหรือตราสารอื่นในประเทศไทยความสามารถในการปฏิบัติตามข้อผูกพันทางการเงินขึ้นอยู่กับสภาวะที่เอื้อต่อการดำเนินธุรกิจและการพัฒนาทางเศรษฐกิจเพียงอย่างเดียว
- D (tha)** อันดับความน่าเชื่อถือเหล่านี้ จะถูกกำหนดให้สำหรับองค์กรหรือตราสารหนี้ซึ่งกำลังอยู่ในภาวะผิดนัดชำระหนี้ในปัจจุบัน

คำอธิบายการจัดอันดับความน่าเชื่อถือระยะสั้น สำหรับประเทศไทย

- F1 (tha)** แสดงถึงระดับความสามารถขั้นสูงสุดในการชำระหนี้ตามเงื่อนไขของตราสารตรงตามกำหนดเมื่อเปรียบเทียบกับผู้ออกตราสารหรือตราสารอื่นในประเทศไทยภายใต้อันดับความน่าเชื่อถือนี้จะมอบให้สำหรับอันดับความน่าเชื่อถือที่มีความเสี่ยง “น้อยที่สุด” เมื่อเปรียบเทียบกับผู้ออกตราสารอื่นในประเทศเดียวกัน และโดยปกติแล้วจะกำหนดให้กับตราสารทางการเงินที่ออกหรือค้ำประกันโดยรัฐบาล ในกรณีที่มิระดับความน่าเชื่อถือสูงเป็นพิเศษจะมีสัญลักษณ์ “+” แสดงไว้เพิ่มเติมจากอันดับความน่าเชื่อถือที่กำหนด
- F2 (tha)** แสดงถึงระดับความสามารถในการชำระหนี้ตามเงื่อนไขทางการเงินตามกำหนดเวลาในระดับที่น่าพอใจเมื่อเปรียบเทียบกับผู้ออกตราสารหนี้อื่นในประเทศเดียวกัน อย่างไรก็ตาม ระดับของความน่าเชื่อถือดังกล่าวจะไม่อาจเทียบเท่ากับกรณีที่ได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือที่สูงกว่า
- F3 (tha)** แสดงถึงระดับความสามารถในการชำระหนี้ตามเงื่อนไขของตราสารการเงินตามกำหนดเวลาในระดับปานกลางเมื่อเปรียบเทียบกับผู้ออกตราสารอื่นหรือตราสารอื่นในประเทศเดียวกัน อย่างไรก็ตาม ความสามารถในการชำระหนี้ดังกล่าวจะมีความไม่แน่นอนมากขึ้นไปตามการเปลี่ยนแปลงในทางลบในระยะสั้นมากกว่าตราสารที่ได้รับการจัดอันดับที่สูงกว่า
- B (tha)** แสดงถึงระดับความสามารถในการชำระหนี้ตามเงื่อนไขของตราสารการเงินตามกำหนดเวลาที่ไม่น่าพอใจเมื่อเปรียบเทียบกับผู้ออกตราสารอื่นในประเทศไทย ความสามารถในการชำระหนี้ดังกล่าวจะไม่แน่นอนมากขึ้นตามการเปลี่ยนแปลงทางเศรษฐกิจและการเงินในทางลบระยะสั้น
- C (tha)** แสดงถึงระดับความสามารถในการชำระหนี้ตามเงื่อนไขของตราสารการเงินตามกำหนดเวลาที่ไม่น่าพอใจสูง เมื่อเปรียบเทียบกับผู้ออกตราสารอื่นในประเทศไทยความสามารถในการปฏิบัติตามข้อผูกพันทางการเงินขึ้นอยู่กับสภาวะที่เอื้อต่อการดำเนินธุรกิจและสภาพการณ์ทางเศรษฐกิจเท่านั้น
- D (tha)** แสดงถึงการผิดนัดชำระหนี้ที่ได้เกิดขึ้นแล้วหรือกำลังจะเกิดขึ้น

หมายเหตุประกอบการจัดอันดับความน่าเชื่อถือในระยะยาว ในระยะสั้น สำหรับประเทศไทย

เครื่องบ่งชี้พิเศษสำหรับประเทศไทย “tha” จะถูกระบุไว้ต่อจากอันดับความน่าเชื่อถือทุกระดับ เพื่อแยกความแตกต่างออกจากการจัดอันดับความน่าเชื่อถือระดับสากล เครื่องหมาย “+” หรือ “-” อาจจะถูกระบุไว้เพิ่มเติมต่อจากอันดับความน่าเชื่อถือสำหรับประเทศหนึ่งๆ เพื่อแสดงถึงสถานะย่อยโดยเปรียบเทียบกับกันภายในอันดับความน่าเชื่อถือชั้นหลัก ทั้งนี้ จะไม่มีการระบุสัญลักษณ์ต่อท้ายดังกล่าวสำหรับอันดับความน่าเชื่อถืออันดับ “AAA (tha)” หรืออันดับที่ต่ำกว่า “CCC (tha)”

สำหรับอันดับความน่าเชื่อถือในระยะยาวและจะไม่มีการระบุสัญลักษณ์ต่อท้ายดังกล่าวสำหรับอันดับความน่าเชื่อถือในระยะสั้น นอกเหนือจาก “F1(tha)”

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

ความเห็นของบริษัทจัดการกองทุนรวมเกี่ยวกับการลงทุน
เพื่อเป็นทรัพย์สินของ
กองทุนเปิดกรุงไทย เอไอ เบรน

สรุปภาวะการณ์ลงทุนในตลาดหลักทรัพย์ระหว่างวันที่ 1 ตุลาคม 2566 ถึงวันที่ 31 มีนาคม 2567

SET Index ณ วันที่ 29 มีนาคม 2567 ปิดที่ 1,377.94 จุด ปรับตัวลดลง 93.49 จุด หรือลดลง 6.35% เมื่อเทียบกับวันที่ 29 กันยายน 2566 โดยมีจุดสูงสุดของปีในเดือนตุลาคม 2566 ที่ระดับ 1,478.01 จุด และมีจุดต่ำสุดของปีในเดือนมีนาคม 2567 ที่ระดับ 1,350.98 จุด มีมูลค่าการซื้อขายเฉลี่ย 43,378.67 ล้านบาท นักลงทุนต่างชาติขายสุทธิ 104,645.57 ล้านบาท บัญชีบริษัทหลักทรัพย์ ขายสุทธิ 10,213.92 ล้านบาท นักลงทุนทั่วไปซื้อสุทธิ 90,809.69 ล้านบาท นักลงทุนสถาบันซื้อสุทธิ 24,049.71 ล้านบาท กลุ่มอุตสาหกรรมที่มีการปรับตัวเพิ่มขึ้นมากที่สุด คือ กลุ่มธุรกิจการเกษตรเพิ่มขึ้น 17.46% กลุ่มอุตสาหกรรมที่มีการปรับตัวลดลงมากที่สุด คือ กลุ่มประกันภัยและประกันชีวิตลดลง 23.67% สำหรับการปรับตัวของดัชนีกลุ่มอุตสาหกรรมที่สำคัญ ได้แก่ กลุ่มพลังงานฯลดลง 4.32%, กลุ่มธนาคารลดลง 4.33%, กลุ่มเทคโนโลยีฯลดลง 6.26%, กลุ่มขนส่งและโลจิสติกส์ลดลง 6.45% และ กลุ่มพาณิชย์ลดลง 8.98%

ปัจจัยที่มีผลต่อตลาดหลักทรัพย์ระหว่างวันที่ 1 ตุลาคม 2566 ถึงวันที่ 31 มีนาคม 2567 ได้แก่

1. กิจกรรมทางเศรษฐกิจที่ทยอยกลับมาเป็นปกติ และเศรษฐกิจทั่วโลกทยอยฟื้นตัว
2. ปัจจัยที่ส่งผลต่อความไม่แน่นอนของเศรษฐกิจโลกเพิ่มขึ้น ได้แก่ นโยบายการเงินที่เข้มงวดทั้ง การลดการอัดฉีดเม็ดเงิน และการขึ้นดอกเบี้ยของธนาคารกลางสำคัญต่างๆทั่วโลก ซึ่งส่งผลให้เกิดปัญหาในภาคธนาคารในสหรัฐฯ และยุโรปรวมถึงปัญหาที่เกิดจากนโยบายที่เข้มงวดของจีน และปัญหาความรุนแรงและความตึงเครียดระหว่างประเทศที่ยืดเยื้อ นำมาซึ่งแนวโน้มเศรษฐกิจโลกที่ชะลอตัว
3. เงินเฟ้อที่ยังยืนในระดับสูง ทำให้เกิดความกังวลต่อทิศทางนโยบายการเงินที่ยังเข้มงวด และการชะลอตัวของเศรษฐกิจทั่วโลก

คาดการณ์แนวโน้มตลาดหลักทรัพย์ในปี 2567

1. ทิศทางเศรษฐกิจไทยอยู่ในช่วงฟื้นตัว จากภาคการท่องเที่ยวและภาคบริการที่ต่อเนื่อง และการบริโภคในประเทศที่จะได้แรงหนุนจากมาตรการกระตุ้นเศรษฐกิจต่างๆของรัฐบาล รวมถึงการลงทุนและการใช้จ่ายของภาครัฐที่จะกลับมาช่วยหนุนการเติบโตของ GDP หลังการผ่านงบประมาณรายจ่ายประจำปี ในขณะที่ภาคการส่งออกมีแนวโน้มดีขึ้นเมื่อเทียบกับปีก่อน
2. เศรษฐกิจโลกยังคงชะลอตัวลง จากภาวะเงินเฟ้อและภาวะการเงินที่ตึงตัวต่อเนื่องตามผลสะสมของการขึ้นดอกเบี้ย ภาคการผลิตและอุปสงค์สินค้าที่ยังชะงัก แรงหนุนจากภาคบริการจะแผ่วลง รวมถึงแรงส่งจากเศรษฐกิจจีนที่ต่ำกว่าคาด อย่างไรก็ตาม ตลาดแรงงานตึงตัวและค่าจ้างที่ยังเพิ่มขึ้นอย่างแข็งแกร่งในช่วงครึ่งแรกของปีจะมีส่วนช่วยให้เศรษฐกิจโลกและเศรษฐกิจสหรัฐฯยังไม่เข้าสู่ภาวะถดถอย ในขณะที่อัตราเงินเฟ้อทั่วไปของโลกมีโอกาสกลับเร่งตัว ตามราคาพลังงานที่สูงขึ้น จากอุปสงค์ที่เพิ่มขึ้นในช่วงฤดูหนาว และอุปทานที่ลดลงจากการปรับลดกำลังการผลิตของกลุ่ม OPEC+
3. ธนาคารกลางสหรัฐฯ (เฟด) มีแนวโน้มคงอัตราดอกเบี้ยนโยบาย สะท้อนวงจรดอกเบี้ยขาขึ้นของเฟดสิ้นสุดลงแล้ว โดยคาดว่าธนาคารกลางของประเทศต่างๆจะเริ่มลดดอกเบี้ยในช่วงครึ่งหลังของปี อย่างไรก็ตาม ยังคงมีความเสี่ยงที่เฟดอาจจะคงอัตราดอกเบี้ยสูงเป็นเวลายาวนาน (High For Longer)

- สถานการณ์ความเสี่ยงทางภูมิรัฐศาสตร์ (Geopolitical Risks) ที่ยืดเยื้อและเพิ่มขึ้น ซึ่งอาจส่งผลกระทบต่อราคาสินค้าโภคภัณฑ์ที่เกี่ยวข้องได้ เช่น สงครามรัสเซีย-ยูเครน, สงครามอิสราเอล-ฮามาส, ความขัดแย้งสหรัฐฯ-จีน, และความขัดแย้งในทะเลจีนใต้

การเปลี่ยนแปลงที่เกิดขึ้นในรอบบัญชีที่ผ่านมาเมื่อเทียบกับรอบปีบัญชีก่อนหน้า

สัดส่วนการลงทุนระหว่างวันที่ 1 ตุลาคม 2566 ถึงวันที่ 31 มีนาคม 2567 กองทุนเปิดกรุงไทย เอไอ เบรน มีการลงทุนในตราสารทุน ณ วันที่ 29 มีนาคม 2567 ลดลงจาก 91.19% เป็น 80.00% ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน โดยเมื่อเทียบกับสัดส่วนการลงทุนในตราสารทุน มีสัดส่วนการลงทุนในกลุ่มหลักทรัพย์ 5 อันดับแรก ได้แก่ กลุ่มอาหารและเครื่องดื่ม 19.50%, กลุ่มพลังงานฯ 13.82%, กลุ่มธนาคาร 11.18%, กลุ่มขนส่งและโลจิสติกส์ 10.87% และ กลุ่มเงินทุนและหลักทรัพย์ 10.26%

กองทุนเปิดกรุงไทย เอไอ เบรน

งบแสดงฐานะการเงิน

ณ วันที่ 31 มีนาคม 2567

	(บาท)
สินทรัพย์	
เงินลงทุนตามราคายุติธรรม (ราคาทุน 80,922,777.47 บาท)	81,583,587.00
เงินสดและเงินฝากธนาคาร	19,275,648.26
ลูกหนี้	
จากเงินปันผลและดอกเบี้ย	1,339,518.06
รวมสินทรัพย์	<u>102,198,753.32</u>
หนี้สิน	
เจ้าหนี้	
จากการรับคืนหรือรับซื้อคืนหน่วยลงทุน	33,697.51
ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย	199,006.96
หนี้สินรวม	<u>232,704.47</u>
สินทรัพย์สุทธิ	<u>101,966,048.85</u>
สินทรัพย์สุทธิ :	
ทุนที่ได้รับจากผู้ถือหน่วยลงทุน	149,796,645.85
กำไรสะสม	(86,881,584.41)
บัญชีรับสมดุลง	39,050,987.41
สินทรัพย์สุทธิ	<u>101,966,048.85</u>
จำนวนหน่วยลงทุนที่ออกจำหน่ายแล้วทั้งหมด(หน่วย)	14,979,664.5231
สินทรัพย์สุทธิต่อหน่วยลงทุน (บาท)	6.8069

กองทุนเปิดกรุงไทย เอไอ เบรน

งบกำไรขาดทุนเบ็ดเสร็จ

สำหรับรอบระยะเวลาบัญชีตั้งแต่วันที่ 1 ตุลาคม 2566 ถึงวันที่ 31 มีนาคม 2567

	(บาท)
รายได้จากการลงทุน	
รายได้เงินปันผล	1,485,308.59
รายได้ดอกเบี้ย	61,445.35
รายได้ทั้งสิ้น	<u>1,546,753.94</u>
ค่าใช้จ่าย	
ค่าธรรมเนียมการจัดการ	857,198.99
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์	14,286.64
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน	114,293.19
ค่าธรรมเนียมวิชาชีพ	
ค่าธรรมเนียมที่ปรึกษาการลงทุน	34,013.60
ค่าธรรมเนียมการสอบบัญชี	27,500.59
ค่าใช้จ่ายในการดำเนินโครงการ	225,453.22
ค่าใช้จ่ายทั้งสิ้น	<u>1,272,746.23</u>
รายได้จากการลงทุนสุทธิ	<u><u>274,007.71</u></u>
รายการกำไรหรือขาดทุนสุทธิจากเงินลงทุน	
รายการกำไรหรือขาดทุนสุทธิที่เกิดขึ้นทั้งสิ้น - จากเงินลงทุน	(16,759,666.58)
รายการกำไรหรือขาดทุนที่ยังไม่เกิดขึ้น - จากเงินลงทุน (ระหว่างปี)	5,394,033.76
รวมรายการกำไรหรือขาดทุนจากการลงทุนที่เกิดขึ้นและที่ยังไม่เกิดขึ้น	<u><u>(11,365,632.82)</u></u>
การเพิ่มขึ้นในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงานก่อนหักเงินปันผลจ่าย	<u><u>(11,091,625.11)</u></u>

กองทุนเปิดกรุงไทย เอไอ เบรน
งบประมาณรายละเอียดเงินลงทุน
ณ วันที่ 31 มีนาคม 2567

จัดการโดย บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงไทย จำกัด (มหาชน)

	มูลค่าที่ตราไว้/ จำนวนหน่วย	ราคาทุน	ดอกเบี้ย / เงินปันผล ค้างรับ	มูลค่ายุติธรรม	อัตราส่วน ของมูลค่า ยุติธรรม
หุ้นและใบสำคัญแสดงสิทธิที่จะซื้อหุ้น					
หุ้นสามัญ					
หมวดธนาคาร (B0)					
BBL - ธนาคารกรุงเทพ จำกัด (มหาชน)	1,900.00	282,821.78	0.00	264,100.00	0.32%
KBANK - ธนาคารกสิกรไทย จำกัด (มหาชน)	2,400.00	297,287.23	0.00	297,600.00	0.36%
KTB - ธนาคารกรุงไทย จำกัด (มหาชน)	14,600.00	247,766.06	0.00	248,200.00	0.30%
SCB - บมจ. เอสซีบี เอกซ์	3,500.00	373,840.80	0.00	399,000.00	0.49%
TISCO - บมจ. ทีเอสไอไฟแนนเชียลกรุ๊ป	700.00	68,849.10	0.00	69,650.00	0.09%
TTB - ธนาคารทหารไทยธนชาติ จำกัด (มหาชน)	4,310,400.00	7,248,673.84	0.00	7,844,928.00	9.62%
รวม หมวดธนาคาร (B0)	4,333,500.00	8,519,238.81	0.00	9,123,478.00	11.18%
หมวดวัสดุก่อสร้าง (B5)					
SCC - บมจ. ปูนซิเมนต์ไทย	1,200.00	330,900.00	0.00	307,200.00	0.38%
รวม หมวดวัสดุก่อสร้าง (B5)	1,200.00	330,900.00	0.00	307,200.00	0.38%
หมวดปิโตรเคมีและเคมีภัณฑ์ (C0)					
IVL - บมจ. อินโดรามา เวนเจอร์ส	5,700.00	135,779.98	0.00	135,090.00	0.17%
PTTGC - บมจ. พีทีที โกลบอล เคมิคอล	4,500.00	154,077.47	10,575.00	172,125.00	0.21%
รวม หมวดปิโตรเคมีและเคมีภัณฑ์ (C0)	10,200.00	289,857.45	10,575.00	307,215.00	0.38%
หมวดบริการรับเหมาก่อสร้าง (C2)					
CK - บมจ. ช.การช่าง	331,800.00	7,764,120.00	49,770.00	7,598,220.00	9.31%
รวม หมวดบริการรับเหมาก่อสร้าง (C2)	331,800.00	7,764,120.00	49,770.00	7,598,220.00	9.31%
หมวดพาณิชย์ (C5)					
COM7 - บมจ. คอมเซเว่น	2,300.00	52,531.09	1,610.00	43,930.00	0.05%
CPALL - บมจ. ซีพี ออลล์	9,400.00	522,174.65	0.00	514,650.00	0.63%
CRC - บมจ. เซ็นทรัล รีเทล คอร์ปอเรชั่น	6,100.00	211,178.33	0.00	218,075.00	0.27%
GLOBAL - บมจ. สยามโกลบอลเฮ้าส์	5,416.00	80,280.81	2,686.44	89,364.00	0.11%
HMPRO - บมจ. โฮมโปรดักส์ เซ็นเตอร์	13,700.00	157,246.47	0.00	145,220.00	0.18%
MC - บมจ. แม็คกรุ๊ป	556,200.00	8,118,462.06	0.00	7,341,840.00	9.00%
รวม หมวดพาณิชย์ (C5)	593,116.00	9,141,873.41	4,296.44	8,353,079.00	10.24%
หมวดเทคโนโลยีสารสนเทศและการสื่อสาร (D0)					
ADVANC - บมจ. แอดวานซ์ อินโฟร์ เซอร์วิส	3,100.00	673,630.57	42,412.00	635,500.00	0.78%
INTUCH - บมจ. อินทัช โฮลดิ้งส์	3,300.00	239,309.86	17,340.00	227,700.00	0.28%
TRUE - บมจ. ทรู คอร์ปอเรชั่น	36,300.00	218,042.28	0.00	275,880.00	0.34%
รวม หมวดเทคโนโลยีสารสนเทศและการสื่อสาร (D0)	42,700.00	1,130,982.71	59,752.00	1,139,080.00	1.40%
หมวดชิ้นส่วนอิเล็กทรอนิกส์ (E0)					

กองทุนเปิดกรุงไทย เอไอ เบรน
งบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน (ต่อ)

ณ วันที่ 31 มีนาคม 2567

จัดการโดย บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงไทย จำกัด (มหาชน)

	มูลค่าที่ตราไว้/ จำนวนหน่วย	ราคาทุน	ดอกเบี้ย / เงินปันผล ค้างรับ	มูลค่ายุติธรรม	อัตราส่วน ของมูลค่า ยุติธรรม
DELTA - บมจ. เดลต้า อีเลคโทรนิคส์ (ประเทศไทย)	13,000.00	1,028,105.82	5,850.00	968,500.00	1.19%
KCE - บมจ. เคซีอี อีเลคโทรนิคส์	1,300.00	70,850.00	910.00	51,675.00	0.06%
รวม หมวดขึ้นส่วนอิเล็กทรอนิกส์ (E0)	14,300.00	1,098,955.82	6,760.00	1,020,175.00	1.25%
หมวดพลังงานและสาธารณูปโภค (E5)					
BANPU - บมจ. บ้านปู	10,900.00	72,783.45	0.00	60,495.00	0.07%
BGRIM - บมจ. บี.กริม เพาเวอร์	2,700.00	71,068.41	486.00	74,250.00	0.09%
EA - บมจ. พลังงานบริสุทธิ์	3,700.00	166,390.88	1,110.00	126,725.00	0.16%
EGCO - บมจ. ผลิตไฟฟ้า	400.00	51,616.00	1,300.00	45,600.00	0.06%
GPSC - บมจ. โกลบอล เพาเวอร์ ซินเนอร์ยี	2,900.00	135,003.76	3,784.00	152,975.00	0.19%
GULF - บมจ. กัลฟ์ เอ็นเนอร์จี ดีเวลลอปเม้นท์	12,100.00	529,920.28	32,296.00	529,375.00	0.65%
OR - บมจ. ปตท. น้ำมันและการค้าปลีก	12,400.00	225,209.53	10,071.00	221,960.00	0.27%
PTT - บมจ. ปตท.	29,800.00	1,003,937.20	106,680.00	1,013,200.00	1.24%
PTTEP - บมจ. ปตท. สำรวจและผลิตปิโตรเลียม	4,000.00	612,576.40	64,050.00	612,000.00	0.75%
RATCH - บมจ. ผลิตไฟฟ้าราชบุรีโฮลดิ้ง	2,000.00	61,711.24	1,600.00	55,500.00	0.07%
TOP - บมจ. ไทยออยล์	140,900.00	7,699,070.70	410,025.00	8,383,550.00	10.28%
รวม หมวดพลังงานและสาธารณูปโภค (E5)	221,800.00	10,629,287.85	631,402.00	11,275,630.00	13.82%
หมวดเงินทุนและหลักทรัพย์ (F5)					
KTC - บมจ. บัตรกรุงไทย	2,600.00	114,613.08	0.00	118,950.00	0.15%
MTC - บมจ. เมืองไทย แคปปิตอล	173,400.00	7,932,120.68	0.00	8,193,150.00	10.04%
SAWAD - บมจ. ศรีสวัสดิ์ คอร์ปอเรชั่น	1,300.00	52,535.06	0.00	54,925.00	0.07%
รวม หมวดเงินทุนและหลักทรัพย์ (F5)	177,300.00	8,099,268.82	0.00	8,367,025.00	10.26%
หมวดอาหารและเครื่องดื่ม (G0)					
CBG - บมจ. คาราบาวกรุ๊ป	1,000.00	74,787.23	1,500.00	63,250.00	0.08%
CPF - บมจ. เจริญโภคภัณฑ์อาหาร	8,600.00	160,072.07	0.00	159,100.00	0.20%
ICHI - บมจ. อิชิตัน กรุ๊ป	437,700.00	6,940,521.36	218,850.00	7,353,360.00	9.01%
OSP - บมจ. โอสดิสคา	3,000.00	64,956.11	0.00	60,900.00	0.07%
SAPPE - บมจ. เซ็ปปี้	89,600.00	7,917,817.60	0.00	8,198,400.00	10.05%
TU - บมจ. ไทยยูเนียน กรุ๊ป	5,000.00	73,481.57	3,432.00	72,500.00	0.09%
รวม หมวดอาหารและเครื่องดื่ม (G0)	544,900.00	15,231,635.94	223,782.00	15,907,510.00	19.50%
หมวดการแพทย์ (G5)					
BDMS - บมจ. กรุงเทพดุสิตเวชการ	16,500.00	455,672.77	5,775.00	470,250.00	0.58%
BH - บมจ. โรงพยาบาลบำรุงราษฎร์	800.00	192,282.10	2,520.00	179,200.00	0.22%
รวม หมวดการแพทย์ (G5)	17,300.00	647,954.87	8,295.00	649,450.00	0.80%

กองทุนเปิดกรุงไทย เอไอ เบรน
งบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน (ต่อ)
ณ วันที่ 31 มีนาคม 2567

จัดการโดย บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงไทย จำกัด (มหาชน)

	มูลค่าที่ตราไว้/ จำนวนหน่วย	ราคาทุน	ดอกเบี้ย / เงินปันผล ค้างรับ	มูลค่ายุติธรรม	อัตราส่วน ของมูลค่า ยุติธรรม
หมวดการท่องเที่ยวและสันทนาการ (H0)					
CENTEL - บมจ. โรงแรมเซ็นทรัลพลาซา	1,300.00	57,532.13	0.00	55,900.00	0.07%
MINT - บมจ. ไมเนอร์ อินเตอร์เนชั่นแนล	5,800.00	179,298.48	0.00	192,850.00	0.24%
รวม หมวดการท่องเที่ยวและสันทนาการ (H0)	7,100.00	236,830.61	0.00	248,750.00	0.30%
หมวดประกันภัยและประกันชีวิต (I0)					
TLI - บมจ.ไทยประกันชีวิต	12,500.00	114,974.20	0.00	112,500.00	0.14%
รวม หมวดประกันภัยและประกันชีวิต (I0)	12,500.00	114,974.20	0.00	112,500.00	0.14%
หมวดบรรจุภัณฑ์ (K0)					
SCGP - บมจ. เอสซีจี แพคเกจจิ้ง	4,300.00	142,233.44	0.00	122,550.00	0.15%
รวม หมวดบรรจุภัณฑ์ (K0)	4,300.00	142,233.44	0.00	122,550.00	0.15%
หมวดบริการเฉพาะกิจ (L5)					
SISB - บมจ. เอสไอเอสบี	8,006,600.00	8,006,600.00	57,722.00	7,587,650.00	9.30%
รวม หมวดบริการเฉพาะกิจ (L5)	8,006,600.00	8,006,600.00	57,722.00	7,587,650.00	9.30%
หมวดพัฒนาอสังหาริมทรัพย์ (M0)					
AWC - บมจ. แอสเสท เวิร์ด คอร์ป	34,400.00	138,409.35	0.00	141,040.00	0.17%
CPN - บมจ. เซ็นทรัลพัฒนา	4,700.00	308,579.51	8,460.00	296,100.00	0.36%
LH - บมจ. แลนด์แอนด์เฮาส์	12,000.00	91,313.12	0.00	88,800.00	0.11%
WHA - บมจ. ดับบลิวเอชเอ คอร์ปอเรชั่น	15,500.00	79,607.05	0.00	73,780.00	0.09%
รวม หมวดพัฒนาอสังหาริมทรัพย์ (M0)	66,600.00	617,909.03	8,460.00	599,720.00	0.74%
หมวดขนส่งและโลจิสติกส์ (N5)					
AOT - บมจ. ท่าอากาศยานไทย	14,800.00	908,598.13	0.00	969,400.00	1.19%
BA - บมจ. การบินกรุงเทพ	486,200.00	7,792,959.46	243,100.00	7,681,960.00	9.42%
BEM - บมจ. ทางด่วนและรถไฟฟ้ากรุงเทพ	16,600.00	129,398.78	2,324.00	134,460.00	0.16%
BTS - บมจ. บีทีเอส กรุ๊ป โฮลดิ้งส์	13,900.00	89,198.14	0.00	78,535.00	0.10%
รวม หมวดขนส่งและโลจิสติกส์ (N5)	531,500.00	8,920,154.51	245,424.00	8,864,355.00	10.87%
รวม หุ้นสามัญ	14,916,716.00	80,922,777.47	1,306,238.44	81,583,587.00	100.00%
รวม หุ้นและใบสำคัญแสดงสิทธิที่จะซื้อหุ้น	14,916,716.00	80,922,777.47	1,306,238.44	81,583,587.00	100.00%
รวมเงินลงทุน	14,916,716.00	80,922,777.47	1,306,238.44	81,583,587.00	100.00%

รายงานข้อมูลการทำธุรกรรมกับบุคคลที่เกี่ยวข้องของ
กองทุนเปิดกรุงไทย เอไอ เบริน
รอบปีบัญชีระหว่าง วันที่ 1 ตุลาคม 2566 ถึงวันที่ 31 มีนาคม 2567

ลำดับ	รายชื่อบุคคลที่เกี่ยวข้องที่ทำธุรกรรม
1	ธนาคารกรุงไทย จำกัด (มหาชน)

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

"ผู้ลงทุนสามารถตรวจสอบดูแนวทางในการใช้สิทธิออกเสียงและการดำเนินการใช้สิทธิออกเสียงได้ที่สำนักงานของบริษัทจัดการหรือเว็บไซต์
ของบริษัทจัดการ (<http://www.ktam.co.th>)"

รายงานการลงทุนไม่เป็นไปตามนโยบายการลงทุนเฉลี่ยในรอบปีบัญชี
กองทุนเปิดกรุงไทย เอไอ เบริน
รอบปีบัญชีระหว่างวันที่ 1 ตุลาคม 2566 ถึงวันที่ 31 มีนาคม 2567

วันที่	รายละเอียด	การดำเนินการแก้ไข
	การลงทุนเป็นไปตามนโยบายการลงทุน	

เงื่อนไขการรับผลประโยชน์ตอบแทน

เพื่อกองทุนจากบุคคลที่เป็นผู้ให้บริการในการจัดการกองทุน (Soft/hard dollar)

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

(2) บริษัทจัดการไม่สามารถรับ (soft/hard dollar) เพื่อประโยชน์ของบริษัทจัดการได้ เนื่องจากเป็นข้อห้ามตามกฎหมาย และโดยวิชาชีพเป็นสิ่งที่ไม่พึงกระทำ เว้นแต่ เป็นการรับผลประโยชน์ที่ผู้ให้บริการจัดให้แก่บริษัทจัดการหรือพนักงานของบริษัทจัดการตามเทศกาลที่เป็นประเพณีนิยมตามแนวทางปฏิบัติที่บริษัทประกาศไว้ภายในบริษัท ซึ่งกองทุนอาจขอข้อมูลได้ที่ website ของบริษัท



ความเห็นของผู้ดูแลผลประโยชน์

วันที่ 22 เมษายน 2567

เรียน ผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุนกองทุนเปิดกรุงไทย เอไอ เบรน

ธนาคารกรุงเทพ จำกัด (มหาชน) ในฐานะผู้ดูแลผลประโยชน์ ได้ดูแลการจัดการกองทุนเปิดกรุงไทย เอไอ เบรน ซึ่งจัดการโดยบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงไทย จำกัด (มหาชน) สำหรับระยะเวลาตั้งแต่วันที่ 1 ตุลาคม 2566 ถึงวันที่ 31 มีนาคม 2567 แล้ว

ธนาคารฯ เห็นว่าบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงไทย จำกัด (มหาชน) ได้ปฏิบัติหน้าที่ในการจัดการกองทุนเปิดกรุงไทย เอไอ เบรน เหมาะสมตามสมควรแห่งวัตถุประสงค์ที่ได้กำหนดไว้ในโครงการ และภายใต้พระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535



(นฤทัต สิวาสวัสดิ์)

ธนาคารกรุงเทพ จำกัด (มหาชน)

ในฐานะผู้ดูแลผลประโยชน์