



กองทุนเปิด ฟิลลิป ผสมไทยเพื่อความยั่งยืนแบบพิเศษ

Phillip Mixed Thailand ESG Extra Fund

ชนิดเงินลงทุนใหม่ (P-MESGX-N)

ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมผสม / กองทุนรวมไทยเพื่อความยั่งยืนแบบพิเศษ / กองทุนรวมเพื่อความยั่งยืน (SRI Fund) / กองทุนรวมที่ลงทุนแบบไม่มีความเสี่ยงต่างประเทศ
- กลุ่ม Aggressive Allocation

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- กองทุนมีนโยบายการลงทุนในทรัพย์สินอย่างใดอย่างหนึ่งหรือหลายอย่างโดยผู้ออกที่เป็นภาครัฐหรือกิจการที่ จัดตั้งตามกฎหมายไทยดังนี้ โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน
 - กองทุนจะลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งหุ้นของบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย และ/หรือตลาดหลักทรัพย์เอ็ม เอ ไอ (“บริษัทจดทะเบียน”) ที่ได้รับการคัดเลือกจากตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย ว่ามีความโดดเด่นด้าน ความยั่งยืน ได้แก่ สิ่งแวดล้อม สังคม และธรรมาภิบาล (Environmental, Social and Governance: ESG) ภายใต้หลักการคัดเลือกหลักทรัพย์แบบ Positive Screening และ/หรือ หุ้นของบริษัทจดทะเบียนที่มีธรรมาภิบาล โดยได้รับการประเมินการกำกับดูแลกิจการของบริษัทจดทะเบียนจากสมาคมส่งเสริมกรรมการบริษัทไทยตั้งแต่ 90 คะแนนขึ้นไป และมีการเปิดเผยเป้าหมายและแผนธุรกิจที่เกี่ยวข้องกับการเพิ่มมูลค่ากิจการและแผนการยกระดับการดำเนินงานด้านความยั่งยืนตามมาตรฐานสากลหรือการลดปริมาณการปล่อยก๊าซเรือนกระจกของไทย และรายงานความคืบหน้าการปฏิบัติตามเป้าหมายหรือแผน ผ่านช่องทางของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET) ซึ่งจัดไว้สำหรับการเปิดเผยข้อมูลดังกล่าวโดยเฉพาะ รวมทั้งมีการเพิ่มประสิทธิภาพการสื่อสารกับผู้ลงทุน ตามที่ SET กำหนด โดยมีการลงทุนในหลักทรัพย์ในกลุ่มดังกล่าวโดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 65 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน
 - ตราสารหนี้กลุ่มความยั่งยืน เช่น ตราสารเพื่ออนุรักษ์สิ่งแวดล้อม (Green Bond) ตราสารเพื่อความยั่งยืน (Sustainability Bond) ตราสารส่งเสริมความยั่งยืน (Sustainability-Linked Bond)
 - พันธบัตรรัฐบาล พันธบัตรที่กระทรวงการคลังค้ำประกันด้วยเงินและดอกเบี้ย หรือหุ้นกู้ที่กระทรวงการคลังค้ำประกันด้วยเงินและดอกเบี้ยแต่ไม่รวมถึงหุ้นกู้แปลงสภาพ ซึ่งเป็นพันธบัตรหรือ หุ้นกู้เพื่ออนุรักษ์สิ่งแวดล้อม (green bond) พันธบัตรหรือหุ้นกู้เพื่อความยั่งยืน (sustainability bond) หรือพันธบัตรหรือหุ้นกู้ส่งเสริมความยั่งยืน (sustainability - linked bond)
 - โทเคนดิจิทัลเพื่อการลงทุน (Investment Token) ที่ออกตามพระราชกำหนดว่าด้วยการประกอบธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัล ที่เป็นโทเคนดิจิทัลสำหรับโครงการอนุรักษ์สิ่งแวดล้อม (Green-Project Token) และ/หรือโทเคนดิจิทัลสำหรับโครงการที่เกี่ยวข้องด้านความยั่งยืน (Sustainability-Project Token) และ/หรือโทเคนดิจิทัลเพื่อส่งเสริมความยั่งยืน (Sustainability-Linked Token) ซึ่งมีการเปิดเผยข้อมูลแบบแสดงรายการข้อมูลการเสนอขายโทเคนดิจิทัลตามที่สำนักงาน ก.ล.ด. กำหนด ทั้งนี้ จะระบุลักษณะและรายละเอียดของโทเคนดิจิทัล กลุ่มความยั่งยืนที่จะลงทุนให้เป็นไปตามประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุนและประกาศสำนักงาน ก.ล.ด.ต่อไป
- มุ่งหวังให้ผลตอบแทนสูงกว่าดัชนี (Active Management)
- ผู้ลงทุนสามารถศึกษาข้อมูลด้านความยั่งยืนแบบพิเศษเพิ่มเติมได้ที่หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (%ต่อปี)	
	N/A

ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด				
Fund	YTD	3M	6M	1Y*
P-MESGX-N	N/A	0.79	N/A	N/A
Benchmark	N/A	2.10	N/A	N/A
Peer AVG	N/A	3.43	N/A	N/A
P-MESGX-N (SD)	N/A	7.75	N/A	N/A
Benchmark (SD)	N/A	9.53	N/A	N/A
Fund	3Y*	5Y*	10Y*	Inception
P-MESGX-N	N/A	N/A	N/A	-2.09
Benchmark	N/A	N/A	N/A	5.19
Peer AVG	N/A	N/A	N/A	
P-MESGX-N (SD)	N/A	N/A	N/A	10.83
Benchmark (SD)	N/A	N/A	N/A	11.69
หมายเหตุ : * % ต่อปี				

ระดับความเสี่ยง

ต่ำ

1	2	3	4	5	6	7	8
---	---	---	---	---	---	---	---

สูง

เสี่ยงปานกลางค่อนข้างสูง

กองทุนรวมผสม ที่มี net exposure ได้ทั้งในตราสารทุนตราสารหนี้ และ/หรือทรัพย์สินทางเลือก โดยมีการลงทุนในตราสารทุนน้อยกว่าร้อยละ 80 ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน : 09 พ.ค. 2568

วันเริ่มต้น class : 09 พ.ค. 2568

นโยบายการจ่ายเงินปันผล : ไม่มีนโยบายจ่ายเงินปันผล

อายุกองทุน : ไม่กำหนด

ผู้จัดการกองทุนรวม

นายพุทธิพันธ์ วัชรินาคม ตั้งแต่ 09 พ.ค. 2568

นายสุชาติ เจริญวุฒิคุณ ตั้งแต่ 09 พ.ค. 2568

ดัชนีชี้วัด :

1. ดัชนีผลตอบแทนรวม SET ESG Total Return Index (SETESG TRI) สัดส่วน 70%

2. ดัชนี ThaiBMA Government Bond ESG Index Net Total Return สัดส่วน 20%

3. ดัชนีตราสารหนี้ภาครัฐระยะสั้น (Short-term Government Bond Index) สัดส่วน 10%

โดยมีวัตถุประสงค์เพื่อเปรียบเทียบกับผลการดำเนินงานของกองทุนรวม (Performance Objective)

คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวมมิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต
- ผู้ลงทุนควรศึกษาข้อมูลเกี่ยวกับสิทธิประโยชน์ทางภาษี ที่ระบุไว้ในคู่มือการลงทุนด้วย

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต : ไม่ได้เข้าร่วม CAC /
ไม่มีบริษัทแม่ดูแลให้ทำตามกฎหมาย
จัดอันดับกองทุน Morningstar : N/A

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือบริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่องได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

www.phillipasset.co.th

การซื้อหน่วยลงทุน
วันทำการซื้อ : 13 พ.ค. – 30 มิ.ย. 68
เวลาทำการ : 08.30 – 15.30 น.
การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ : 1,000 บาท
การซื้อครั้งถัดไปขั้นต่ำ : 1,000 บาท

หมายเหตุ
ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน : ภายใน 5 วันทำการนับถัดจากวันรับซื้อคืนโดยทั่วไปจะได้รับเงิน 3 วันทำการ นับจากวันทำการขายคืน

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	2.1400	1.6050
รวมค่าใช้จ่าย	3.9590	1.7227

หมายเหตุ
1. ค่าธรรมเนียมรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว
2. รวมค่าใช้จ่าย ประกอบด้วย ค่าธรรมเนียมการจัดการ ผู้ดูแลผลประโยชน์ นายทะเบียน และค่าใช้จ่ายอื่น โดยอัตราที่เรียกเก็บจริงของค่าใช้จ่ายอื่นเป็นข้อมูลตามรอบปีบัญชีหรือรอบ 6 เดือนล่าสุดของกองทุน บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์ หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการกองทุน

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การขาย	1.07	ยังไม่เรียกเก็บ
การรับซื้อคืน	1.07	ยังไม่เรียกเก็บ
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า	1.07	ยังไม่เรียกเก็บ
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก	300 บาท ต่อรายการ	300 บาท ต่อรายการ
การโอนหน่วย	**ไม่อนุญาตให้โอนหน่วยลงทุน**	

หมายเหตุ
1. ค่าธรรมเนียมรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว
2. บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน

ประเภททรัพย์สิน	สัดส่วน % ของพอร์ต
ตราสารทุน	63.02
ตราสารหนี้ภาครัฐ	25.61
ทรัพย์สิน/หนี้สินอื่น ๆ	11.36

การขายคืนหน่วยลงทุน

วันทำการขายคืน : ทุกวันทำการ ตั้งแต่วันที่ 13 พ.ค. 68 เป็นต้นไป
เวลาทำการ : 8.30 – 12.00 น.
การขายคืนขั้นต่ำ : ไม่กำหนด
ยอดคงเหลือขั้นต่ำ : ไม่กำหนด
ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน : T+3

ข้อมูลเชิงสถิติ

Maximum Drawdown : -11.44%
Recovering Period : 2 เดือน 19 วัน
FX Hedging : N/A
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน : 0.44 เท่า
Sharpe Ratio : N/A
Alpha : N/A
Beta : N/A
Tracking Error : N/A
อายุเฉลี่ยของตราสารหนี้ : N/A
Yield to Maturity : N/A

การจัดสรรการลงทุนในต่างประเทศ

N/A

ผู้ออกตราสาร 5 อันดับแรก

N/A

การจัดสรรการลงทุนตามอันดับความน่าเชื่อถือ (%)

N/A

การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม

กลุ่มอุตสาหกรรม	สัดส่วน % ของพอร์ต
บริการ	22.90
ทรัพยากร	14.80
ธุรกิจการเงิน	11.95
อสังหาริมทรัพย์และก่อสร้าง	6.07
เทคโนโลยี	5.40
เกษตรและอุตสาหกรรมอาหาร	1.89

ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก

ชื่อหลักทรัพย์	สัดส่วน % ของพอร์ต
พันธบัตรรัฐบาลส่งเสริมความยั่งยืน SLB406A	25.61
บริษัท กรุงเทวสุติเวชการ จำกัด (มหาชน)	6.36
บริษัท แอดวานซ์ อินโฟร์ เซอร์วิส จำกัด (มหาชน)	5.40
บริษัท ซีพี ออลล์ จำกัด (มหาชน)	4.88
บริษัท ทีทีดับบลิว จำกัด (มหาชน)	4.34

คำอธิบาย

Maximum Drawdown เปรอ์เซ็นต์ผลขาดทุนสูงสุดของกองทุนรวมในระยะเวลา 5 ปีย้อนหลัง (หรือตั้งแต่จัดตั้งกองทุนกรณีที่ยังไม่ครบ 5 ปี) โดยวัดจากระดับ NAV ต่อหน่วยที่จุดสูงสุดไปจนถึงจุดต่ำสุดในช่วงที่ NAV ต่อหน่วยปรับตัวลดลง ค่า Maximum Drawdown เป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงความเสี่ยงที่อาจจะขาดทุนจากการลงทุนในกองทุนรวม

Recovering Period ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาดังแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลานานเท่าใด

FX Hedging เปรอ์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตกองทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลาหนึ่ง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์กับผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 1 ปีหารด้วยมูลค่า NAV ของกองทุนรวมเฉลี่ยในรอบระยะเวลาเดียวกัน กองทุนรวมที่มีค่า portfolio turnover สูง บ่งชี้ถึงการซื้อขายหลักทรัพย์บ่อยครั้งของผู้จัดการกองทุนและทำให้มีต้นทุนการซื้อขายหลักทรัพย์ที่สูง จึงต้องพิจารณาเปรียบเทียบกับผลการดำเนินงานของกองทุนรวมเพื่อประเมินความคุ้มค่าของการซื้อขายหลักทรัพย์ดังกล่าว

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

Alpha ผลตอบแทนส่วนเกินของกองทุนรวมเมื่อเปรียบเทียบกับดัชนีชี้วัด (benchmark) โดยค่า Alpha ที่สูง หมายถึง กองทุนสามารถสร้างผลตอบแทนได้สูงกว่าดัชนีชี้วัด ซึ่งเป็นผลจากประสิทธิภาพของผู้จัดการกองทุนในการคัดเลือกหรือหาจังหวะเข้าลงทุนในหลักทรัพย์ได้อย่างเหมาะสม

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

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

Yield to Maturity อัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในตราสารหนี้โดยถือจนครบกำหนดอายุ ซึ่งคำนวณจากดอกเบี้ยที่จะได้รับในอนาคตตลอดอายุตราสารและเงินต้นที่จะได้รับคืน นำมาคิดลดเป็นมูลค่าปัจจุบัน โดยใช้วัดอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมตราสารหนี้ คำนวณจากค่าเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักของ Yield to Maturity ของตราสาร

หนี้แต่ละตัวที่กองทุนมีการลงทุน และเนื่องจาก Yield to Maturity มีหน่วยมาตรฐานเป็นเปอร์เซ็นต์ต่อปี จึงสามารถนำไปใช้เปรียบเทียบอัตราผลตอบแทนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีนโยบายถือครองตราสารหนี้จนครบกำหนดอายุและมีลักษณะการลงทุนที่ใกล้เคียงกันได้

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนรวม ฟิลลิป จำกัด

โทรศัพท์ : 0-2635-3033

www.phillipasset.co.th

ที่อยู่ 849 อาคารวรวิวัฒน์ ชั้น 22 ห้อง 2201

ถ.สีลม แขวงสีลม เขตบางรัก

กรุงเทพมหานคร 10500

ข้อมูลนโยบายการลงทุนของกองทุนเพิ่มเติม

1. วัตถุประสงค์การลงทุนที่เกี่ยวข้องกับความยั่งยืน

กองทุนจะลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งหุ้นของบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย และ/หรือตลาดหลักทรัพย์เอ็ม เอ ไอ (“บริษัทจดทะเบียน”) ที่ได้รับการคัดเลือกจากตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย ว่ามีความโดดเด่นด้านความยั่งยืน ได้แก่ สิ่งแวดล้อม สังคม และธรรมาภิบาล (Environmental, Social and Governance: ESG) ภายใต้หลักการคัดเลือกหลักทรัพย์แบบ Positive Screening และ/หรือ หุ้นของบริษัทจดทะเบียนที่มีธรรมาภิบาล โดยได้รับการประเมินการกำกับดูแลกิจการบริษัทจดทะเบียนจากสมาคมส่งเสริมกรรมการบริษัทไทยตั้งแต่ 90 คะแนนขึ้นไป และมีการเปิดเผยเป้าหมายและแผนธุรกิจที่เกี่ยวข้องกับการเพิ่มมูลค่ากิจการและแผนการยกระดับการดำเนินงานด้านความยั่งยืนตามมาตรฐานสากลหรือการลดปริมาณการปล่อยก๊าซเรือนกระจกของไทย และจะลงทุนในตราสารเพื่ออนุรักษ์สิ่งแวดล้อม (green bond) ตราสารเพื่อความยั่งยืน (sustainability bond) หรือตราสารส่งเสริมความยั่งยืน (sustainability - linked bond) หรือลงทุนในพันธบัตรรัฐบาล พันธบัตรที่กระทรวงการคลังค้ำประกันต้นเงินและดอกเบี้ย หรือหุ้นกู้ที่กระทรวงการคลังค้ำประกันต้นเงินและดอกเบี้ยแต่ไม่รวมถึงหุ้นกู้แปลงสภาพ ซึ่งเป็นพันธบัตรหรือ หุ้นกู้เพื่ออนุรักษ์สิ่งแวดล้อม (green bond) พันธบัตรหรือหุ้นกู้เพื่อความยั่งยืน (sustainability bond) หรือ พันธบัตรหรือหุ้นกู้ส่งเสริมความยั่งยืน (sustainability - linked bond) โดยเป็นไปตามหลักเกณฑ์ที่คณะกรรมการกำกับตลาดทุน คณะกรรมการ ก.ล.ต. หรือสำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ต. ประกาศกำหนด โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน

2. เป้าหมายด้านความยั่งยืน (ถ้ามี)

กองทุนจะเน้นลงทุนบริษัทที่มีการดำเนินงานโดดเด่นในการบริหารจัดการด้านสิ่งแวดล้อม สังคม และธรรมาภิบาล (Environmental, Social and Governance: ESG) เพื่อสร้างผลตอบแทนที่ยั่งยืนให้กับผู้ถือหน่วยลงทุน และเป็นส่วนหนึ่งในการสนับสนุนให้ประเทศไทยบรรลุเป้าหมายการพัฒนาที่ยั่งยืน (Sustainable Development Goals: SDGs) ขององค์การสหประชาชาติ

3. กรอบการลงทุน (investment universe)

กองทุนจะเน้นลงทุนในบริษัทจดทะเบียนที่มีความโดดเด่นในการบริหารจัดการด้านสิ่งแวดล้อม สังคม และธรรมาภิบาล (Environmental, Social and Governance: ESG) โดยทีมผู้จัดการกองทุนจะทำการคัดเลือกหลักทรัพย์ที่มีปัจจัยพื้นฐานที่ดีภายใต้เกณฑ์การพิจารณาของบริษัทจัดการ และมี ESG Ratings ตั้งแต่ระดับ BBB ขึ้นไป และ/หรือ หุ้นของบริษัทจดทะเบียนที่มีธรรมาภิบาล โดยได้รับการประเมินการกำกับดูแลกิจการบริษัทจดทะเบียนจากสมาคมส่งเสริมกรรมการบริษัทไทยตั้งแต่ 90 คะแนนขึ้นไป และมีการเปิดเผยเป้าหมายและแผนธุรกิจที่เกี่ยวข้องกับการเพิ่มมูลค่ากิจการและแผนการยกระดับการดำเนินงานด้านความยั่งยืนตามมาตรฐานสากลหรือการลดปริมาณการปล่อยก๊าซเรือนกระจกของไทย และจะลงทุนในตราสารเพื่ออนุรักษ์สิ่งแวดล้อม (green bond) ตราสารเพื่อความยั่งยืน (sustainability bond) หรือตราสารส่งเสริมความยั่งยืน (sustainability - linked bond) หรือลงทุนในพันธบัตรรัฐบาล พันธบัตรที่กระทรวงการคลังค้ำประกันต้นเงินและดอกเบี้ย หรือหุ้นกู้ที่กระทรวงการคลังค้ำประกันต้นเงินและดอกเบี้ยแต่ไม่รวมถึงหุ้นกู้แปลงสภาพ ซึ่งเป็นพันธบัตรหรือหุ้นกู้เพื่ออนุรักษ์สิ่งแวดล้อม (green bond) พันธบัตรหรือหุ้นกู้เพื่อความยั่งยืน (sustainability bond) หรือพันธบัตรหรือหุ้นกู้ส่งเสริมความยั่งยืน (sustainability - linked bond) โดยเป็นไปตามหลักเกณฑ์ที่คณะกรรมการกำกับตลาดทุน คณะกรรมการ ก.ล.ต. หรือสำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ต. ประกาศกำหนด โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน

4. การอ้างอิงดัชนีชี้วัดที่เกี่ยวกับความยั่งยืน (investment benchmark)

- 1) ดัชนีผลตอบแทนรวม SET ESG Total Return Index (SETESG TRI) สัดส่วน 70% ซึ่งเป็นดัชนีที่มีองค์ประกอบของบริษัทที่มีผลการประเมิน SET ESG Ratings ปีล่าสุดซึ่งจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ โดยผู้ลงทุนสามารถศึกษารายละเอียดเกี่ยวกับดัชนีชี้วัดดังกล่าวได้ที่ <https://www.set.or.th/th/market/index/setesg/profile>
- 2) ดัชนี ThaiBMA Government Bond ESG Index Net Total Return สัดส่วน 20% ซึ่งเป็นดัชนีตราสารหนี้ ESG ที่ออกโดยรัฐบาล โดยผู้ลงทุนสามารถศึกษารายละเอียดเกี่ยวกับดัชนีชี้วัดดังกล่าวได้ที่ <https://www.thaibma.or.th/EN/Market/Index/ESGIndex.aspx>
- 3) ดัชนีตราสารหนี้ภาครัฐระยะสั้น (Short-term Government Bond Index) สัดส่วน 10%

ทั้งนี้ บริษัทจัดการขอสงวนสิทธิ์ที่จะปรับปรุง/เปลี่ยนแปลงตัวชี้วัดในการเปรียบเทียบตามที่บริษัทจัดการเห็นควรและเหมาะสม ซึ่งอยู่ภายใต้กรอบนโยบายการลงทุนที่กำหนด โดยบริษัทจัดการจะเปลี่ยนตัวชี้วัดข้างต้นที่จัดทำโดยตลาดหลักทรัพย์ฯ เมื่อตลาดหลักทรัพย์ฯ มีการจัดทำดัชนี TRI ที่นำสัดส่วนผู้ถือหลักทรัพย์รายย่อยของแต่ละหลักทรัพย์มาถ่วงน้ำหนักในการคำนวณดัชนีเพื่อให้เป็นไปตามประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน โดยบริษัทจัดการจะเปิดเผยข้อมูลและแจ้งให้ผู้ลงทุนทราบล่วงหน้าอย่างชัดเจนถึงวันที่มีการปรับปรุง/เปลี่ยนแปลงตัวชี้วัด คำอธิบายเกี่ยวกับตัวชี้วัด และเหตุผลในการปรับปรุง/เปลี่ยนแปลงตัวชี้วัดดังกล่าวผ่านการลงประกาศในเว็บไซต์ของบริษัทจัดการ ภายในเวลาที่ผู้ลงทุนสามารถใช้ประโยชน์จากข้อมูลในการตัดสินใจลงทุนได้

อย่างไรก็ตาม ในกรณีการปรับปรุง/เปลี่ยนแปลงตัวชี้วัด เพื่อให้เป็นไปตามประกาศ เงื่อนไขและข้อกำหนดของสมาคมบริษัทจัดการลงทุนและ/หรือประกาศข้อกำหนดของสำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ต. เกี่ยวกับมาตรฐานการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวมและ/หรือการปรับปรุงเปลี่ยนแปลงตัวชี้วัดในการใช้เปรียบเทียบในกรณีที่ถูกออกตัวชี้วัดของตัวชี้วัดใหม่ไม่ได้จัดทำหรือเปิดเผยข้อมูล/อัตราดังกล่าวอีกต่อไป บริษัทจัดการจะแจ้งปรับปรุง/เปลี่ยนแปลงดังกล่าวให้ผู้ถือหน่วยลงทุนทราบล่วงหน้าผ่านการประกาศในเว็บไซต์ของบริษัทจัดการ ภายในเวลาที่ผู้ลงทุนสามารถใช้ประโยชน์จากข้อมูลในการตัดสินใจลงทุนได้