



กองทุนเปิด ฟิลลิป ผสมไทยเพื่อความยั่งยืนแบบพิเศษ
Phillip Mixed Thailand ESG Extra Fund

ชนิดเงินลงทุนเดิม (P-MESGX-SW)

ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

● กองทุนรวมผสม / กองทุนรวมไทยเพื่อความยั่งยืนแบบพิเศษ / กองทุนรวมเพื่อความยั่งยืน (SRI Fund) / กองทุนรวมที่ลงทุนแบบไม่มีความเสี่ยงต่างประเทศ

● กลุ่ม Aggressive Allocation

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- กองทุนมีนโยบายการลงทุนในทรัพย์สินอย่างใดอย่างหนึ่งหรือหลายอย่างโดยผู้ออกที่เป็นภาครัฐหรือกิจการที่จัดตั้งตามกฎหมายไทย ดังนี้ 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 โดยได้รับการประเมินการกำกับดูแลกิจการบริษัทจดทะเบียนจากสมาคมส่งเสริมกรรมการบริษัทไทยตั้งแต่ 90 คะแนนขึ้นไป และมีการเปิดเผยเป้าหมายและแผนธุรกิจที่เกี่ยวข้องกับการเพิ่มมูลค่ากิจการและแผนการยกระดับการดำเนินงานด้านความยั่งยืนตามมาตรฐานสากลหรือการลดปริมาณการปล่อยก๊าซเรือนกระจกของไทย และรายงานความคืบหน้าการปฏิบัติตามเป้าหมายหรือแผน ผ่านช่องทางของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET) ซึ่งจัดไว้สำหรับการเปิดเผยข้อมูลดังกล่าวโดยเฉพาะ รวมทั้งมีการเพิ่มประสิทธิภาพการสื่อสารกับนักลงทุน ตามที่ SET กำหนด โดยมีการลงทุนในหลักทรัพย์ในกลุ่มดังกล่าวโดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 65 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน
 - ตราสารหนี้กลุ่มความยั่งยืน เช่น ตราสารเพื่ออนุรักษ์สิ่งแวดล้อม (Green Bond) ตราสารเพื่อความยั่งยืน (Sustainability Bond) ตราสารส่งเสริมความยั่งยืน (Sustainability-Linked Bond)
 - พันธบัตรรัฐบาล พันธบัตรที่กระทรวงการคลังกำกับต้นเงินและดอกเบี้ย หรือหุ้นกู้ที่กระทรวงการคลังกำกับต้นเงินและดอกเบี้ยแต่ไม่รวมถึงหุ้นกู้แปลงสภาพ 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) ซึ่งมีการเปิดเผยข้อมูลในแบบแสดงรายการข้อมูลการเสนอขายโทเคนดิจิทัลตามที่สำนักงาน ก.ล.ต. กำหนด ทั้งนี้ จะระบุลักษณะและรายละเอียดของโทเคนดิจิทัล กลุ่มความยั่งยืนที่จะลงทุนให้เป็นไปตามประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุนและประกาศสำนักงาน ก.ล.ต.ต่อไป
- มุ่งหวังให้ผลการลงทุนสูงกว่าดัชนี (Active Management)
- ผู้ลงทุนสามารถศึกษาข้อมูลด้านความยั่งยืนแบบพิเศษเพิ่มเติมได้ที่หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

ระดับความเสี่ยง



เสี่ยงปานกลางค่อนข้างสูง

กองทุนรวมผสม ที่มี net exposure ได้ทั้งในตราสารทุน ตราสารหนี้ และ/หรือทรัพย์สินทางเลือก โดยมีการลงทุนในตราสารทุนน้อยกว่าร้อยละ 80 ของ NAV

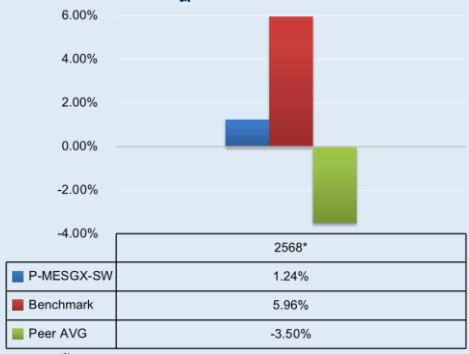
ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน : 09 พ.ค. 2568
 วันเริ่มต้น class : 13 พ.ค. 2568
 นโยบายการจ่ายเงินปันผล : ไม่มีนโยบายจ่ายเงินปันผล
 อายุกองทุน : ไม่กำหนด
 การป้องกันความเสี่ยง FX : -
 การเรียกเก็บค่าธรรมเนียมตามผลการดำเนินงาน : ไม่มี

ผู้จัดการกองทุนรวม

นายพุทธิพันธ์ วัชรินาคม ตั้งแต่วันที่ 09 พ.ค. 2568
 นายสุชาติ เจริญวุฒิคุณ ตั้งแต่วันที่ 09 พ.ค. 2568

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (%ต่อปี)



หมายเหตุ : * แสดงถึงผลตอบแทนที่เกิดขึ้นจากช่วงระยะเวลาดังกล่าว ไม่ได้เป็นการแสดงเป็นผลตอบแทนต่อปี

ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักัทหมด

Fund	YTD	3M	6M	1Y*
P-MESGX-SW	2.33	2.33	2.08	N/A
Benchmark	7.25	7.25	7.07	N/A
Peer AVG	7.55	7.55	6.97	N/A
P-MESGX-SW (SD)	16.13	16.13	12.45	N/A
Benchmark (SD)	15.48	15.48	12.59	N/A

Fund	3Y*	5Y*	10Y*	Inception*
P-MESGX-SW	N/A	N/A	N/A	3.60
Benchmark	N/A	N/A	N/A	13.65
Peer AVG	N/A	N/A	N/A	N/A
P-MESGX-SW (SD)	N/A	N/A	N/A	11.99
Benchmark (SD)	N/A	N/A	N/A	12.36

หมายเหตุ : * % ต่อปี

ดัชนีชี้วัด :

1. ดัชนีผลตอบแทนรวม SETESG Index (SETESG TRI) สัดส่วน 70%
 2. ผลตอบแทนรวมสุทธิของดัชนีพันธบัตรรัฐบาล ESG ของสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย (ThaiBMA Government Bond ESG Index Net Total Return) สัดส่วน 20%
 3. ผลตอบแทนรวมของดัชนีตราสารหนี้ภาครัฐระยะสั้น (ThaiBMA Short term Government Bond Index Total Return) สัดส่วน 10%
- โดยมีวัตถุประสงค์เพื่อเปรียบเทียบกับผลการดำเนินงานของกองทุนรวม (Performance Objective)

คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวม มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต
- ผู้ลงทุนควรศึกษาข้อมูลเกี่ยวกับสิทธิประโยชน์ทางภาษีที่ระบุไว้ในคู่มือการลงทุนด้วย

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

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือบริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่องได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

การซื้อขายหน่วยลงทุน

วันทำการซื้อ : ระหว่างวันที่ 13 พ.ค. – 30 มิ.ย. 68
โดยบริษัทจัดการจะเปิดรับเฉพาะคำสั่ง
สับเปลี่ยนหน่วยลงทุนที่มาจากกองทุน
LTF โดยทำการสับเปลี่ยนหน่วยลงทุน
ด้วยวิธีการชำระราคาด้วยหลักทรัพย์
หรือทรัพย์สินอื่นแทนเงินเท่านั้น

เวลาทำการ : 8.30 – 15.30 น.

การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ : ไม่กำหนด

การซื้อครั้งถัดไปขั้นต่ำ : ไม่กำหนด

หมายเหตุ - ผู้ถือหน่วยลงทุนของกองทุน LTF ต้องแจ้งความประสงค์และส่งคำสั่งสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนล่วงหน้าระหว่างวันที่ 13 พ.ค. – 30 มิ.ย. 2568 เท่านั้น โดยบริษัทจัดการจะเปิดรับคำสั่งสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนทุกวันจันทร์ถึงวันศุกร์ ภายในเวลา 15.30 น. ทั้งนี้ผู้ลงทุนสามารถดูข้อมูลการทำรายการสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนดังกล่าว ได้ที่เว็บไซต์ของบริษัทจัดการ

www.phillipasset.co.th

- ของรวันสิทธิในการเปลี่ยนแปลงระยะเวลาการรับค่าขายคืนจริง ทั้งนี้ไม่เกิน 5 วันทำการหลังจากวันทำการขายคืน

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV) ค่าธรรมเนียมต่อไปนี้จะส่งผลกระทบต่อผู้ลงทุน
เนื่องจากจะทำให้ผลตอบแทนจากการลงทุนลดลง ดังนั้น ผู้ลงทุนควรตรวจสอบทุกครั้งก่อนตัดสินใจลงทุน

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	2.1400	1.6050
ค่าตอบแทนแก่ตัวแทนขายหน่วยลงทุนของกองทุนรวม (trailer fee) : มี		
รวมค่าใช้จ่าย	3.9590	1.7227

หมายเหตุ

1. ค่าธรรมเนียมรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว

2. รวมค่าใช้จ่าย ประกอบด้วย ค่าธรรมเนียมการจัดการ ผู้ดูแลผลประโยชน์ นายทะเบียน และค่าใช้จ่ายอื่น

โดยอัตราที่เรียกเก็บจริงของค่าใช้จ่ายอื่นเป็นข้อมูลตามรอบปีบัญชีหรือรอบ 6 เดือนล่าสุดของกองทุน

บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์ หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ
กองทุน

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย) ผู้ลงทุนจะถูกเรียกเก็บค่าธรรมเนียมต่อไปนี้
โดยตรงทุกครั้งเมื่อทำการซื้อขายหรือสับเปลี่ยนหน่วยลงทุน

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 65.93

ตราสารหนี้ภาครัฐ 22.68

ทรัพย์สิน/หนี้สินอื่น ๆ 11.39

การขายคืนหน่วยลงทุน

วันทำการขายคืน : ทุกวันทำการ

เวลาทำการ : 8.30 – 12.00 น.

การขายคืนขั้นต่ำ : ไม่กำหนด

ยอดคงเหลือขั้นต่ำ : ไม่กำหนด

ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน : T+3 คือ 3 วันทำการ

หลังจากวันทำการขายคืน

ข้อมูลเชิงสถิติ

Maximum Drawdown : -10.11%

Recovering Period : N/A

FX Hedging : N/A

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน : 0.70 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

**การจัดสรรการลงทุนตามอันดับ
ความน่าเชื่อถือ (%)**

N/A

การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม

ชื่อหลักทรัพย์	สัดส่วน % ของพอร์ต
บริการ	19.99
ทรัพยากร	19.92
ธุรกิจการเงิน	13.50
อสังหาริมทรัพย์และก่อสร้าง	5.27
เทคโนโลยี	3.77
เกษตรและอุตสาหกรรมอาหาร	3.50

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน**ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก**

ประเภททรัพย์สิน	สัดส่วน % ของพอร์ต	ชื่อหลักทรัพย์	สัดส่วน % ของพอร์ต
ตราสารทุน	65.93	พันธบัตรรัฐบาลส่งเสริมความ ยั่งยืน SLB406A	22.68
ตราสารหนี้ภาครัฐ	22.68	บริษัท กัลฟ์ ทีเวลลอปเม้นท์ จำกัด (มหาชน)	5.25
ทรัพย์สิน/หนี้สินอื่น ๆ	11.39	บริษัท ซีพี ออลล์ จำกัด (มหาชน)	4.54
		บริษัท กรุงเทพดุสิตเวชการ จำกัด (มหาชน)	4.02
		บริษัท แอควานซ์ อินโฟร์ เซอร์วิส จำกัด (มหาชน)	3.77

คำอธิบาย

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

Recovering Period ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาตั้งแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินต้นเริ่มต้นใช้ระยะเวลานานเท่าใด

FX Hedging เปรอ์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลานึง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อหลักทรัพย์กับผลรวมของมูลค่าการขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 1 ปีหารด้วยมูลค่า NAV ของกองทุนรวมเฉลี่ยในรอบระยะเวลาเดียวกัน กองทุนรวมที่มีค่า portfolio turnover สูง บ่งชี้ถึงการซื้อขายหลักทรัพย์บ่อยครั้งของผู้จัดการกองทุนและทำให้มีต้นทุนการซื้อขายหลักทรัพย์ที่สูง จึงต้องพิจารณาเปรียบเทียบกับผลการดำเนินงานของกองทุนรวมเพื่อประเมินความคุ้มค่าของการซื้อขายหลักทรัพย์ดังกล่าว

Sharpe Ratio อัตราส่วนระหว่างผลตอบแทนส่วนเพิ่มของกองทุนรวมเปรียบเทียบกับความเสี่ยงจากการลงทุน โดยคำนวณจากผลต่างระหว่างอัตราผลตอบแทนของ

กองทุนรวมกับอัตราผลตอบแทนที่ปราศจากความเสี่ยง (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 อาคารวิวัฒน์ 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) หรือพันธบัตรหรือหุ้นกู้ส่งเสริมความยั่งยืน (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) เพื่อสร้างผลตอบแทนที่ยั่งยืนให้กับผู้ถือหุ้นรายลงทุน 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. การอ้างอิงดัชนีชี้วัดที่เกี่ยวข้องกับความยั่งยืน (investment benchmark)

- 1) ดัชนีผลตอบแทนรวม SETESG Index (SETESG TRI) สัดส่วน 70% ซึ่งเป็นดัชนีที่มีองค์ประกอบของบริษัทที่มีผลการประเมิน SET ESG Ratings ปีล่าสุดซึ่งจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ โดยผู้ลงทุนสามารถศึกษารายละเอียดเกี่ยวกับดัชนีชี้วัดดังกล่าวได้ที่ <https://www.set.or.th/th/market/index/setesg/profile>
- 2) ผลตอบแทนรวมสุทธิของดัชนีพันธบัตรรัฐบาล ESG ของสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย (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) ผลตอบแทนรวมของดัชนีตราสารหนี้ภาครัฐระยะสั้น (ThaiBMA Short term Government Bond Index Total Return) สัดส่วน 10%

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

อย่างไรก็ตาม ในกรณีการปรับปรุง/เปลี่ยนแปลงตัวชี้วัด เพื่อให้เป็นไปตามประกาศ เงื่อนไขและข้อกำหนดของสมาคมบริษัทจัดการลงทุนและ/หรือประกาศข้อกำหนดของสำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ต. เกี่ยวกับมาตรฐานการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวมและ/หรือการปรับปรุงเปลี่ยนแปลงตัวชี้วัดในการใช้เปรียบเทียบในกรณีที่ผู้ออกตัวชี้วัดของตัวชี้วัดใหม่ไม่ได้จัดทำหรือเปิดเผยข้อมูล/อัตราดังกล่าวอีกต่อไป บริษัทจัดการจะแจ้งปรับปรุง/เปลี่ยนแปลงดังกล่าวให้ผู้ถือหุ้นรายลงทุนทราบล่วงหน้าผ่านการประกาศในเว็บไซต์ของบริษัทจัดการ ภายในเวลาที่ผู้ลงทุนสามารถใช้ประโยชน์จากข้อมูลในการตัดสินใจลงทุนได้