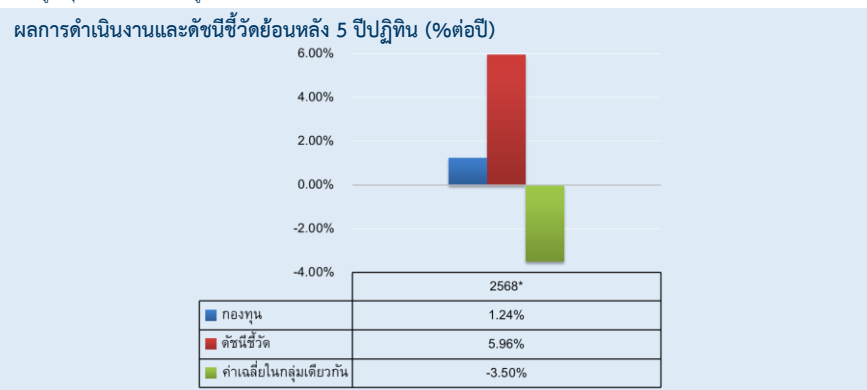




**กองทุนเปิด ฟิลลิป ผสมไทยเพื่อความยั่งยืนแบบพิเศษ**  
**Phillip Mixed Thailand ESG Extra Fund**  
**ชนิดเงินลงทุนเดิม (P-MESGX-SW)**

**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 รวมทั้งมีการเพิ่มประสิทธิภาพการสื่อสารกับผู้ลงทุน ตามที่ SETกำหนด โดยมีการลงทุนในหลักทรัพย์ในกลุ่มดังกล่าวโดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 65 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน
  - ตราสารหนี้กลุ่มความยั่งยืน เช่น ตราสารเพื่ออนุรักษ์สิ่งแวดล้อม (Green Bond) ตราสารเพื่อความยั่งยืน (Sustainability Bond) ตราสารส่งเสริมความยั่งยืน (Sustainability-Linked Bond)
  - พันธบัตรรัฐบาล พันธบัตรที่กระทรวงการคลังค้ำประกันต้นเงินและดอกเบี้ย หรือหุ้นกู้ที่กระทรวงการคลังค้ำประกันต้นเงินและดอกเบี้ยแต่ไม่รวมถึงหุ้นกู้แปลงสภาพ 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
  - มุ่งหวังให้ผลตอบแทนการลงทุนสูงกว่าดัชนี (Active Management)
  - ผู้ลงทุนสามารถศึกษาข้อมูลด้านความยั่งยืนแบบพิเศษเพิ่มเติมได้ที่หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



หมายเหตุ : \* แสดงถึงผลตอบแทนที่เกิดขึ้นจากช่วงระยะเวลาดังกล่าว ไม่ได้เป็นการแสดงเป็นผลตอบแทนต่อปี

| ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักกัทชุด |        |         |         |                  |
|------------------------------------|--------|---------|---------|------------------|
|                                    | YTD    | 3 เดือน | 6 เดือน | 1 ปี *           |
| กองทุน                             | 10.11  | 7.61    | 10.11   | 19.78            |
| ดัชนีชี้วัด                        | 15.12  | 7.34    | 15.12   | 28.79            |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน           | 17.00  | 8.81    | 17.00   | 28.42            |
| ความผันผวนกองทุน                   | 13.10  | 8.88    | 13.10   | 11.01            |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด              | 12.40  | 8.01    | 12.40   | 11.26            |
|                                    | 3 ปี * | 5 ปี *  | 10 ปี * | ตั้งแต่จัดตั้ง * |
| กองทุน                             | N/A    | N/A     | N/A     | 10.16            |
| ดัชนีชี้วัด                        | N/A    | N/A     | N/A     | 19.35            |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน           | N/A    | N/A     | N/A     |                  |
| ความผันผวนกองทุน                   | N/A    | N/A     | N/A     | 11.41            |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด              | N/A    | N/A     | N/A     | 11.57            |
| หมายเหตุ : * % ต่อปี               |        |         |         |                  |

**ระดับความเสี่ยง**

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

**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                      ตั้งแต่ 09 พ.ค. 2568  
นายสุชาติ เจริญวุฒิคุณ                      ตั้งแต่ 09 พ.ค. 2568

- ดัชนีชี้วัด :**
- ดัชนีผลตอบแทนรวม SETESG Index (SETESG TRI) สัดส่วน 70%
  - ผลตอบแทนรวมสุทธิของดัชนีพันธบัตรรัฐบาล ESG ของสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย (ThaiBMA Government Bond ESG Index Net Total Return) สัดส่วน 20%
  - 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

ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือ  
บริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่องได้  
ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

www.phillipasset.co.th

|                                                           |                                                         |
|-----------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|
| <b>การซื้อขายหน่วยลงทุน</b>                               | <b>การขายคืนหน่วยลงทุน</b>                              |
| <b>วันทำการซื้อ :</b> ระหว่างวันที่ 13 พ.ค. – 30 มิ.ย. 68 | <b>วันทำการขายคืน :</b> ทุกวันทำการ                     |
| โดยบริษัทจัดการจะเปิดรับเฉพาะคำสั่ง                       | <b>เวลาทำการ :</b> 8.30 – 12.00 น.                      |
| สับเปลี่ยนหน่วยลงทุนที่มาจากกองทุน                        | <b>การขายคืนขั้นต่ำ :</b> ไม่กำหนด                      |
| LTF โดยทำการสับเปลี่ยนหน่วยลงทุน                          | <b>ยอดคงเหลือขั้นต่ำ :</b> ไม่กำหนด                     |
| ด้วยวิธีการชำระราคาด้วยหลักทรัพย์                         | <b>ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน :</b> T+3 คือ 3 วันทำการ |
| หรือทรัพย์สินอื่นแทนเงินเท่านั้น                          | หลังจากวันทำการขายคืน                                   |
| <b>เวลาทำการ :</b> 8.30 – 15.30 น.                        |                                                         |
| <b>การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ :</b> ไม่กำหนด                  |                                                         |
| <b>การซื้อครั้งถัดไปขั้นต่ำ :</b> ไม่กำหนด                |                                                         |

**หมายเหตุ** - ผู้ถือหน่วยลงทุนของกองทุน LTF ต้องแจ้งความประสงค์และส่งคำสั่งสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนล่วงหน้าระหว่างวันที่ 13 พ.ค. – 30 มิ.ย. 2568 เท่านั้น โดยบริษัทจัดการจะเปิดรับคำสั่งสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนทุกวันจันทร์ถึงวันศุกร์ ภายในเวลา 15.30 น. ทั้งนี้ผู้ลงทุนสามารถดูข้อมูลการทำรายการสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนดังกล่าว ได้ที่เว็บไซต์ของบริษัทจัดการ [www.phillipasset.co.th](http://www.phillipasset.co.th)

- ขอสงวนสิทธิ์ในการเปลี่ยนแปลงระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืนจริง ทั้งนี้ไม่เกิน 5 วันทำการหลังจากวันทำการขายคืน

| <b>ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV) ค่าธรรมเนียมต่อไปนี้จะส่งผลกระทบต่อผู้ลงทุน</b> |                      |                 |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------|-----------------|
| เนื่องจากจะทำให้ผลตอบแทนจากการลงทุนลดลง ดังนั้น ผู้ลงทุนควรตรวจสอบทุกครั้งก่อนตัดสินใจลงทุน              |                      |                 |
| <b>ค่าธรรมเนียม</b>                                                                                      | <b>สูงสุดไม่เกิน</b> | <b>เก็บจริง</b> |
| การจัดการ                                                                                                | 2.1400               | 1.6049          |
| ค่าตอบแทนแก่ตัวแทนขายหน่วยลงทุนของกองทุนรวม (trailer fee) : มี                                           |                      |                 |
| รวมค่าใช้จ่าย                                                                                            | 3.9590               | 2.1255          |

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

| <b>ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย) ผู้ลงทุนจะถูกเรียกเก็บค่าธรรมเนียมต่อไปนี้</b> |                               |                   |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------|-------------------|
| โดยตรงทุกครั้งเมื่อทำการซื้อขายหรือสับเปลี่ยนหน่วยลงทุน                                                       |                               |                   |
| <b>ค่าธรรมเนียม</b>                                                                                           | <b>สูงสุดไม่เกิน</b>          | <b>เก็บจริง</b>   |
| 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

| <b>สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน</b> |                           | <b>ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก</b>      |                           |
|---------------------------------------|---------------------------|-------------------------------------------|---------------------------|
| <b>ประเภททรัพย์สิน</b>                | <b>สัดส่วน % ของพอร์ต</b> | <b>ชื่อหลักทรัพย์</b>                     | <b>สัดส่วน % ของพอร์ต</b> |
| ตราสารทุน                             | 66.33                     | พันธบัตรรัฐบาลส่งเสริมความยั่งยืน SLB406A | 21.77                     |
| ตราสารหนี้ภาครัฐ                      | 21.77                     | บริษัท กัลฟ์ ดีเวลลอปเม้นท์ จำกัด (มหาชน) | 4.85                      |
| เงินฝากสถาบันการเงิน                  | 0.01                      | บริษัท กรุงเทววิศิตเวการ จำกัด (มหาชน)    | 4.58                      |
| ทรัพย์สิน/หนี้สินอื่น ๆ               | 11.90                     | บริษัท ซีพี ออลล์ จำกัด (มหาชน)           | 4.43                      |
|                                       |                           | บริษัท โรงพยาบาลพระรามเก้า จำกัด (มหาชน)  | 3.67                      |

|                                        |
|----------------------------------------|
| <b>ข้อมูลเชิงสถิติ</b>                 |
| Maximum Drawdown : -10.11%             |
| Recovering Period : N/A                |
| FX Hedging : N/A                       |
| อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน : 0.70 เท่า |
| Sharpe Ratio : 0.82                    |
| Alpha : -9.19%                         |
| Beta : 0.92                            |
| Tracking Error : N/A                   |
| อายุเฉลี่ยของตราสารหนี้ : N/A          |
| Yield to Maturity : N/A                |

|                                      |
|--------------------------------------|
| <b>การจัดสรรการลงทุนในต่างประเทศ</b> |
| N/A                                  |

|                                 |
|---------------------------------|
| <b>ผู้ออกตราสาร 5 อันดับแรก</b> |
| N/A                             |

|                                                      |
|------------------------------------------------------|
| <b>การจัดสรรการลงทุนตามอันดับความน่าเชื่อถือ (%)</b> |
| N/A                                                  |

| <b>การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม</b> |                           |
|-------------------------------------------|---------------------------|
| <b>ชื่อหลักทรัพย์</b>                     | <b>สัดส่วน % ของพอร์ต</b> |
| บริการ                                    | 23.23                     |
| ธุรกิจการเงิน                             | 18.00                     |
| ทรัพยากร                                  | 14.48                     |
| อสังหาริมทรัพย์และก่อสร้าง                | 4.08                      |
| เกษตรและอุตสาหกรรมอาหาร                   | 3.29                      |
| เทคโนโลยี                                 | 3.24                      |

## คำอธิบาย

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

**Recovering Period** ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาดังแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลานานเท่าใด

**FX Hedging** เพอร์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

**อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน** ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตกองทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลาหนึ่ง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์กับผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 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 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.ด. หรือสำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ด. 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.ด. หรือสำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ด. ประกาศกำหนด โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน

### 4. การอ้างอิงดัชนีชี้วัดที่เกี่ยวกับความยั่งยืน (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 บริษัทจัดการขอสงวนสิทธิ์ที่จะปรับปรุง/เปลี่ยนแปลงตัวชี้วัดในการเปรียบเทียบตามที่บริษัทจัดการเห็นควรและเหมาะสม ซึ่งอยู่ภายใต้กรอบนโยบายการลงทุนที่กำหนด โดยบริษัทจัดการจะเปลี่ยนตัวชี้วัดข้างต้นที่จัดทำโดยตลาดหลักทรัพย์ฯ เมื่อตลาดหลักทรัพย์ฯ มีการจัดทำดัชนี TRI ที่นำสัดส่วนผู้ถือหลักทรัพย์รายย่อยของแต่ละหลักทรัพย์มาถ่วงน้ำหนักในการคำนวณดัชนีเพื่อให้เป็นไปตามประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน โดยบริษัทจัดการจะเปิดเผยข้อมูลและแจ้งให้ผู้ลงทุนทราบล่วงหน้าอย่างชัดเจนถึงวันที่มีการปรับปรุง/เปลี่ยนแปลงตัวชี้วัด คำอธิบายเกี่ยวกับตัวชี้วัด และเหตุผลในการปรับปรุง/เปลี่ยนแปลงตัวชี้วัดดังกล่าวผ่านการลงประกาศในเว็บไซต์ของบริษัทจัดการ ภายในเวลาที่ผู้ลงทุนสามารถใช้ประโยชน์จากข้อมูลในการตัดสินใจลงทุนได้

อย่างไรก็ตาม ในกรณีการปรับปรุง/เปลี่ยนแปลงตัวชี้วัด เพื่อให้เป็นไปตามประกาศ เงื่อนไขและข้อกำหนดของสมาคมบริษัทจัดการลงทุนและ/หรือประกาศข้อกำหนดของสำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ด. เกี่ยวกับมาตรฐานการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวมและ/หรือการปรับปรุงเปลี่ยนแปลงตัวชี้วัดในการใช้เปรียบเทียบในกรณีที่ผู้ออกตัวชี้วัดของตัวชี้วัดใหม่ไม่ได้จัดทำหรือเปิดเผยข้อมูล/อัตราดังกล่าวอีกต่อไป บริษัทจัดการจะแจ้งปรับปรุง/เปลี่ยนแปลงดังกล่าวให้ผู้ถือหน่วยลงทุนทราบล่วงหน้าผ่านการประกาศในเว็บไซต์ของบริษัทจัดการ ภายในเวลาที่ผู้ลงทุนสามารถใช้ประโยชน์จากข้อมูลในการตัดสินใจลงทุนได้