

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน อีเอสทีเอสพริ้ง  
(ประเทศไทย) จำกัด



ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมผสม / กองทุนรวมไทยเพื่อความยั่งยืน / กองทุนรวมเพื่อความยั่งยืน (SRI Fund)
- กลุ่ม Conservative Allocation

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

➢ 1.นโยบายการลงทุน

**ส่วนที่ 1** กองทุนมีนโยบายกระจายการลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินดังต่อไปนี้ ที่ออกโดยผู้ออกที่เป็นตราสารภาครัฐไทยหรือกิจการที่จัดตั้งขึ้นตามกฎหมายไทย และมี net exposure ในทรัพย์สินส่วนที่ 1 โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน

1.1 หุ้นที่เป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET) บนกระดานหลัก หรือกระดานเอ็มเอไอ (mai) ที่ได้รับการคัดเลือกจาก SET ว่ามีความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน (Environmental, Social and Governance: ESG)

1.2 ตราสารอย่างใดอย่างหนึ่ง หรือหลายอย่าง ดังนี้

1.2.1 พันธบัตรรัฐบาล พันธบัตรที่กระทรวงการคลังค้ำประกันต้นเงินและดอกเบี้ย หรือหุ้นกู้ที่กระทรวงการคลังค้ำประกันต้นเงินและดอกเบี้ย แต่ไม่รวมถึงหุ้นกู้แปลงสภาพ ซึ่งเป็นพันธบัตรหรือหุ้นกู้เพื่ออนุรักษ์สิ่งแวดล้อม (green bond) พันธบัตรหรือหุ้นกู้เพื่อความยั่งยืน (sustainability bond) หรือพันธบัตรหรือหุ้นกู้ส่งเสริมความยั่งยืน (sustainability - linked bond)

1.2.2 ตราสารเพื่ออนุรักษ์สิ่งแวดล้อม (green bond) ตราสารเพื่อความยั่งยืน (sustainability bond) หรือตราสารส่งเสริมความยั่งยืน (sustainability - linked bond)

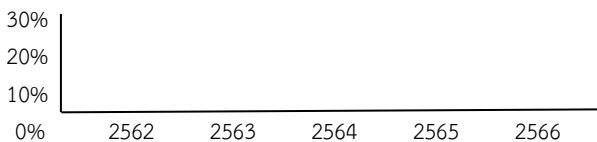
**ส่วนที่ 2** เงินลงทุนส่วนที่เหลือนอกเหนือจากทรัพย์สินตามส่วนที่ 1

กองทุนอาจลงทุนในตราสารทุน ตราสารกึ่งหนี้กึ่งทุน ตราสารหนี้ เงินฝากหรือตราสารเทียบเท่าเงินฝาก และ/หรือ หน่วยลงทุนของกองทุนรวม หน่วย ETF หน่วย Infra หรือหน่วย property โดยมีการลงทุนในส่วนที่ 2 โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชี ไม่เกินร้อยละ 20 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน

ทั้งนี้ สัดส่วนการลงทุนในตราสารทุน โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่เกินร้อยละ 30 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน และสัดส่วนการลงทุนในตราสารหนี้ โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชี ไม่น้อยกว่าร้อยละ 70 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน

- กองทุนอาจจะลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) เพื่อเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน (Efficient Portfolio Management (EPM))
  - กลยุทธ์การลงทุน – ส่วนตราสารทุนมุ่งหวังให้ผลประกอบการเคลื่อนไหวตามดัชนีชี้วัด (passive management)
  - ส่วนตราสารหนี้มุ่งหวังให้ผลประกอบการเคลื่อนไหวสูงกว่าดัชนีชี้วัด (active management)
- หมายเหตุ : รายละเอียดเกี่ยวกับ SRI Fund อยู่ท้ายเอกสารฉบับนี้

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (%ต่อปี)



ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปีกumul (%ต่อปี)

|                             | YTD  | 3 เดือน | 6 เดือน | 1 ปี           |
|-----------------------------|------|---------|---------|----------------|
| ES-ESG30/70-ThaiESG-D       | N/A  | N/A     | N/A     | N/A            |
| ดัชนีชี้วัด (THB)           | N/A  | N/A     | N/A     | N/A            |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน    | N/A  | N/A     | N/A     | N/A            |
| ความผันผวนกองทุน            | N/A  | N/A     | N/A     | N/A            |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด (THB) | N/A  | N/A     | N/A     | N/A            |
|                             | 3 ปี | 5 ปี    | 10 ปี   | ตั้งแต่จัดตั้ง |
| ES-ESG30/70-ThaiESG-D       | N/A  | N/A     | N/A     | N/A            |
| ดัชนีชี้วัด (THB)           | N/A  | N/A     | N/A     | N/A            |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน    | N/A  | N/A     | N/A     | N/A            |
| ความผันผวนกองทุน            | N/A  | N/A     | N/A     | N/A            |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด (THB) | N/A  | N/A     | N/A     | N/A            |

| ระดับความเสี่ยง  |   |   |   |   |   |   |   |   |     |
|--|---|---|---|---|---|---|---|---|-----|
| ต่ำ  | 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | สูง |
| คำอธิบาย   |   |   |   |   |   |   |   |   |     |
| ลงทุนในตราสารทุน ตราสารหนี้และ/หรือทรัพย์สินทางเลือก โดยมีสัดส่วนการลงทุนในตราสารทุนไม่เกิน 30 % ของ NAV |   |   |   |   |   |   |   |   |     |

ข้อมูลกองทุนรวม

|                        |          |
|------------------------|----------|
| วันจดทะเบียนกองทุน     | -        |
| วันเริ่มต้น class      | -        |
| นโยบายการจ่ายเงินปันผล | จ่าย     |
| อายุกองทุน             | ไม่กำหนด |

ผู้จัดการกองทุน :

- 1.คุณวิศิษฐ์ ชื่นรัตนกุล (ตั้งแต่วันจดทะเบียนกองทุน)
- 2.คุณนันทรา ลายจุต (ตั้งแต่วันจดทะเบียนกองทุน)

ดัชนีชี้วัด : (1) SETESG Total return Index ร้อยละ 30

(2) ThaiBMA Government Bond ESG Index Net Total Return ร้อยละ 50

(3) ผลตอบแทนรวมของดัชนีพันธบัตรรัฐบาลระยะสั้นของสมาคมตราสารหนี้ไทย (ThaiBMA Short-term Government Bond Index Total Return) ร้อยละ 20

คำเตือน :

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวม มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต: มีบริษัทแม่ดูแลให้ทำตามกฎหมาย

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



www.eastspring.co.th

ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเรื่องเครื่องมือบริหารความเสี่ยง  
ด้านสภาพคล่องได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

| การซื้อขายหน่วยลงทุน ช่วง IPO   | การขายคืนหน่วยลงทุน   |
|---|---|
| วันที่ทำการซื้อช่วง IPO : วันที่ 24-29 ต.ค.67   | วันที่ทำการขายคืน :   |
| เสนอขายหลัง IPO วันที่ 8 พ.ย.67 เป็นต้นไป   | กรณีรับซื้อคืนแบบดุลยพินิจ : ทุกวันทำการ  |
| เวลาทำการ : 08:30 น.-15:30 น.<br>การซื้อขายครั้งแรกขั้นต่ำ : ไม่กำหนด<br>การซื้อขายครั้งถัดไปขั้นต่ำ : ไม่กำหนด | เวลาทำการ : 08:30 น.-15:30 น.<br>การซื้อขายขั้นต่ำ : 1 บาท<br>ยอดคงเหลือขั้นต่ำ : ไม่กำหนด<br>ระยะเวลาปรับเงินค่าขายคืน : T+2 |

หมายเหตุ ภายใน 5 วันทำการนับแต่วันรับซื้อคืนหน่วยลงทุน (ในภาวะปกติ บลจ.อีสท์สปริง สามารถชำระเงินค่าขายคืนหน่วยลงทุนได้ภายใน 2 วันทำการนับแต่วันรับซื้อคืนหน่วยลงทุน)

#### ช่องทางซื้อ

- ซื้อผ่านบริษัทจัดการหรือผู้สนับสนุนการขายหรือรับซื้อคืน
- หักเงินค่าซื้อหน่วยลงทุนผ่านบริการธุรกรรมทางอิเล็กทรอนิกส์ผ่านบัญชี ดังนี้  
 ธ.ทหารไทยธนชาติ ธ.ไทยพาณิชย์ ธ.กรุงศรีอยุธยา ธ.กรุงเทพ ธ.กรุงไทย ธ.กสิกรไทย ธ.ยูโอบี  
 ธ.แลนด์แอนด์ เฮาส์ ธ.เกียรตินาคินภัทร ธ.ซีไอเอ็มบีไทย  
 รับชำระเงินค่าซื้อหน่วยลงทุนด้วยเช็ค หรือตราพด ได้ถึงวันที่ 29 ต.ค.67

#### 1.3 รายชื่อกองทุนต้นทางที่สามารถสับเปลี่ยนเข้ากองทุนนี้ได้ถึงวันที่ 29 ต.ค.67

|                       |                       |                        |
|-----------------------|-----------------------|------------------------|
| อีสท์สปริง ธนบดี      | อีสท์สปริง ธนรัฐ      | ชอร์ทเทอม อินคัม พลัส  |
| อีสท์สปริง บริหารเงิน | อีสท์สปริง อีวีสมบัติ | อีสท์สปริง Income Plus |

#### ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)

| ค่าธรรมเนียม  | สูงสุดไม่เกิน | เก็บจริง |
|---------------|---------------|----------|
| การจัดการ     | 1.6050        | 0.3600   |
| รวมค่าใช้จ่าย | 2.4075        | 0.5293   |

หมายเหตุ: บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ

#### ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าหน่วยลงทุน)

| ค่าธรรมเนียม                         | สูงสุดไม่เกิน | เก็บจริง               |
|--------------------------------------|---------------|------------------------|
| การขาย / การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า | 1.00          | ปัจจุบันไม่เรียกเก็บ   |
| การรับซื้อคืน                        | 1.00          | *หมายเหตุ <sup>1</sup> |
| การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก           | 1.00          | *หมายเหตุ <sup>1</sup> |

หมายเหตุ: 1.ค่าธรรมเนียมการรับซื้อคืน / การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก:

- ขายคืน หรือ สับเปลี่ยนหน่วยลงทุนของกองทุนนี้ ออกไปยัง กองทุนรวมภายใต้การจัดการ ของ บลจ.อีสท์สปริง : ปัจจุบันยกเว้น
- สับเปลี่ยนหน่วยลงทุนของกองทุนนี้ ออกไปยัง กองทุนรวมภายใต้การจัดการ ของ บลจ.อื่น : ปัจจุบันไม่เรียกเก็บ

2.ส่วนต่างมูลค่าหน่วยลงทุน (Spread) ที่เรียกเก็บจากผู้ทำรายการนี้ เพื่อนำไปชำระเป็นค่าใช้จ่ายในการซื้อขายหลักทรัพย์ของกองทุน ไม่เกินร้อยละ 0.25 ของมูลค่าหน่วยลงทุน  
 เก็บจริง ร้อยละ 0.10 ของมูลค่าหน่วยลงทุน (ในช่วง IPO ยกเว้นไม่เรียกเก็บค่าธรรมเนียมนี้)

#### สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุนของ

#### ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรกของกองทุน

| ชื่อประเภททรัพย์สิน | % NAV | ชื่อหลักทรัพย์ | % NAV |
|---------------------|-------|----------------|-------|
| XX                  | XX    | XX             | XX    |
| XX                  | XX    | XX             | XX    |
| XX                  | XX    | XX             | XX    |
| XX                  | XX    | XX             | XX    |
| XX                  | XX    | XX             | XX    |

#### ข้อมูลเชิงสถิติ

|                            |   |
|----------------------------|---|
| Maximum Drawdown           | - |
| Recovering Period          | - |
| อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน | - |
| Sharpe Ratio               | - |
| Alpha                      | - |
| Beta                       | - |
| Tracking error             | - |

#### การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม/ทรัพย์สินของกองทุน

| Sector / Assets | % NAV |
|-----------------|-------|
| XX              | XX    |
| XX              | XX    |
| XX              | XX    |
| XX              | XX    |
| XX              | XX    |

## คำอธิบาย

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

**Recovering Period** ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาตั้งแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลาานเท่าใด

**FX Hedging** เปอร์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

**อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน** ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลาหนึ่ง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์กับผลรวมของมูลค่าการขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 1 ปีหารด้วยมูลค่า NAV ของกองทุนรวมเฉลี่ยในรอบระยะเวลาเดียวกัน กองทุนรวมที่มีค่า portfolio turnover สูงบ่งชี้ถึงการซื้อขายหลักทรัพย์บ่อยครั้งของผู้จัดการกองทุนและทำให้มีต้นทุนการซื้อขายหลักทรัพย์ที่สูง จึงต้องพิจารณาเปรียบเทียบกับผลการดำเนินงานของกองทุนรวมเพื่อประเมิน ความคุ้มค่าของการซื้อขายหลักทรัพย์ดังกล่าว

**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** ระดับและทิศทางของการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุน โดยเปรียบเทียบกับอัตราการเปลี่ยนแปลงของตลาด Beta น้อยกว่า 1 แสดงว่าหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนน้อยกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด Beta มากกว่า 1 แสดงว่าหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนมากกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด

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

**Yield to Maturity** อัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในตราสารหนี้โดยถือจนครบกำหนดอายุ ซึ่งคำนวณจากดอกเบี้ยที่จะได้รับในอนาคตตลอดอายุตราสารและเงินต้นที่จะได้รับคืน นำมาคิดลดเป็นมูลค่าปัจจุบัน โดยใช้ตัวอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมตราสารหนี้ คำนวณจากค่าเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักของ Yield to Maturity ของตราสารหนี้แต่ละตัวที่กองทุนมี การลงทุน และเนื่องจาก Yield to Maturity มีหน่วยมาตรฐานเป็นเปอร์เซ็นต์ต่อปี จึงสามารถนำไปใช้เปรียบเทียบอัตราผลตอบแทนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีนโยบายถือครองตราสารหนี้จนครบกำหนดอายุและมีลักษณะการลงทุนที่ใกล้เคียงกันได้



[www.eastspring.co.th](http://www.eastspring.co.th)

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน อีสท์สปริง (ประเทศไทย) จำกัด  
ชั้น 9 อาคาร มิตรทาวน์ ออฟฟิศ ทาวเวอร์ 944 ถนนพระราม 4  
แขวงวังใหม่ เขตปทุมวัน กรุงเทพมหานคร 10330

| ศูนย์ที่ปรึกษาการลงทุน 1725 | ผู้สนับสนุนการขายและรับซื้อคืนหน่วยลงทุน ที่ได้รับการแต่งตั้ง

Expert in Asia. Invest in Your Future.

## นโยบายการลงทุนเพิ่มเติม

### 1.1. วัตถุประสงค์การลงทุนที่เกี่ยวข้องกับความยั่งยืน

กองทุนมีวัตถุประสงค์ในการช่วยส่งเสริมการลงทุน เพื่อสร้างผลตอบแทนที่ยั่งยืนในระยะยาวควบคู่ไปกับการช่วยสร้างผลกระทบต่อเชิงบวกและลดผลกระทบต่อสังคมและสิ่งแวดล้อม ผ่านการลงทุนใน

- หุ้นที่เป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET) บนกระดานหลัก หรือกระดานเอ็มเอไอ (mai) ที่ได้รับการคัดเลือกจาก SET ว่ามีความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน (Environmental, Social and Governance: ESG) ในสัดส่วนที่เท่าหรือใกล้เคียงกับน้ำหนักที่เป็นส่วนประกอบของดัชนีผลตอบแทนรวม SETESG Index (SETESG TRI) ซึ่งเป็นดัชนีที่ได้รับการคัดเลือกจากตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET) ว่ามีความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อม

(Environment) หรือด้านความยั่งยืน (Environmental, Social and Governance: ESG) และ/หรือ

- ตราสารอย่างใดอย่างหนึ่ง หรือหลายอย่าง ดังนี้

1) พันธบัตรรัฐบาล พันธบัตรที่กระทรวงการคลังค้ำประกันต้นเงินและดอกเบี้ย หรือ หุ้นกู้ที่กระทรวงการคลังค้ำประกันต้นเงินและดอกเบี้ยแต่ไม่รวมถึงหุ้นกู้แปลงสภาพ ซึ่งเป็นพันธบัตรหรือหุ้นกู้เพื่ออนุรักษ์สิ่งแวดล้อม (green bond) พันธบัตรหรือหุ้นกู้เพื่อความยั่งยืน (sustainability bond) หรือ พันธบัตรหรือหุ้นกู้ส่งเสริมความยั่งยืน (sustainability - linked bond)

2) ตราสารเพื่ออนุรักษ์สิ่งแวดล้อม (green bond) ตราสารเพื่อความยั่งยืน (sustainability bond) หรือตราสารส่งเสริมความยั่งยืน (sustainability - linked bond) ที่ออกตามประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุนว่าด้วยการขออนุญาตและการอนุญาตให้เสนอขายตราสารหนี้ที่ออกใหม่ต่อประชาชนเป็นการทั่วไป ประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุนว่าด้วยการขออนุญาตและการอนุญาตให้เสนอขายตราสารหนี้ที่ออกใหม่ต่อบุคคลในวงจำกัด และการเสนอขายหุ้นกู้แปลงสภาพต่อบุคคลที่มีลักษณะเฉพาะหรือประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุนว่าด้วยข้อกำหนดที่เกี่ยวกับการออกและเสนอขายหุ้นกู้ และการเปิดเผยข้อมูล แล้วแต่กรณี ซึ่งมีการเปิดเผยข้อมูลในแบบแสดงรายการข้อมูลการเสนอขายตราสารหรือเอกสารที่นำเสนอต่อผู้ลงทุนในการเสนอขายตราสารดังกล่าวในเรื่องดังนี้

(ก) กรณีเป็นตราสารเพื่ออนุรักษ์สิ่งแวดล้อมหรือตราสารเพื่อความยั่งยืนต้องมีการเปิดเผยวัตถุประสงค์การใช้เงินที่ได้จากการระดมทุน (use of proceeds) ว่าเป็นไปเพื่อโครงการที่เกี่ยวข้องกับการอนุรักษ์สิ่งแวดล้อมหรือเพื่อโครงการที่เกี่ยวข้องกับความยั่งยืนของประเทศไทย แล้วแต่กรณี

(ข) กรณีเป็นตราสารส่งเสริมความยั่งยืนต้องมีการเปิดเผยข้อมูลเกี่ยวกับการกำหนดตัวชี้วัดและเป้าหมายด้านความยั่งยืนเพื่อส่งเสริมความยั่งยืนของผู้ออกตราสารดังกล่าวในประเทศไทย

### 1.2. เป้าหมายที่กองทุนต้องการบรรลุ

เพื่อสร้างผลตอบแทนอย่างยั่งยืนให้กับผู้ลงทุน รวมถึงเป็นแรงขับเคลื่อนให้มีกิจกรรมที่มุ่งเน้นการดำเนินงานที่คำนึงถึงปัจจัยด้าน ESG มากขึ้น เพื่อส่งเสริมให้เกิดระบบนิเวศที่ยั่งยืนต่อระบบเศรษฐกิจไทย ซึ่งเป็นกลไกสนับสนุนให้เศรษฐกิจไทยสามารถเติบโตได้อย่างยั่งยืน รวมถึงส่งเสริมประเทศไทยในการเปลี่ยนผ่านไปสู่ความยั่งยืนในระดับสากล โดยการสนับสนุนการลงทุนใน

- ตราสารทุนของบริษัทที่ได้รับการคัดเลือกจากตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET) ว่ามีการประกอบกิจการที่มีความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน (Environmental, Social and Governance: ESG) และ/หรือ

- ตราสารภาครัฐไทยหรือกิจการที่จัดตั้งขึ้นตามกฎหมายไทย เพื่อการอนุรักษ์สิ่งแวดล้อม หรือ เพื่อสิ่งแวดล้อม สังคม และธรรมาภิบาล (Environmental, Social and Governance Bond: ESG Bond) ที่มีการเปิดเผยวัตถุประสงค์การใช้เงินที่ได้จากการระดมทุน (use of proceeds) ว่าเป็นไปเพื่อโครงการที่เกี่ยวข้องกับการอนุรักษ์สิ่งแวดล้อมหรือเพื่อโครงการที่เกี่ยวข้องกับความยั่งยืนของประเทศไทย

### 1.3. กรอบการลงทุน (Investment Universe)

กองทุนจะลงทุนในตราสาร และ/หรือ หลักทรัพย์ และ/หรือ ทรัพย์สิน ที่มุ่งเน้นด้านความยั่งยืน (Sustainable) และ/หรือ บริษัทจดทะเบียนที่มีการดำเนินธุรกิจแบบยั่งยืนครอบคลุมด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน (Environmental, Social and Governance: ESG) และมี net exposure ในทรัพย์สินที่ลงทุนดังกล่าวโดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน

- การลงทุนในตราสารทุน ได้แก่ หุ้นที่เป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET) บนกระดานหลัก หรือกระดานเอ็มเอไอ (mai) ที่ได้รับการคัดเลือกจาก SET ว่ามีความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน (Environmental, Social and Governance: ESG)

- การลงทุนในตราสารหนี้ ได้แก่ ตราสารอย่างใดอย่างหนึ่ง หรือหลายอย่าง ดังนี้

1) พันธบัตรรัฐบาล พันธบัตรที่กระทรวงการคลังค้ำประกันต้นเงินและดอกเบี้ย หรือ หุ้นกู้ที่กระทรวงการคลังค้ำประกันต้นเงินและดอกเบี้ยแต่ไม่รวมถึงหุ้นกู้แปลงสภาพ ซึ่งเป็นพันธบัตรหรือหุ้นกู้เพื่ออนุรักษ์สิ่งแวดล้อม (green bond) พันธบัตรหรือหุ้นกู้เพื่อความยั่งยืน (sustainability bond) หรือ พันธบัตรหรือหุ้นกู้ส่งเสริมความยั่งยืน (sustainability - linked bond)

- 2) ตราสารเพื่ออนุรักษ์สิ่งแวดล้อม (green bond) ตราสารเพื่อความยั่งยืน (sustainability bond) หรือตราสารส่งเสริมความยั่งยืน (sustainability - linked bond) ที่ออกตามประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุนว่าด้วยการขออนุญาตและการอนุญาตให้เสนอขายตราสารหนี้ที่ออกใหม่ต่อประชาชนเป็นการทั่วไป ประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุนว่าด้วยการขออนุญาตและการอนุญาตให้เสนอขายตราสารหนี้ที่ออกใหม่ต่อบุคคลในวงจำกัด และการเสนอขายหุ้นกู้แปลงสภาพต่อบุคคลที่มีลักษณะเฉพาะหรือประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุนว่าด้วยข้อกำหนดที่เกี่ยวกับการออกและเสนอขายศุภก และการเปิดเผยข้อมูล แล้วแต่กรณี ซึ่งมีการเปิดเผยข้อมูลในแบบแสดงรายการข้อมูลการเสนอขายตราสารหรือเอกสารที่นำเสนอต่อผู้ลงทุนในการเสนอขายตราสารดังกล่าวในเรื่องดังนี้
- (ก) กรณีเป็นตราสารเพื่ออนุรักษ์สิ่งแวดล้อมหรือตราสารเพื่อความยั่งยืนต้องมีการเปิดเผยวัตถุประสงค์การใช้เงินที่ได้จากการระดมทุน (use of proceeds) ว่าเป็นไปเพื่อโครงการที่เกี่ยวข้องกับการอนุรักษ์สิ่งแวดล้อมหรือโครงการที่เกี่ยวข้องกับความยั่งยืนของประเทศไทย แล้วแต่กรณี
- (ข) กรณีเป็นตราสารส่งเสริมความยั่งยืนต้องมีการเปิดเผยข้อมูลเกี่ยวกับการกำหนดตัวชี้วัดและเป้าหมายด้านความยั่งยืนเพื่อส่งเสริมความยั่งยืนของผู้ออกตราสารดังกล่าวในประเทศไทย

#### 1.4 การอ้างอิงดัชนีชี้วัดที่สอดคล้องกับความยั่งยืน

ดัชนีชี้วัดของกองทุน ประกอบด้วย

- (1) SETESG Total return Index ร้อยละ 30
- (2) ThaiBMA Government Bond ESG Index Net Total Return ร้อยละ 50
- (3) ThaiBMA Short-term Government Bond Index Total Return ร้อยละ 20

หมายเหตุ :

- ดัชนีผลตอบแทนรวม SETESG Index (SETESG TRI) เนื่องจากกองทุนมีวัตถุประสงค์ลงทุนในหุ้นที่เป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET) บนกระดานหลัก หรือกระดานเอ็มเอไอ (mai) ที่ได้รับการคัดเลือกจาก SET ว่ามีความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน (Environmental, Social and Governance: ESG) ที่เป็นองค์ประกอบของดัชนีผลตอบแทนรวม SETESG Index (SETESG TRI) ทั้งนี้ ดัชนี SETESG เป็นดัชนีที่มีองค์ประกอบของบริษัทที่มีผลการประเมิน SET ESG Ratings ปีล่าสุดซึ่งจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์และเป็นหลักทรัพย์ที่มีการซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ไม่น้อยกว่า 6 เดือนและมีมูลค่าหลักทรัพย์ตามราคาตลาดไม่น้อยกว่า 5,000 ล้านบาท และมีสัดส่วนผู้ถือหลักทรัพย์รายย่อย (Free-Float) ไม่น้อยกว่าร้อยละ 20 ของทุนจดทะเบียนชำระแล้ว และมีจำนวนหุ้นซื้อขายไม่น้อยกว่าร้อยละ 0.5 ของจำนวนหุ้นจดทะเบียนของบริษัท เป็นเวลาไม่ต่ำกว่า 9 ใน 12 เดือน จึงเป็นดัชนีที่เหมาะสมภายใต้กรอบการลงทุนด้านความยั่งยืนของกองทุน อีกทั้งบริษัทที่เป็นองค์ประกอบของดัชนี SETESG เป็นบริษัทที่มีสภาพคล่องตามหลักเกณฑ์ที่ SET กำหนด และมีการเปิดเผยข้อมูลเพื่อนำไปใช้ในการวิเคราะห์ได้อย่างเพียงพอ

ผู้ลงทุนสามารถศึกษาคุณลักษณะและองค์ประกอบของดัชนี รวมถึงวิธีการจัดทำดัชนีดังกล่าวได้ที่ <https://www.set.or.th/th/market/index/setesg/profile>

- ดัชนี ThaiBMA Government Bond ESG Index Net Total Return เนื่องจากเป็นดัชนีที่รวมตราสารหนี้ ESG ที่ออกโดยภาครัฐที่ขึ้นทะเบียนกับสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย (ThaiBMA) เป็นองค์ประกอบ จึงเป็นดัชนีที่เหมาะสมและสอดคล้องกับวัตถุประสงค์และเป้าหมายด้านความยั่งยืนของกองทุน

ผู้ลงทุนสามารถศึกษาคุณลักษณะและองค์ประกอบของดัชนี รวมถึงวิธีการจัดทำดัชนีดังกล่าวได้ที่สมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย หรือ

<https://www.thaibma.or.th/pdf/Article/esgBondIndex.pdf>

- ดัชนี ThaiBMA Short-term Government Bond Index Total Return เนื่องจากเป็นดัชนีที่รวมตราสารหนี้ประเภทพันธบัตรรัฐบาลระยะสั้นที่ออกโดยกระทรวงการคลังและธนาคารแห่งประเทศไทย จึงเป็นดัชนีที่สะท้อนการลงทุนเพื่อเพิ่มโอกาสในการสร้างผลตอบแทนของกองทุน

ผู้ลงทุนสามารถศึกษาคุณลักษณะและองค์ประกอบของดัชนี รวมถึงวิธีการจัดทำดัชนีดังกล่าวได้ที่สมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย หรือ

[https://www.thaibma.or.th/pdf/remark\\_ThaiBMA/ShorttermGovernmentBondIndex.pdf](https://www.thaibma.or.th/pdf/remark_ThaiBMA/ShorttermGovernmentBondIndex.pdf)