

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน อเบอร์ดีน (ประเทศไทย) จำกัด

ข้อมูล ณ วันที่ 2 พฤษภาคม 2568



กองทุนเปิด อเบอร์ดีน ออล ซีซั่นส์ ไทยเพื่อความยั่งยืนแบบพิเศษ

หน่วยลงทุนชนิดเงินลงทุนใหม่ 2568

ABALL-TESGX1

ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมผสม, กองทุนรวมไทยเพื่อความยั่งยืนแบบพิเศษ (Thai ESGX), กองทุนรวมเพื่อความยั่งยืน (SRI Fund), กองทุนที่ลงทุนแบบมีความเสี่ยงทั้งในและต่างประเทศ
- กลุ่ม Aggressive Allocation

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- กองทุนจะลงทุนโดยมี net exposure ในทรัพย์สินดังต่อไปนี้ ทั้งนี้โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่า 80 % ของ NAV
 - (1) หุ้นที่เป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET) และ/หรือตลาดหลักทรัพย์ เอ็ม เอ ไอ (mai) ที่มีลักษณะดังนี้
 - (1.1) หุ้นของบริษัทจดทะเบียนที่ได้รับการคัดเลือกจาก SET ว่ามีความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน (ESG) และ/หรือ
 - (1.2) หุ้นของบริษัทจดทะเบียนที่มีการเปิดเผยข้อมูลเกี่ยวกับการปล่อยก๊าซเรือนกระจก แผนการจัดการ และการตั้งเป้าหมายเพื่อให้บรรลุเป้าหมายในการลดปริมาณการปล่อยก๊าซเรือนกระจกของประเทศไทย และ/หรือ
 - (1.3) หุ้นของบริษัทจดทะเบียนที่มีธรรมาภิบาล (Governance) ที่มีลักษณะเป็นไปตามประกาศและ
 - (2) พันธบัตรรัฐบาล พันธบัตรหรือหุ้นกู้ที่กระทรวงการคลังกำกับต้นเงินและดอกเบี้ยแต่ไม่รวมถึงหุ้นกู้แปลงสภาพ และ/หรือตราสารหนี้อื่นๆ โดยพันธบัตร หุ้นกู้ หรือตราสารหนี้ดังกล่าวต้องเป็นตราสารเพื่ออนุรักษ์สิ่งแวดล้อม (green bond) เพื่อความยั่งยืน (sustainability bond) หรือเพื่อส่งเสริมความยั่งยืน (sustainability - linked bond) ที่มีการเปิดเผยข้อมูลตามที่สำนักงาน ก.ล.ต. กำหนด
- ทั้งนี้ กองทุนจะลงทุนโดยมี net exposure ในทรัพย์สินตาม (1) โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่า 65 % ของ NAV (สามารถดูรายละเอียดเพิ่มเติมได้ที่หน้า 3)
- ผู้จัดการกองทุนจะคำนึงถึงความเสี่ยงและผลตอบแทนที่คาดว่าจะได้รับตามความเหมาะสมของภาวะตลาดหรือการลงทุนในแต่ละขณะ โดยจะมีการประเมินสภาวะการลงทุน และสภาวะเศรษฐกิจ (economic cycle) และจะปรับเปลี่ยนพอร์ตการลงทุนให้เหมาะสมกับสภาวะดังกล่าว
- กองทุนอาจลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมซึ่งอยู่ภายใต้การจัดการของบริษัทจัดการในสัดส่วนไม่เกิน 20 % ของ NAV
- กลยุทธ์การลงทุนมุ่งหวังให้ผลประกอบการสูงกว่าดัชนีชี้วัด (active management)

ระดับความเสี่ยง

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

ความเสี่ยง (Risk profile)

คำอธิบาย

ลงทุนในตราสารทุน ตราสารหนี้ และ/หรือทรัพย์สินทางเลือก โดยมีสัดส่วนการลงทุนในตราสารทุนน้อยกว่า 80% ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน: 13 พฤษภาคม 2568

วันเริ่มต้น class: 13 พฤษภาคม 2568

นโยบายการจ่ายเงินปันผล: ไม่จ่าย

อายุกองทุน:

ผู้จัดการกองทุนรวม

ดร.ณรัตน์ ภิชัยดิษฐ์ชัย

พงศ์ธาริน ทรัพย์นานนท์

ดัชนีชี้วัด :

1. SET ESG Total Return Index ในสัดส่วน 65.00%
2. ThaiBMA Government Bond ESG Index Net Total Return ในสัดส่วน 35.00%

อ้างอิงดัชนีชี้วัดเพื่อใช้เปรียบเทียบผลการดำเนินงานของกองทุน โดยบริษัทจัดการจะมีการพิจารณาความเหมาะสมของน้ำหนักองค์ประกอบทุกปี

คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวมมิได้เป็นที่ยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต: มีบริษัทแม่ดูแลให้ปฏิบัติตามกฎหมาย
จัดอันดับกองทุน Morningstar

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือ
บริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่อง
ได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



<https://www.aberdeeninvestments.com/th-th>

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (%ต่อปี)

ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด (%ต่อปี)

การซื้อขายหน่วยลงทุน

วันทำการซื้อ : ทุกวันทำการ

ช่วง IPO 2 - 9 พ.ค. 68

หลัง IPO 14 พ.ค. – 30 มิ.ย. 68

เวลาทำการ : 9.30-15.30 น.

การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ* : 1,000 บาท

การซื้อครั้งถัดไปขั้นต่ำ* : 1,000 บาท

การขายคืนหน่วยลงทุนอาจส่งผลให้ผู้ลงทุนต้องชำระคืนสิทธิประโยชน์ทางภาษี ดังนั้น ผู้ลงทุนมีหน้าที่ต้องศึกษาและปฏิบัติตามข้อกำหนดในกฎหมายภาษีอากร ทั้งนี้ สำหรับผู้ลงทุนที่จะได้สิทธิประโยชน์ทางภาษี จะต้องถือหน่วยลงทุนครบระยะเวลาที่กฎหมายภาษีกำหนด ณ วันที่ขายคืนหน่วยลงทุน

การขายคืนหน่วยลงทุน

วันทำการขายคืน : ทุกวันทำการ

เวลาทำการ : 9.30-13.00 น.

การขายคืนขั้นต่ำ : ไม่กำหนด

หน่วยลงทุนคงเหลือขั้นต่ำ : 100 หน่วย

ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน : T+2 (2 วันทำการหลังจากทำรายการขายคืน)

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV รวม VAT)		
ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	1.605	1.605
รวมค่าใช้จ่าย	2.675	

บริษัทจัดการสงวนสิทธิที่จะเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมดังกล่าวหากหน่วยงานที่เกี่ยวข้องมีการเปลี่ยนแปลงอัตราภาษีมูลค่าเพิ่มหรือภาษีอื่นใดทำนองเดียวกัน เพื่อให้สอดคล้องกับการเปลี่ยนแปลงดังกล่าว

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าหน่วยลงทุน รวม VAT)		
ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การขาย	ไม่มี	ไม่มี
การรับซื้อคืน	2.00	ไม่เก็บ เว้นแต่สับเปลี่ยนไป บลจ. อื่น คิด 1.00
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า	ไม่มี	ไม่มี
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก	1,000 บาท ต่อรายการ	โปรดดูหมายเหตุ
การโอนหน่วย	ไม่มี	ไม่มี

หมายเหตุ

อัตราเรียกเก็บจริงกรณีสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก

- กรณีสับเปลี่ยนภายในบริษัทจัดการ ไม่เก็บค่าธรรมเนียมสับเปลี่ยนออก และค่าธรรมเนียมรับซื้อคืน
- กรณีสับเปลี่ยนไปบริษัทจัดการอื่น ไม่เก็บค่าธรรมเนียมสับเปลี่ยนออก แต่จะมีการเรียกเก็บค่าธรรมเนียมการรับซื้อคืนในอัตรา 1.00% ของมูลค่าหน่วยลงทุนของวันทำการล่าสุดก่อนหน้าวันทำการสับเปลี่ยนหน่วยลงทุน โดยจะเรียกเก็บจากผู้ถือหน่วยลงทุนโดยตรงเมื่อผู้ถือหน่วยลงทุนยื่นคำสั่งสับเปลี่ยนหน่วยลงทุน

ปัจจุบันบริษัทจัดการยังไม่เปิดให้บริการสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนระหว่างบริษัทจัดการ

ค่าปรับกรณีขายคืนหน่วยลงทุนก่อนระยะเวลาถือครองที่กำหนด (Exit Fee) : กรณีที่ขายคืนหน่วยลงทุนก่อนครบกำหนด 180 วัน และบริษัทจัดการเห็นว่ามีการซื้อขายกองทุนในลักษณะที่มีความถี่เกินความเหมาะสม คิดในอัตราไม่เกิน 3 % ของมูลค่าหน่วยลงทุนของวันทำการก่อนหน้าวันทำการซื้อขาย

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน

ทรัพย์สินที่กองทุนหลักลงทุน

5 อันดับแรก

ABALL-TESGX1

ข้อมูลเชิงสถิติ

Maximum Drawdown

Recovering Period

FX Hedging

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน

การจัดสรรการลงทุนในต่างประเทศ

การจัดสรรการลงทุนในกลุ่ม

อุตสาหกรรม / ผู้ออกตราสาร

5 อันดับแรก

นโยบายการลงทุน :

กองทุนมีนโยบายการลงทุนโดยมี net exposure ในทรัพย์สินที่ออกโดยผู้ออกที่เป็นภาครัฐไทยหรือกิจการที่จัดตั้งขึ้นตามกฎหมายไทย ดังต่อไปนี้ โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน

1. หน้าที่เป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนใน SET บนกระดานหลัก หรือกระดาน mai ที่ได้รับการคัดเลือกจาก SET ว่ามีความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน ได้แก่ สิ่งแวดล้อม สังคม และธรรมาภิบาล (Environmental, Social and Governance: ESG) และ/หรือ
2. หน้าที่เป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนใน SET บนกระดานหลัก หรือกระดาน mai ที่มีการเปิดเผยข้อมูลเกี่ยวกับการปล่อยก๊าซเรือนกระจก แผนการจัดการ และการตั้งเป้าหมายเพื่อให้บรรลุเป้าหมายในการลดปริมาณการปล่อยก๊าซเรือนกระจกของประเทศไทย รวมทั้งจัดให้มีการทวนสอบการจัดทำคาร์บอนฟุตพริ้นท์ โดยผู้ทวนสอบที่สำนักงาน ก.ล.ต. ยอมรับ และ/หรือ
3. หน้าที่เป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนใน SET บนกระดานหลัก หรือกระดาน mai ที่มีลักษณะดังนี้

(3.1) เป็นหุ้นของบริษัทจดทะเบียนที่มีธรรมาภิบาล (Governance) โดยได้รับการประเมินการกำกับดูแลกิจการบริษัทจดทะเบียน (Corporate Governance Report of Thai Listed Companies: CGR) จากสมาคมส่งเสริมสถาบันกรรมการบริษัทไทย ตั้งแต่ 90 คะแนนขึ้นไป หรือเทียบเท่า

(3.2) มีการเปิดเผยเป้าหมายและแผนในเรื่องดังนี้ และรายงานความคืบหน้าการปฏิบัติตามเป้าหมายหรือแผน ผ่านช่องทางของ SET ซึ่งจัดไว้สำหรับการเปิดเผยข้อมูลดังกล่าวโดยเฉพาะ

(3.2.1) การมีเป้าหมายและแผนธุรกิจที่เกี่ยวข้องกับการเพิ่มมูลค่าของกิจการ (corporate value up plan)

(3.2.2) การมีเป้าหมายและแผนการยกระดับการดำเนินงานในเรื่องใดเรื่องหนึ่ง ดังนี้ โดยต้องตั้งเป้าหมายเพื่อดำเนินการให้เป็นไปตามแผนการยกระดับดังกล่าวให้แล้วเสร็จภายใน 2 ปี นับแต่วันที่เปิดเผยเป้าหมายและแผนการยกระดับ

(1) แผนดำเนินการที่ชัดเจนเพื่อเข้ารับการประเมินจากผู้ประเมินผลการดำเนินงานด้านความยั่งยืนตามมาตรฐานสากลตามที่ประกาศการลงทุนของกองทุนกำหนด

(2) เป้าหมายและแผนดำเนินการเพื่อลดปริมาณการปล่อยก๊าซเรือนกระจกของประเทศไทยตาม 2.

(3.3) มีการเพิ่มประสิทธิภาพการสื่อสารกับผู้ลงทุนตามที่ SET กำหนด และ

4. ตราสารเพื่ออนุรักษ์สิ่งแวดล้อม (green bond) ตราสารเพื่อความยั่งยืน (sustainability bond) หรือตราสารส่งเสริมความยั่งยืน (sustainability - linked bond) ที่ออกตามประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุนว่าด้วยการขออนุญาตและการอนุญาตให้เสนอขายตราสารหนี้ที่ออกใหม่ต่อประชาชนเป็นการทั่วไป ประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุนว่าด้วยการขออนุญาตและการอนุญาตให้เสนอขายตราสารหนี้ที่ออกใหม่ต่อบุคคลในวงจำกัด และการเสนอขายหุ้นกู้แปลงสภาพต่อบุคคลที่มีลักษณะเฉพาะ หรือประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุนว่าด้วยข้อกำหนดที่เกี่ยวกับการออกและเสนอขายศุภก และการเปิดเผยข้อมูล แล้วแต่กรณี ซึ่งมีการเปิดเผยข้อมูลในแบบแสดงรายการข้อมูลการเสนอขายตราสารหรือเอกสารที่นำเสนอต่อผู้ลงทุนในการเสนอขายตราสารดังกล่าวในเรื่องดังนี้

(4.1) กรณีเป็นตราสารเพื่ออนุรักษ์สิ่งแวดล้อมหรือตราสารเพื่อความยั่งยืน ต้องมีการเปิดเผยวัตถุประสงค์การใช้เงินที่ได้จากการระดมทุน (use of proceeds) ว่าเป็นไปเพื่อโครงการที่เกี่ยวข้องกับการอนุรักษ์สิ่งแวดล้อมหรือเพื่อโครงการที่เกี่ยวข้องกับความยั่งยืนของประเทศไทย แล้วแต่กรณี

(4.2) กรณีเป็นตราสารส่งเสริมความยั่งยืนต้องมีการเปิดเผยข้อมูลเกี่ยวกับการกำหนดตัวชี้วัดและเป้าหมายด้านความยั่งยืนเพื่อส่งเสริมความยั่งยืนของผู้ออกตราสารดังกล่าวในประเทศไทย และ/หรือ

5. พันธบัตรรัฐบาล พันธบัตรที่กระทรวงการคลังค้ำประกันต้นเงินและดอกเบี้ย หรือหุ้นกู้ที่กระทรวงการคลังค้ำประกันต้นเงินและดอกเบี้ยแต่ไม่รวมถึงหุ้นกู้แปลงสภาพ ซึ่งเป็นพันธบัตรหรือหุ้นกู้เพื่ออนุรักษ์สิ่งแวดล้อม (green bond) พันธบัตรหรือหุ้นกู้เพื่อความยั่งยืน (sustainability bond) หรือพันธบัตรหรือหุ้นกู้ส่งเสริมความยั่งยืน (sustainability - linked bond)

ทั้งนี้ กองทุนจะลงทุนโดยมี net exposure ในทรัพย์สินตาม 1. - 3. ข้างต้น โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 65 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุนในการลงทุนเพื่อกองทุน ผู้จัดการกองทุนจะคำนึงถึงความเสี่ยงและผลตอบแทนที่คาดว่าจะได้รับตามความเหมาะสมของภาวะตลาดหรือการลงทุนในแต่ละขณะ โดยจะมีการประเมินสภาวะการลงทุน และสภาวะเศรษฐกิจ (economic cycle) และจะปรับเปลี่ยนพอร์ตการลงทุนของกองทุนให้เหมาะสมกับภาวะตลาดและตาม economic cycle ขณะนั้น ๆ ไม่ว่าจะเป็นการปรับสัดส่วนการลงทุนตามประเภทของตราสารที่ลงทุน (asset class) หรือการคัดเลือกตราสารที่จะลงทุนให้เหมาะสมกับ economic cycle

วัตถุประสงค์การลงทุนที่เกี่ยวกับความยั่งยืน :

กองทุนมีวัตถุประสงค์การลงทุนเพื่อสร้างผลตอบแทนรวมในระยะยาวภายใต้ความเสี่ยงที่ยอมรับได้ ผ่านการลงทุนในบริษัทที่มีปัจจัยพื้นฐานที่ดีและมีความยั่งยืนของธุรกิจในระยะยาว รวมถึงตราสารทั้งภาครัฐและเอกชนที่เป็นตราสารเพื่ออนุรักษ์สิ่งแวดล้อม เพื่อความยั่งยืน หรือส่งเสริมความยั่งยืน โดยกองทุนได้นำปัจจัยด้านสิ่งแวดล้อม สังคม และธรรมาภิบาล (Environmental, Social and Governance: ESG) เข้ามาในกระบวนการลงทุน เพื่อวิเคราะห์การจัดการด้านความเสี่ยงและโอกาสจากปัจจัยด้าน ESG นอกจากนี้ กองทุนยังมีวัตถุประสงค์ในการมีส่วนร่วมสนับสนุนการดำเนินธุรกิจของบริษัทที่ให้ความสำคัญกับ ESG โดยมีการนำเอาแนวคิดด้านความยั่งยืนเข้ามาเป็นส่วนหนึ่งในกระบวนการดำเนินธุรกิจด้วย

เป้าหมายด้านความยั่งยืนที่ต้องการบรรลุของกองทุน :

เพื่อสนับสนุนบริษัทจดทะเบียนที่มีการดำเนินงานโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน (Environmental Social and Governance: ESG) บริษัทจดทะเบียนที่มีการเปิดเผยข้อมูลเกี่ยวกับการปล่อยก๊าซเรือนกระจก แผนการจัดการ และการตั้งเป้าหมายเพื่อให้บรรลุเป้าหมายในการลดปริมาณการปล่อยก๊าซเรือนกระจกของประเทศไทย รวมถึงบริษัทจดทะเบียนที่มีการกำกับดูแลกิจการในระดับดีเลิศที่มีการเปิดเผยแผนการเพิ่มมูลค่ากิจการ รวมถึงเป้าหมายและแผนการยกระดับการดำเนินงานด้านสิ่งแวดล้อมให้แล้วเสร็จภายใน 2 ปี รวมถึงผู้ออกตราสารทั้งภาครัฐและเอกชนที่เสนอขายตราสารเพื่ออนุรักษ์สิ่งแวดล้อม (green bond) และ/หรือตราสารเพื่อความยั่งยืน (sustainability bond) และ/หรือตราสารส่งเสริมความยั่งยืน (sustainability - linked bond) เพื่อสร้างผลตอบแทนผ่านการลงทุนที่เกี่ยวข้องกับความยั่งยืนให้ผู้ลงทุน รวมทั้งส่งเสริมให้มีการดำเนินงานที่คำนึงถึงปัจจัยด้าน ESG มากขึ้น ส่งผลให้เกิดระบบนิเวศที่ยั่งยืนต่อระบบเศรษฐกิจไทยและสังคมโดยรวม และเป็นกลไกหนึ่งที่จะช่วยสนับสนุนประเทศไทยบรรลุเป้าหมายการพัฒนาที่ยั่งยืน (Sustainable Development Goals : SDGs) ขององค์การสหประชาชาติ ทั้งนี้ ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเป้าหมายการพัฒนาที่ยั่งยืนขององค์การสหประชาชาติเพิ่มเติมได้ที่ <https://sdgs.un.org/goals> หรือ [THE 17 GOALS | Sustainable Development](#)

กรอบการลงทุน :

- ลงทุนในหุ้นของบริษัทจดทะเบียนใน SET และ/หรือ mai ดังนี้ ทั้งนี้ โดยมี net exposure โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 65 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน
 - (1) หุ้นของบริษัทจดทะเบียนที่มีความโดดเด่นในการบริหารจัดการด้าน E หรือ ESG และ/หรือ
 - (2) หุ้นของบริษัทจดทะเบียนที่มีการเปิดเผยข้อมูลเกี่ยวกับการปล่อยก๊าซเรือนกระจก แผนการจัดการ และการตั้งเป้าหมายเพื่อให้บรรลุเป้าหมายในการลดปริมาณการปล่อยก๊าซเรือนกระจกของประเทศไทย รวมทั้งจัดให้มีการทวนสอบการจัดทำคาร์บอนฟุตพริ้นท์ โดยผู้ทวนสอบที่สำนักงาน ก.ล.ต. ยอมรับ และ/หรือ
 - (3) หุ้นของบริษัทจดทะเบียนที่มี Governance ที่มีการเปิดเผยแผนการเพิ่มมูลค่ากิจการ รวมถึงเป้าหมายและแผนการยกระดับการดำเนินงานด้านสิ่งแวดล้อมให้แล้วเสร็จภายใน 2 ปี
- ลงทุนในตราสารอย่างใดอย่างหนึ่งหรือหลายอย่าง ดังนี้
 - (1) ตราสาร green bond sustainability bond หรือ sustainability - linked bond ที่มีลักษณะตามที่สำนักงาน ก.ล.ต. กำหนด ซึ่งได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถืออยู่ในอันดับที่สามารถลงทุนได้ (Investment Grade) และ/หรือ
 - (2) พันธบัตรรัฐบาล พันธบัตรที่กระทรวงการคลังค้ำประกันต้นเงินและดอกเบี้ย หรือหุ้นกู้ที่กระทรวงการคลังค้ำประกันต้นเงินและดอกเบี้ย แต่ไม่รวมถึงหุ้นกู้แปลงสภาพ ซึ่งเป็นพันธบัตรหรือหุ้นกู้ green bond พันธบัตรหรือหุ้นกู้ sustainability bond หรือพันธบัตรหรือหุ้นกู้ sustainability - linked bond

การอ้างอิงดัชนีชี้วัดที่สอดคล้องกับความยั่งยืน :

ดัชนีชี้วัด (Benchmark) ของกองทุน คือ

- (1) ดัชนีผลตอบแทนรวม SETESG (SET ESG Total Return Index : SETESG TRI) ในสัดส่วนร้อยละ 65.00
- (2) ผลตอบแทนรวมสุทธิของดัชนีพันธบัตรรัฐบาล ESG ของสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย (ThaiBMA Government Bond ESG Index Net Total Return)

ในสัดส่วนร้อยละ 35.00

วัตถุประสงค์ในการอ้างอิงดัชนีชี้วัด เพื่อใช้เปรียบเทียบผลการดำเนินงานของกองทุน โดยบริษัทจัดการจะมีการพิจารณาความเหมาะสมของน้ำหนักองค์ประกอบทุกปีหมายเหตุ

- SETESG TRI เป็นดัชนีที่สะท้อนการเคลื่อนไหวของราคากลุ่มหลักทรัพย์ของบริษัทที่มีผลประเมินหุ้นยั่งยืน SET ESG Ratings ชุดล่าสุดที่ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยมีการประกาศให้ทราบโดยทั่วไป และเป็นหลักทรัพย์ที่มีมูลค่าหลักทรัพย์ตามราคาตลาด (Market Capitalization) เฉลี่ยอย่างน้อย 5,000 ล้านบาท โดยหลักทรัพย์ดังกล่าวต้องผ่านเกณฑ์คุณสมบัติด้านสภาพคล่องด้วย ซึ่งพิจารณาจากปริมาณหุ้นที่มีการซื้อขายในสภาพปกติของตลาดในแต่ละเดือน ในช่วงเวลา 12 เดือนย้อนหลังตามรอบทบทวน ซึ่งจะต้องผ่านเกณฑ์ไม่น้อยกว่า 3 ใน 4 ของจำนวนเดือนที่หลักทรัพย์เข้าซื้อขายตามรอบทบทวน ทั้งนี้ หลักทรัพย์ที่ผ่านการคัดเลือกต้องมีปริมาณหุ้นซื้อขายในแต่ละเดือนไม่น้อยกว่าร้อยละ 0.5 ของจำนวนหุ้นจดทะเบียนของหลักทรัพย์นั้นๆ และไม่เข้าข่ายมาตรการกักการซื้อขายหลักทรัพย์ ทั้งนี้ ผู้ลงทุนสามารถศึกษาวิธีการจัดทำดัชนี (Index Methodology) ได้ที่ <https://www.set.or.th/th/market/index/setesg/profile>

- ThaiBMA Government Bond ESG Index Net Total Return เป็นดัชนีที่สะท้อนการเคลื่อนไหวของราคาของตราสารหนี้ ESG ที่ออกโดยภาครัฐที่ขึ้นทะเบียนกับสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย ทั้งนี้ ผู้ลงทุนสามารถศึกษาวิธีการจัดทำดัชนี (Index Methodology) ได้ที่

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

- บริษัทจัดการขอสงวนสิทธิ์ที่จะเปลี่ยนแปลงดัชนีชี้วัดในการเปรียบเทียบตามที่บริษัทจัดการเห็นควรและเหมาะสม ซึ่งอยู่ภายใต้กรอบนโยบายการลงทุนที่กำหนด โดยบริษัทจัดการจะเปิดเผยข้อมูลและแจ้งให้ผู้ลงทุนทราบล่วงหน้าอย่างชัดเจนถึงวันที่มีการปรับปรุง/เปลี่ยนแปลงตัวชี้วัด คำอธิบายเกี่ยวกับตัวชี้วัด และเหตุผลในการปรับปรุง/เปลี่ยนแปลงตัวชี้วัดดังกล่าวผ่านการลงประกาศในเว็บไซต์ของบริษัทจัดการภายในเวลาที่ผู้ลงทุนสามารถไปประโยชน์จากข้อมูลในการตัดสินใจลงทุนได้
- บริษัทจัดการจะเปลี่ยนแปลงดัชนีชี้วัดของกองทุนตามข้างต้นที่จัดทำโดยตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยเมื่อตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยมีการจัดทำดัชนี TRI ที่นำสัดส่วนผู้ถือหลักทรัพย์รายย่อยของแต่ละหลักทรัพย์ (free float) มาถ่วงน้ำหนักในการคำนวณดัชนี (ดัชนี free float TRI) เพื่อให้เป็นไปตามหลักเกณฑ์ที่คณะกรรมการกำกับตลาดทุนประกาศกำหนด

คำอธิบาย

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

Recovering Period ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาดังแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลานานเท่าใด

FX Hedging เพอร์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตกองทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลาหนึ่ง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์กับผลรวมของมูลค่าการขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 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 แสดงว่าหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนน้อยกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด Beta มากกว่า 1 แสดงว่า หลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนมากกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด