



กองทุนเปิดเค ตราสารภาครัฐ ESG ชนิดไทยเพื่อความยั่งยืน

K-ESGSI-ThaiESG

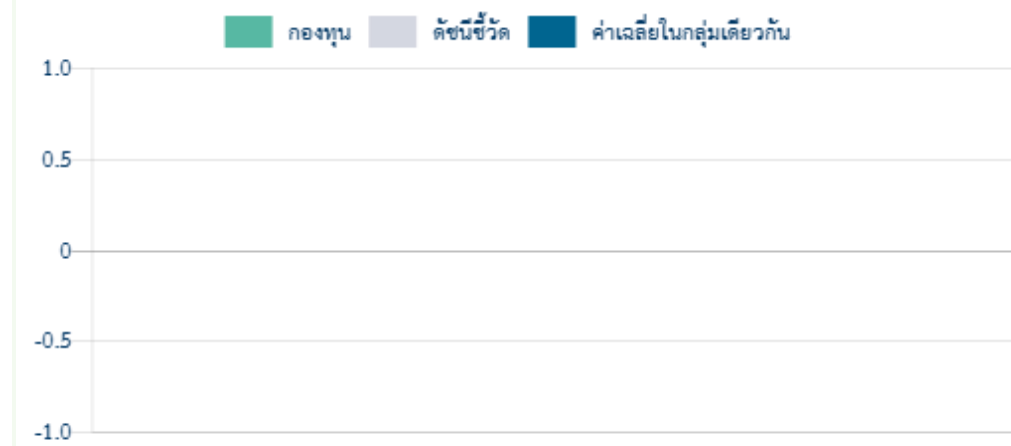
ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมตราสารหนี้ / กองทุนรวมไทยเพื่อความยั่งยืน / กองทุนรวมเพื่อความยั่งยืน (SRI Fund)
- กลุ่ม Long Term General Bond

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- กองทุนจะลงทุนในพันธบัตรรัฐบาล พันธบัตรที่กระทรวงการคลังค้าประกันต้นเงินและดอกเบี้ย หรือหุ้นกู้ที่กระทรวงการคลังค้าประกันต้นเงินและดอกเบี้ยแต่ไม่รวมถึงหุ้นกู้แปลงสภาพ ซึ่งเป็นพันธบัตรหรือหุ้นกู้เพื่ออนุรักษ์สิ่งแวดล้อม (green bond) พันธบัตรหรือหุ้นกู้เพื่อความยั่งยืน (sustainability bond) หรือพันธบัตรหรือหุ้นกู้ส่งเสริมความยั่งยืน (sustainability – linked bond) โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV
- กองทุนอาจลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมตราสารหนี้อื่นซึ่งอยู่ภายใต้การบริหารจัดการของบริษัทจัดการเดียวกันได้ โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่เกิน 20% ของ NAV และกองทุนรวมตราสารหนี้อื่นนั้นมีการลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งหน่วยลงทุนของกองทุนรวมใดๆ ที่บริษัทจัดการเดียวกันเป็นผู้รับผิดชอบในการดำเนินการต่อไปได้อีกไม่เกิน 1 หอด
- กองทุนอาจลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเพื่อการเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน (Efficient Portfolio Management) และตราสารที่มีสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแฝง (Structured Notes)
- กองทุนอาจลงทุนในตราสารต่างประเทศได้ไม่เกิน 20% ของ NAV โดยจะป้องกันความเสี่ยงด้านอัตราแลกเปลี่ยนทั้งหมดหรือเกือบทั้งหมด
- มุ่งหวังให้ผลประกอบการเคลื่อนไหวสูงกว่าดัชนีชี้วัด (active management)

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (% ต่อปี)



ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปีหมุน (%)

| | YTD | 3 เดือน | 6 เดือน | 1 ปี * |
|--------------------------|-----|---------|---------|--------|
| กองทุน | N/A | N/A | N/A | N/A |
| ดัชนีชี้วัด | 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 | N/A | N/A | N/A | N/A |

| | 3 ปี * | 5 ปี * | 10 ปี * | ตั้งแต่จัดตั้ง * |
|--------------------------|--------|--------|---------|------------------|
| กองทุน | N/A | N/A | N/A | 1.92 |
| ดัชนีชี้วัด | N/A | N/A | N/A | 2.01 |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน | N/A | N/A | N/A | N/A |
| ความผันผวนกองทุน | N/A | N/A | N/A | 3.46 |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด | N/A | N/A | N/A | 2.85 |

หมายเหตุ : * % ต่อปี

ระดับความเสี่ยง

ต่ำ 1 2 3 4 5 6 7 8 สูง

ความเสี่ยงปานกลางค่อนข้างต่ำ

ลงทุนในตราสารภาครัฐไทย โดยเฉลี่ยในรอบปีไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม

| | |
|------------------------|-----------|
| วันจดทะเบียนกองทุน | 3 ก.ค. 67 |
| วันเริ่มต้น class | 3 ก.ค. 67 |
| นโยบายการจ่ายเงินปันผล | ไม่จ่าย |
| อายุกองทุน | ไม่กำหนด |

ผู้จัดการกองทุนรวม

นาง สลิลสิริ เรืองสุขอุดม (ตั้งแต่ 3 ก.ค. 67)

ดัชนีชี้วัด :

1. ผลตอบแทนรวมสุทธิของดัชนีพันธบัตรรัฐบาล ESG ของสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย (80.00%)
 2. ผลตอบแทนรวมสุทธิของดัชนีพันธบัตรรัฐบาลอายุไม่เกิน 1 ปีของสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย (20.00%)
- วัตถุประสงค์ในการอ้างอิงดัชนีชี้วัด : เพื่อใช้เป็นตัวแทนองค์ประกอบของพอร์ตโฟลิโอและเปรียบเทียบผลการดำเนินงานของกองทุน

คำเตือน:

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวม มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต : ได้รับการรับรองจาก CAC

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

ผู้ลงทุนสามารถศึกษา
เครื่องมือบริหารความเสี่ยง
ด้านสภาพคล่องได้ใน
หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



www.kasikornasset.com

การซื้อขายหน่วยลงทุน

วันทำการซื้อ : ทุกวันทำการ

เวลาทำการ : 08:30 น. - 15:30 น.

การซื้อขายครั้งแรกขั้นต่ำ : 500 บาท

การซื้อขายครั้งถัดไปขั้นต่ำ : 500 บาท

การขายคืนหน่วยลงทุน

วันทำการขายคืน : ทุกวันทำการ

เวลาทำการ : 08:30 น. - 15:30 น.

การขายคืนขั้นต่ำ : ไม่กำหนด

ยอดคงเหลือขั้นต่ำ : ไม่กำหนด

ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน : T+2

(ประกาศ NAV T+1 คืนเงิน T+2 เวลา 15.00 น. เป็นต้นไป)

หมายเหตุ : บริษัทจัดการจะชำระเงินค่าขายคืนหน่วยลงทุนให้แก่ผู้ขายคืนหน่วยลงทุนภายใน 5 วันทำการนับแต่วันทำการขายคืนหน่วยลงทุน (ปัจจุบัน คืนเงิน T+2)

ข้อมูลเชิงสถิติ

| | |
|----------------------------|------------------------------|
| Maximum Drawdown | -0.91 % |
| Recovering Period | 0.26 เดือน |
| FX Hedging | ยังไม่มีการลงทุนในต่างประเทศ |
| อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน | N/A |
| อายุเฉลี่ยของตราสารหนี้ | 9 ปี 4.08 เดือน |
| Yield to Maturity | 2.80% ต่อปี |

การจัดสรรการลงทุนในต่างประเทศ

| ประเทศ | % NAV |
|--------|--------|
| ไทย | 100.00 |

การจัดสรรการลงทุนในผู้ออกตราสาร 5 อันดับแรก

| ผู้ออก | % NAV |
|-------------------------|-------|
| กระทรวงการคลัง | 90.37 |
| ธ.แห่งประเทศไทย | 14.35 |
| บมจ.ธนาคารทหารไทยชนชาติ | 6.23 |

การจัดสรรการลงทุนตามอันดับความน่าเชื่อถือ (%)

| | ในประเทศ | National | International |
|--------------|----------|----------|---------------|
| Gov Bond/AAA | 104.73 | | |
| AA | 6.23 | | |

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)

| ค่าธรรมเนียม | สูงสุดไม่เกิน | เก็บจริง |
|---------------|---------------|----------|
| การจัดการ | 1.0700 | 0.2140 |
| รวมค่าใช้จ่าย | 2.3540 | 0.2729 |

หมายเหตุ : ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะ หรือภาษีอื่นใดแล้ว

• บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริง เพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ

• หากกองทุนลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมอื่นซึ่งอยู่ภายใต้การบริหารจัดการของบริษัทจัดการเดียวกัน (กองทุนปลายทาง) บริษัทจัดการจะไม่คิดค่าธรรมเนียมการจัดการซ้ำซ้อนกับกองทุนรวมปลายทาง รวมถึงกรณีที่กองทุนรวมปลายทางอาจลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมใดๆ ของบริษัทจัดการอีกทอดหนึ่ง บริษัทจัดการจะไม่เรียกเก็บค่าธรรมเนียมดังกล่าวซ้ำซ้อนด้วยเช่นกัน

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)

| ค่าธรรมเนียม | สูงสุดไม่เกิน | เก็บจริง |
|-----------------------------|----------------|--------------|
| การขาย | 1.00 | ยกเว้น |
| การรับซื้อคืน | 1.00 | ยกเว้น |
| การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า | 3.00 | ยกเว้น |
| การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก | 3.00 | ยกเว้น |
| การโอนหน่วย | ตามที่เก็บจริง | ไม่เรียกเก็บ |

หมายเหตุ : ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะ หรือภาษีอื่นใดแล้ว

• บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริง เพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ

• หากกองทุนลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมอื่นซึ่งอยู่ภายใต้การบริหารจัดการของบริษัทจัดการเดียวกัน (กองทุนปลายทาง) บริษัทจัดการจะไม่คิดค่าธรรมเนียมการขายและรับซื้อคืนหน่วยลงทุนซ้ำซ้อนกับกองทุนปลายทาง รวมถึงกรณีที่กองทุนรวมปลายทางอาจลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมใดๆ ของบริษัทจัดการอีกทอดหนึ่ง บริษัทจัดการจะไม่เรียกเก็บค่าธรรมเนียมดังกล่าวซ้ำซ้อนด้วยเช่นกัน

• ค่าปรับกรณีขายคืนก่อนระยะเวลาถือครองที่กำหนด : กรณีถือครองต่ำกว่า 1 ปี ไม่เกิน 1.50% ของมูลค่าซื้อขาย (ปัจจุบัน ยกเว้น)

• ค่าธรรมเนียมการสับเปลี่ยนเข้า (Switching In) : อัตราเท่ากับค่าธรรมเนียมการรับซื้อคืนหน่วยลงทุนของกองทุนต้นทาง หรือค่าธรรมเนียมการขายหน่วยลงทุนของกองทุนปลายทางแล้วแต่อัตราใดจะสูงกว่า

• ค่าธรรมเนียมการสับเปลี่ยนออก (Switching Out) :

- สับเปลี่ยนไป Thai ESG ภายใน บลจ.กสิกรไทย : ยกเว้น

- สับเปลี่ยนไป Thai ESG บลจ.อื่น : 1.00% ของมูลค่าหน่วยลงทุนของวันทำการล่าสุดก่อนวันทำการสับเปลี่ยนหน่วยลงทุน

- สับเปลี่ยนไปกองทุนอื่นภายใต้ บลจ. กสิกรไทย : อัตราเท่ากับค่าธรรมเนียมการรับซื้อคืนหน่วยลงทุนของกองทุนต้นทาง หรือค่าธรรมเนียมการขายหน่วยลงทุนของกองทุนปลายทางแล้วแต่อัตราใดจะสูงกว่า

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน

| ประเภททรัพย์สิน | % NAV | ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก | % NAV |
|-----------------|--------|---------------------------------|-------|
| พันธบัตร | 104.73 | พันธบัตร (ESGLB376A) | 70.66 |
| เงินฝาก | 6.23 | พันธบัตร (ESGLB35DA) | 19.72 |
| อื่นๆ | -10.96 | พันธบัตร (CBF25714A) | 8.88 |
| | | เงินฝาก บมจ.ธนาคารทหารไทยชนชาติ | 6.23 |
| | | พันธบัตร (CBF24N04A) | 2.74 |

คำอธิบาย

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

Recovering Period ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาตั้งแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินลงทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลาสั้นเท่าใด

FX Hedging เปรอ์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตกองทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลาหนึ่ง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์กับผลรวมของมูลค่าการขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 1 ปีหารด้วยมูลค่า NAV ของกองทุนรวมเฉลี่ยในรอบระยะเวลาเดียวกัน กองทุนรวมที่มีค่าอัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุนสูง 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 ระดับและทิศทางของการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุน 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 โดยใช้ตัวอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมตราสารหนี้ คำนวณจากค่าเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักของ Yield to Maturity ของตราสารหนี้แต่ละตัวที่กองทุนมีการลงทุน และเนื่องจาก Yield to Maturity มีหน่วยมาตรฐานเป็นเปอร์เซ็นต์ต่อปี จึงสามารถนำไปใช้เปรียบเทียบอัตราผลตอบแทนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีนโยบายถือครองตราสารหนี้จนครบกำหนดอายุและมีลักษณะการลงทุนที่ใกล้เคียงกันได้

@ สงวนลิขสิทธิ์ 2024 บริษัท มอร์นิ่งสตาร์ รีเสิร์ช (ประเทศไทย) จำกัด ข้อมูลนี้ (1) เป็นกรรมสิทธิ์ของบริษัท มอร์นิ่งสตาร์ รีเสิร์ช (ประเทศไทย) จำกัด และ/หรือ ผู้ให้บริการข้อมูล (2) ขอสงวนสิทธิ์ในการลอกเลียน หรือเผยแพร่ (3) ขอสงวนสิทธิ์ที่จะไม่รับผิดชอบต่อความถูกต้อง ครบถ้วน และความเสียหายต่างๆ ที่เกิดขึ้นทุกกรณีจากการนำข้อมูลไปใช้อ้างอิง ผลการดำเนินงานในอดีตมิได้เป็นสิ่งยืนยันผลการดำเนินงานในอนาคต

หนังสือชี้ชวนส่วนสรุปข้อมูลสำคัญ



คู่มือการลงทุน Thai ESG



บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กสิกรไทย จำกัด
ที่อยู่ : 400/22 อาคารธนาคารกสิกรไทย ชั้น 6 และ 12 ถนนพหลโยธิน

แขวงสามเสนใน เขตพญาไท กรุงเทพฯ 10400

โทรศัพท์ : 0 - 2673 - 3888

website : www.kasikornasset.com

email : ka.customer@kasikornasset.com

ข้อมูลเพิ่มเติมของ กองทุนเปิดเค ตราสารภาครัฐ ESG ชนิดไทยเพื่อความยั่งยืน (K-ESGSI-ThaiESG)

นโยบายการลงทุน

กองทุนจะลงทุนในตราสารภาครัฐไทย อาทิ ตัวเงินคลัง พันธบัตรรัฐบาล พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย และหรือ พันธบัตร ตัวแลกเปลี่ยน ตัวสัญญาใช้เงิน หรือหุ้นกู้ ที่กระทรวงการคลังหรือกองทุนฟื้นฟูเป็นผู้มีภาระผูกพัน และหรือสัญญาซื้อขายล่วงหน้า รวมถึงตราสารภาครัฐต่างประเทศ รวมกันไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน

ทั้งนี้ กองทุนจะลงทุนในพันธบัตรรัฐบาล พันธบัตรที่กระทรวงการคลังค้ำประกันต้นเงินและดอกเบี้ย หรือหุ้นกู้ที่กระทรวงการคลังค้ำประกันต้นเงินและดอกเบี้ยแต่ไม่รวมถึงหุ้นกู้แปลงสภาพ ซึ่งเป็นพันธบัตรหรือหุ้นกู้เพื่ออนุรักษ์สิ่งแวดล้อม (green bond) พันธบัตรหรือหุ้นกู้เพื่อความยั่งยืน (sustainability bond) หรือพันธบัตรหรือหุ้นกู้ส่งเสริมความยั่งยืน (sustainability – linked bond) โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน โดยกองทุนอาจมีการลงทุนในทรัพย์สินอื่นใดที่นอกเหนือจากตราสารข้างต้นได้ โดยจะต้องไม่ทำให้กองทุนมี net exposure ในตราสารข้างต้น โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีน้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน

กองทุนจะลงทุนในตราสารหนี้ที่มีอันดับความน่าเชื่อถืออยู่ในอันดับที่สามารถลงทุนได้ (Investment Grade) อย่างไรก็ตาม กองทุนอาจมีไว้ซึ่งตราสารหนี้ที่มีอันดับความน่าเชื่อถือต่ำกว่าที่สามารถลงทุนได้ (Non – Investment grade) ได้ เฉพาะกรณีที่ตราสารหนี้นั้นได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถืออยู่ในอันดับที่สามารถลงทุนได้ (Investment grade) ขณะที่กองทุนลงทุนเท่านั้น

กองทุนอาจลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมตราสารหนี้อื่นซึ่งอยู่ภายใต้การบริหารจัดการของบริษัทจัดการเดียวกันได้ โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่เกินร้อยละ 20 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน และกองทุนรวมตราสารหนี้อื่นนั้นมีการลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งหน่วยลงทุนของกองทุนรวมใดๆ ที่บริษัทจัดการเดียวกันเป็นผู้รับผิดชอบในการดำเนินการต่อไปได้อีกไม่เกิน 1 ทอด

สำหรับการลงทุนส่วนที่เหลือ กองทุนอาจลงทุนในตราสารหนี้ เงินฝากหรือตราสารเทียบเท่าเงินฝาก หน่วย CIS สัญญาซื้อขายล่วงหน้า เพื่อการเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน (Efficient Portfolio Management) ตราสารที่มีสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแฝง (Structured Note) รวมทั้งหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินอื่นใดทั้งในและต่างประเทศ ตามหลักเกณฑ์ที่สำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ด. กำหนดให้กองทุนรวมตราสารหนี้ลงทุนได้ ทั้งนี้ สำหรับการลงทุนในต่างประเทศ กองทุนจะป้องกันความเสี่ยงด้านอัตราแลกเปลี่ยนทั้งหมดหรือเกือบทั้งหมด

สัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่กองทุนจะเข้าเป็นคู่สัญญา จะมีสินทรัพย์อ้างอิงอย่างใดอย่างหนึ่งหรือหลายอย่าง ได้แก่ ทรัพย์สินที่กองทุนสามารถลงทุนได้ อัตราดอกเบี้ย อัตราแลกเปลี่ยนเงิน เครดิต (Credit rating หรือ Credit event) หากราคาสินทรัพย์อ้างอิงมีความผันผวนมากหรือทิศทางการลงทุนไม่เป็นไปตามที่คาดการณ์ หรือคู่สัญญาที่ทำธุรกรรมไม่สามารถชำระภาระผูกพันได้ตามกำหนดเวลา อาจทำให้กองทุนขาดทุนจากการลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้าหรือตราสารที่มีสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแฝงได้ ทั้งนี้ บริษัทจัดการอาจพิจารณาปรับเปลี่ยนการลงทุนหรือการเข้าทำธุรกรรมให้เหมาะสมกับสถานการณ์ เพื่อให้เกิดประโยชน์สูงสุดต่อผู้ถือหน่วยลงทุนโดยรวม อย่างไรก็ตาม บริษัทจัดการจะวิเคราะห์และติดตามปัจจัยที่มีผลกระทบต่อราคาสินทรัพย์อ้างอิง รวมถึงพิจารณาความน่าเชื่อถือของ

คู่สัญญาก่อนทำธุรกรรมและติดตามอย่างต่อเนื่อง โดยกองทุนจะเน้นทำธุรกรรมกับคู่สัญญาที่มีอันดับความน่าเชื่อถืออยู่ในอันดับที่สามารถลงทุนได้ (Investment Grade)

นอกจากนี้ กองทุนอาจลงทุนในตราสารกึ่งหนี้กึ่งทุน ตราสาร Basel III และหรือสัญญาซื้อขายล่วงหน้า และหรือตราสารที่มีสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแฝงที่มี underlying เป็นตราสารดังกล่าว รวมกันไม่เกินร้อยละ 20 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน

วัตถุประสงค์การลงทุนที่เกี่ยวกับความยั่งยืน:

กองทุนมีวัตถุประสงค์ในการช่วยส่งเสริมการลงทุนเพื่อความยั่งยืนผ่านการลงทุนในพันธบัตรรัฐบาล พันธบัตรที่กระทรวงการคลังค้าประกันต้นเงินและดอกเบี้ย หรือหุ้นกู้ที่กระทรวงการคลังค้าประกันต้นเงินและดอกเบี้ยแต่ไม่รวมถึงหุ้นกู้แปลงสภาพ ซึ่งเป็นพันธบัตรหรือหุ้นกู้เพื่ออนุรักษ์สิ่งแวดล้อม (green bond) พันธบัตรหรือหุ้นกู้เพื่อความยั่งยืน (sustainability bond) หรือพันธบัตรหรือหุ้นกู้ส่งเสริมความยั่งยืน (sustainability – linked bond)

เป้าหมายด้านความยั่งยืนที่ต้องการบรรลุ:

เพื่อสนับสนุนตราสารภาครัฐเพื่อสิ่งแวดล้อม สังคม และธรรมาภิบาล (Environment, Social, and Governance Bond: ESG Bond) ที่มีการเปิดเผยวัตถุประสงค์ของการใช้เงินที่ได้จากการระดมทุน (use of proceeds) ไปสนับสนุนการดำเนินการด้านสิ่งแวดล้อมและสังคมของประเทศไทย ภายใต้กรอบการระดมทุนเพื่อความยั่งยืน (The Kingdom of Thailand’s Sustainable Financing Framework) เพื่อให้บรรลุเป้าหมายการควบคุมการเพิ่มขึ้นของอุณหภูมิโลกตามข้อตกลงปารีส (Paris Agreement) และการบรรลุเป้าหมายการพัฒนาที่ยั่งยืน (SDGs) ขององค์การสหประชาชาติ

กรอบการลงทุน:

กองทุนจะเน้นลงทุนในพันธบัตรรัฐบาล พันธบัตรที่กระทรวงการคลังค้าประกันต้นเงินและดอกเบี้ย หรือหุ้นกู้ที่กระทรวงการคลังค้าประกันต้นเงินและดอกเบี้ยแต่ไม่รวมถึงหุ้นกู้แปลงสภาพ ซึ่งเป็นพันธบัตรหรือหุ้นกู้เพื่ออนุรักษ์สิ่งแวดล้อม (green bond) พันธบัตรหรือหุ้นกู้เพื่อความยั่งยืน (sustainability bond) หรือพันธบัตรหรือหุ้นกู้ส่งเสริมความยั่งยืน (sustainability – linked bond) โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน

การอ้างอิงดัชนีชี้วัดที่สอดคล้องกับความยั่งยืน:

ดัชนีชี้วัดของกองทุน ประกอบด้วย

1. ผลตอบแทนรวมสุทธิของดัชนีพันธบัตรรัฐบาล ESG ของสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย สัดส่วนร้อยละ 80
2. ผลตอบแทนรวมสุทธิของดัชนีพันธบัตรรัฐบาลอายุไม่เกิน 1 ปี ของสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย สัดส่วนร้อยละ 20

โดยบริษัทจัดการเลือกดัชนีดังกล่าวเป็นดัชนีชี้วัด เนื่องจากดัชนีพันธบัตรรัฐบาล ESG ของสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทยมีตราสารหนี้ ESG ที่ออกโดยรัฐบาลเป็นองค์ประกอบ จึงเป็นดัชนีที่เหมาะสมภายใต้กรอบการลงทุน สอดคล้องกับวัตถุประสงค์และเป้าหมายด้านความยั่งยืนของกองทุน และดัชนีพันธบัตรรัฐบาลอายุไม่เกิน 1 ปี ของสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทยมีตราสารหนี้ที่ออกโดยรัฐบาลและมีอายุคงเหลือไม่เกิน 1 ปีเป็นองค์ประกอบ จึงเป็นดัชนีที่สะท้อนการลงทุนเพื่อเพิ่มโอกาสในการสร้างผลตอบแทนของกองทุน

ผู้ลงทุนสามารถศึกษาวิธีการจัดทำดัชนีพันธบัตรรัฐบาล ESG (index methodologies) ได้ที่สมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย <https://www.thaibma.or.th/pdf/Article/esgBondIndex.pdf>

แหล่งข้อมูล: <https://www.thaibma.or.th/EN/Market/Index/ESGIndex.aspx>

ทั้งนี้ ผู้ลงทุนสามารถศึกษาข้อมูลเพิ่มเติมได้ที่ <https://www.thaibma.or.th/>

บริษัทจัดการของสงวนสิทธิเปลี่ยนแปลงดัชนีชี้วัดตามที่บริษัทจัดการเห็นสมควรและเป็นไปเพื่อประโยชน์ของกองทุนหรือผู้ถือหน่วยลงทุนโดยรวม ซึ่งจะต้องอยู่ภายใต้กรอบการลงทุนที่กำหนด โดยบริษัทจัดการจะเปิดเผยข้อมูลและแจ้งให้ผู้ลงทุนทราบล่วงหน้าอย่างชัดเจนถึงวันที่มีการเปลี่ยนแปลงดัชนีชี้วัด คำอธิบายเกี่ยวกับการเปลี่ยนแปลงดัชนีชี้วัด และเหตุผลในการเปลี่ยนแปลงดัชนีชี้วัดดังกล่าวผ่านทางเว็บไซต์ของบริษัทจัดการ ภายในเวลาที่ผู้ลงทุนสามารถใช้ประโยชน์จากข้อมูลในการตัดสินใจลงทุนได้

ความเสี่ยงที่เกี่ยวข้องกับการลงทุนอย่างยั่งยืน:

- ความเสี่ยงจากการเน้นลงทุนพันธบัตรรัฐบาล พันธบัตรที่กระทรวงการคลังค้ำประกันต้นเงินและดอกเบี้ย หรือหุ้นกู้ที่กระทรวงการคลังค้ำประกันต้นเงินและดอกเบี้ยแต่ไม่รวมถึงหุ้นกู้แปลงสภาพ ซึ่งเป็นพันธบัตรหรือหุ้นกู้เพื่ออนุรักษ์สิ่งแวดล้อม (green bond) พันธบัตรหรือหุ้นกู้เพื่อความยั่งยืน (sustainability bond) หรือพันธบัตรหรือหุ้นกู้ส่งเสริมความยั่งยืน (sustainability – linked bond) ทำให้กองทุนเสียโอกาสในการลงทุนในตราสารหนี้ทั่วไปที่อาจให้ผลตอบแทนที่ดีกว่า
- ความเสี่ยงจากการพึ่งพาข้อมูลด้าน ESG จากแหล่งข้อมูลภายนอก เพื่อใช้ในการวิเคราะห์และคัดเลือกตราสารอาจมีข้อมูลที่ไม่สมบูรณ์หรือไม่ถูกต้อง ทั้งนี้ บริษัทจัดการจะค้นหาข้อมูลเพิ่มเติมจากแหล่งข้อมูลต่างๆ รวมถึงรายงานประจำปีและรายงานความยั่งยืนของผู้ออกตราสารเพื่อให้ข้อมูลที่นำมาใช้ในการวิเคราะห์มีความถูกต้องมากขึ้น
- ความเสี่ยงจากการลงทุนในตราสารที่อาจไม่เป็นไปตามกรอบการลงทุนด้านความยั่งยืนที่กองทุนกำหนด เช่น การลงทุนในตราสารที่ผู้ออกตราสารไม่มีอำนาจควบคุม หรือกรณีคู่ค้าของผู้ออกตราสาร (ผู้ขายสินค้า ผู้รับจ้าง และหรือผู้ให้บริการ) อาจมีการปฏิบัติไม่เป็นไปตามกรอบการลงทุนด้านความยั่งยืนที่นอกเหนือไปจากการรับรู้ของบริษัทจัดการ
- ความเสี่ยงด้านสภาพคล่อง อาจเกิดจากการที่กองทุนไม่สามารถซื้อหรือขายตราสารได้ในราคาหรือระยะเวลาที่เหมาะสม ด้วยเงื่อนไขด้านความยั่งยืนที่กองทุนกำหนด

เงื่อนไขการลงทุนในกองทุนเปิดเค ตราสารภาครัฐ ESG ชนิดไทยเพื่อความยั่งยืน:

การลงทุนในกองทุนเปิดเค ตราสารภาครัฐ ESG ชนิดไทยเพื่อความยั่งยืนให้ได้รับสิทธิประโยชน์ด้านภาษี ผู้ถือหน่วยลงทุนมีหน้าที่ต้องปฏิบัติตามหลักเกณฑ์วิธีการ และเงื่อนไขที่กำหนดในกฎหมายภาษีอากร หากไม่ปฏิบัติตาม ผู้ถือหน่วยลงทุนจะต้องคืนสิทธิประโยชน์ทางภาษีตามหลักเกณฑ์ที่กำหนด