



กองทุนเปิด แอล เอช ตราสารภาครัฐ ESG ไทยเพื่อความยั่งยืน

LH SOVEREIGN INSTRUMENTS THAILAND ESG FUND

(LHSITHAIESG)

LHSITHAIESG

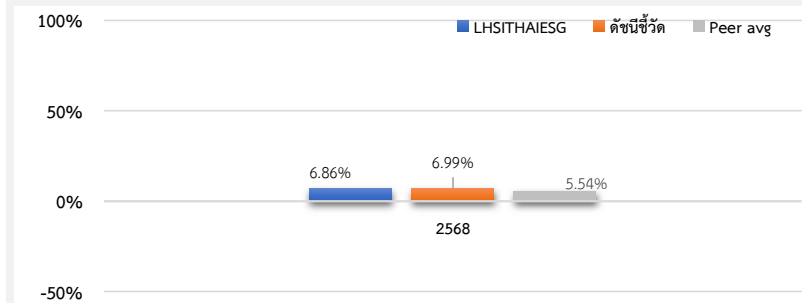
ประเภทกองทุนรวม/กลุ่มกองทุนรวม

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

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- กองทุนมีนโยบายลงทุนในตราสารภาครัฐไทย อาทิ ตัวเงินคลัง พันธบัตรรัฐบาล พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย พันธบัตร ตัวแลกเงิน ตัวสัญญาใช้เงิน หุ้นกู้ ที่กระทรวงการคลังหรือกองทุนฟื้นฟูเป็นผู้ออก ผู้ส่งจ่าย ผู้รับรอง ผู้รับอาวัล ผู้สืบทายาท หรือผู้ค้ำประกัน แล้วแต่กรณี ทั้งนี้ กองทุนจะเน้นลงทุนในพันธบัตรรัฐบาล พันธบัตรที่กระทรวงการคลังค้ำประกันต้นเงินและดอกเบี้ย หรือหุ้นกู้ ที่กระทรวงการคลังค้ำประกันต้นเงินและดอกเบี้ย แต่ไม่รวมถึงหุ้นกู้แปลงสภาพ ซึ่งเป็นพันธบัตร หรือหุ้นกู้เพื่ออนุรักษ์สิ่งแวดล้อม (Green bond) พันธบัตรหรือหุ้นกู้เพื่อความยั่งยืน (Sustainability bond) หรือพันธบัตรหรือหุ้นกู้ส่งเสริมความยั่งยืน (Sustainability-linked bond) โดยมีฐานะการลงทุนสุทธิ (net exposure) ในทรัพย์สินที่ลงทุนดังกล่าวโดยเฉลี่ยรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน
- กองทุนอาจลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมที่อยู่ภายใต้การจัดการของบริษัทจัดการ ในสัดส่วนไม่เกินร้อยละ 20 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน
- กองทุนมุ่งหวังให้ผลประโยชน์สูงกว่าดัชนีชี้วัด (Active Management)

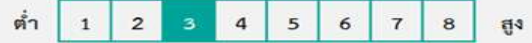
ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปี ปฏิทิน (%ต่อปี)



ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปีกลุ่ม (1%ต่อปี)

	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี ¹
LHSITHAIESG	-4.03	-1.89	-0.28	-6.28
ดัชนีชี้วัด	-4.20	-1.62	0.45	-6.10
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	-3.10	-1.00	0.61	-4.63
ความผันผวนกองทุน	4.96	1.84	3.17	5.41
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	4.82	1.69	3.03	5.26
	3 ปี ¹	5 ปี ¹	10 ปี ¹	ตั้งแต่จัดตั้ง ¹
LHSITHAIESG	N/A	N/A	N/A	1.20
ดัชนีชี้วัด	N/A	N/A	N/A	1.67
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	2.79	1.52	1.48	N/A
ความผันผวนกองทุน	N/A	N/A	N/A	5.11
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	N/A	N/A	N/A	4.73

ระดับความเสี่ยง



เสียงปานกลางค่อนข้างต่ำ

ลงทุนในตราสารภาครัฐไทย โดยมี net exposure โดยเฉลี่ยรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน	29 พฤศจิกายน 2567
วันเริ่มต้น class	ไม่มี
นโยบายการจ่ายเงินปันผล	ไม่มี
อายุกองทุน	ไม่กำหนด
การป้องกันความเสี่ยง FX	-
การเรียกเก็บค่าธรรมเนียมตามผลการดำเนินงาน	ไม่มี

ผู้จัดการกองทุนรวม

ชื่อ-นามสกุล	วันเริ่มบริหารกองทุน
คุณพิชกันต์ ชนวรกิจสกุล	29 พฤศจิกายน 2567
คุณพรเพ็ญ ชูลีประเสริฐ	29 พฤศจิกายน 2567

ดัชนีชี้วัด :

1. ดัชนี ThaiBMA Government Bond ESG Index Net Total Return ร้อยละ 80
2. ดัชนี ThaiBMA Short-term Government Bond Index Total Return ร้อยละ 20

คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวม ไม่ได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต
- กองทุนที่ไม่เหมาะสมกับผู้ลงทุนที่ต้องการผลตอบแทนอย่างสม่ำเสมอ หรือต้องการรักษาเงินต้น ผู้ลงทุนโปรดศึกษาและลงทุนให้เหมาะสมกับระดับความเสี่ยงที่ยอมรับได้

การเข้าร่วมการต่อต้านทุจริต : ได้รับการรับรองจาก CAC

การจัดอันดับกองทุน Morningstar

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



www.lhfund.co.th

ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือบริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่องได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

การซื้อขายหน่วยลงทุน		การขายคืนหน่วยลงทุน	
วันทำการซื้อ :	ทุกวันทำการ	วันทำการขายคืน :	ทุกวันทำการ
เวลาทำการ :	8.30 - 15.30 น	เวลาทำการ :	8.30 - 15.30 น
การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ :	ไม่กำหนด	การขายคืนขั้นต่ำ :	ไม่กำหนด
การซื้อครั้งถัดไปขั้นต่ำ :	ไม่กำหนด	ยอดคงเหลือขั้นต่ำ :	ไม่กำหนด
		ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน* :	T+1

หมายเหตุ : *ภายใน 5 วันทำการถัดจากวันทำการขายคืน ปัจจุบันรับเงินค่าขายคืนภายใน 1 วันทำการถัดจากวันทำการขายคืน (T+1)
*การขายคืนหน่วยลงทุนอาจส่งผลให้ผู้ถือหน่วยลงทุนต้องชำระคืนสิทธิประโยชน์ทางภาษี ดังนั้น ผู้ถือหน่วยลงทุนมีหน้าที่ต้องศึกษาและปฏิบัติตามข้อกำหนดในกฎหมายภาษีอากร และสิทธิประโยชน์ทางภาษีที่ระบุไว้ในคู่มือการลงทุน

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV) ค่าธรรมเนียมต่อไปนี้จะส่งผลกระทบต่อผู้ลงทุนเนื่องจากจะทำให้ผลตอบแทนจากการลงทุนลดลง ดังนั้น ผู้ลงทุนควรตรวจสอบทุกครั้งก่อนตัดสินใจลงทุน		
ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	2.14	0.2140
ค่าตอบแทนแก่ตัวแทนขายหน่วยของกองทุนรวม (trailer fee) : มี		
รวมค่าใช้จ่าย	4.19	0.5894

หมายเหตุ :
1) ค่าธรรมเนียมดังกล่าวข้างต้นเป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม หรือภาษีธุรกิจเฉพาะ หรือภาษีอื่นใด ในทำนองเดียวกันนี้
2) ค่าธรรมเนียมค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวมเมื่อรวมกันทั้งหมดแล้ว ต้องไม่เกินอัตราร้อยละ 4.19 ต่อปีของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุนรวม
ทั้งนี้ หากกองทุนลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมภายใต้การจัดการเดียวกัน (กองทุนปลายทาง) บริษัทจัดการจะไม่เรียกเก็บค่าธรรมเนียมการจัดการ ค่าธรรมเนียมการขาย และ/หรือค่าธรรมเนียมการรับซื้อคืนหน่วยลงทุนซ้ำซ้อนกับกองทุนปลายทาง เช่น หากกองทุนต้นทางมีมูลค่าทรัพย์สินสุทธิ 1,000 ล้านบาท และจัดสรรการลงทุนไปยังกองทุนปลายทางจำนวน 100 ล้านบาท บริษัทจัดการจะเรียกเก็บค่าธรรมเนียมการจัดการ ค่าธรรมเนียมการขาย และ/หรือค่าธรรมเนียมการรับซื้อคืนหน่วยลงทุนจากเงินลงทุน 1,000 ล้านบาท ในอัตราที่กองทุนต้นทางกำหนดเท่านั้น โดยกองทุนปลายทางจะไม่มีค่าธรรมเนียมการเรียกเก็บค่าธรรมเนียมดังกล่าวเพิ่มเติมอีก เป็นต้น
* สามารถดูข้อมูลเพิ่มเติมได้ที่ www.lhfund.co.th

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย) ผู้ลงทุนจะถูกเรียกเก็บค่าธรรมเนียมต่อไปนี้โดยตรงทุกครั้ง เมื่อทำการซื้อขายหรือสับเปลี่ยนหน่วยลงทุน		
ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การขาย	2.00	ยกเว้น
การรับซื้อคืน	2.00	ยกเว้น
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า	1.00	ยกเว้น
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก	1.00	ยกเว้น
การโอนหน่วย	ตามที่นายทะเบียนเรียกเก็บ	200 บาท/รายการ

หมายเหตุ :
1) ค่าธรรมเนียมดังกล่าวข้างต้น อาจเรียกเก็บจากผู้ลงทุนแต่ละกลุ่มไม่เท่ากัน ขึ้นอยู่กับดุลยพินิจของบริษัทจัดการ
2) กรณีสับเปลี่ยนหน่วยลงทุน บริษัทจัดการอาจยกเว้นไม่เรียกเก็บค่าธรรมเนียมการสับเปลี่ยนหน่วยลงทุน สำหรับการสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนระหว่างกองทุนรวมภายใต้การจัดการของบริษัทจัดการ แต่จะมีการเรียกเก็บค่าธรรมเนียมการขายและรับซื้อคืนหน่วยลงทุนตามอัตราที่บริษัทจัดการกำหนด
3) ค่าธรรมเนียมดังกล่าวข้างต้นรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน		ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก	
พันธบัตรรัฐบาล	90.55%	พันธบัตรรัฐบาลเพื่อความยั่งยืนสำหรับบริหารหนี้ให้กู้ต่อในปีงบประมาณ พ.ศ. 2563 ครั้งที่ 1	54.24%
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย	8.55%	พันธบัตรรัฐบาลเพื่อความยั่งยืนสำหรับปรับโครงสร้างหนี้ (พ.ร.ก.กู้เงินโควิด-19) ในปีงบประมาณ พ.ศ. 2565	23.44%
เงินฝากธนาคาร	1.19%	พันธบัตรรัฐบาลส่งเสริมความยั่งยืน ในปีงบประมาณ พ.ศ. 2568 ครั้งที่ 1	12.88%
อื่นๆ	-0.28%	พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 11/364/68	4.27%
		พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 33/91/2569	4.27%

ข้อมูลเชิงสถิติ	
Maximum Drawdown	-8.90%
Recovering Period	N/A
FX Hedging	N/A
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน	0.4791
Sharpe Ratio	N/A
Alpha	N/A
Beta	N/A
Tracking Error	N/A
อายุเฉลี่ยของตราสารหนี้	8 ปี 1 เดือน
Yield to Maturity	2.25

การจัดสรรการลงทุนในต่างประเทศ

หมายเหตุ :

การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม / ผู้ออกตราสาร 5 อันดับแรก	
MINISTRY OF FINANCE	90.55
BANK OF THAILAND	8.55
KRUNG THAI BANK PUBLIC COMPANY LIMITED	1.19
อื่นๆ	-0.28

หมายเหตุ : การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม 5 อันดับแรก

การจัดสรรการลงทุนตามอันดับความน่าเชื่อถือ (%)			
	ในประเทศ	national	international
GOV Bond/AAA	100.28%		
AA			
A			
BBB			
ต่ำกว่า BBB			
Unrated			

กองทุนเปิด แอล เอช ตราสารภาครัฐ ESG ไทยเพื่อความยั่งยืน (LHSITHAIESG)

สรุปข้อมูลด้านความยั่งยืน (Sustainability Corner)

(1) ประเภทของกองทุนรวม SRI และเกณฑ์การพิจารณาโดยสรุป

ประเภท SRI ตามวัตถุประสงค์	SRI Focus
เกณฑ์การพิจารณาโดยสรุป	พิจารณาจากการกำหนดวัตถุประสงค์และกรอบการลงทุนด้านความยั่งยืนที่ชัดเจน โดยกองทุนมุ่งลงทุนในตราสารภาครัฐกลุ่มความยั่งยืน และนำปัจจัยด้านสิ่งแวดล้อม สังคม และธรรมาภิบาลมาใช้ในกระบวนการวิเคราะห์และตัดสินใจลงทุน

(2) เป้าหมายด้านความยั่งยืนของกองทุนรวม SRI

เป้าหมายด้านความยั่งยืน	กองทุนไม่มีเป้าหมายด้านความยั่งยืนแบบเฉพาะเจาะจง โดยมุ่งคัดเลือกพันธบัตรหรือหุ้นที่มีภาระผลตอบแทนเพื่อสนับสนุนการระดมทุนเพื่อสิ่งแวดล้อม สังคม และธรรมาภิบาล (Environmental, Social and Governance Bond: ESG Bond) ที่มีการเปิดเผยข้อมูลโครงการที่ใช้เงินที่ได้จากการระดมทุน (use of proceeds) อย่างโปร่งใสและมีวัตถุประสงค์ในการดำเนินงานด้านสิ่งแวดล้อมและสังคมของประเทศไทย ภายใต้กรอบการระดมทุนเพื่อความยั่งยืน และการบรรลุเป้าหมายการพัฒนาที่ยั่งยืนสากลภายใต้ Sustainable Development Goals (SDGs) ขององค์การสหประชาชาติ
-------------------------	---

(3) กลยุทธ์การลงทุน (เพื่อการบรรลุวัตถุประสงค์ด้านความยั่งยืน)

กลยุทธ์การลงทุนเพื่อบรรลุเป้าหมายด้านความยั่งยืน	Screening
เหตุผลและหลักการที่เลือกใช้กลยุทธ์ดังกล่าว	กองทุนมีวัตถุประสงค์ด้านความยั่งยืน โดยเลือกใช้กลยุทธ์การลงทุนแบบ Screening สำหรับการลงทุนในตราสารหนี้เพื่อคัดเลือกรตราสารที่มีคุณลักษณะด้านความยั่งยืนและสอดคล้องกับวัตถุประสงค์ด้านความยั่งยืนของกองทุน โดยนำปัจจัยด้านสิ่งแวดล้อม สังคม และธรรมาภิบาล (ESG) มาประกอบการวิเคราะห์และตัดสินใจลงทุน ควบคู่กับการพิจารณาปัจจัยทางการเงิน รวมถึงคัดเลือกรตราสารหนี้ด้านความยั่งยืน เช่น Green Bond, Sustainability Bond และ Sustainability-Linked Bond ซึ่งมีวัตถุประสงค์หรือคุณลักษณะที่สนับสนุนการอนุรักษ์สิ่งแวดล้อมและความยั่งยืน เพื่อให้การลงทุนเป็นไปตามวัตถุประสงค์ด้านความยั่งยืนของกองทุน

(4) กรอบการลงทุน

ลักษณะ/ขอบเขตการลงทุนหลัก	กองทุนจะลงทุนในพันธบัตรรัฐบาล พันธบัตร หรือหุ้นที่กระทรวงการคลังค้ำประกันต้นเงินและดอกเบี้ย (ต่อไปเรียกว่า “ตราสาร”) ซึ่งเป็นตราสารเพื่ออนุรักษ์สิ่งแวดล้อม (Green Bond) ตราสารเพื่อความยั่งยืน (Sustainability Bond) หรือตราสารส่งเสริมความยั่งยืน (Sustainability-Linked Bond) ที่ออกเพื่อำเงินไปลงทุนหรือชำระหนี้เดิม (re-financing) ในโครงการที่เกี่ยวข้องกับการอนุรักษ์สิ่งแวดล้อม หรือความยั่งยืน โดยมีฐานะการลงทุนสุทธิ (Net exposure) เฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่า 80% มูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน โดยภาพรวมของกรอบการลงทุนของกองทุน ทั้งในด้านประเภทหลักทรัพย์คุณสมบัติผู้ออก กลุ่มอุตสาหกรรม และขอบเขตประเทศ เอื้อต่อการใช้กระบวนการผนวกปัจจัยด้านสิ่งแวดล้อม สังคม และธรรมาภิบาล (ESG Integration) อย่างเป็นระบบ โดยสามารถนำข้อมูล ESG มาประกอบการวิเคราะห์ตราสารและผู้ออกตราสาร ตลอดจนประเมินปัจจัย ESG ควบคู่กับปัจจัยทางการเงิน เพื่อสนับสนุนการตัดสินใจลงทุน
---------------------------	--

ข้อกำหนดเพิ่มเติม

(1) สัดส่วนการลงทุน:

ตารางสัดส่วนการลงทุนตามคุณลักษณะด้านความยั่งยืน (% ของ NAV)

คุณลักษณะด้านความยั่งยืน	สัดส่วน (% ของ NAV)
ตราสารทุน	-
หุ้นกลุ่มที่ได้รับการจัดอันดับหรือคะแนนด้านความยั่งยืน	-
หุ้นกลุ่มที่เปิดเผยมูลค่าการปล่อยก๊าซเรือนกระจก (GHGs)	-
หุ้นกลุ่มที่มีธรรมาภิบาลดีเลิศและมีการเปิดเผยแผนธุรกิจที่เกี่ยวข้องกับการเพิ่มมูลค่าของกิจการ (corporate value up plan)	-
ตราสารหนี้	-
ตราสารเพื่ออนุรักษ์สิ่งแวดล้อม (green bond)	0.00
ตราสารเพื่อความยั่งยืน (sustainability bond)	77.67
ตราสารส่งเสริมความยั่งยืน (sustainability-linked bond)	12.88
โทเคนดิจิทัลเพื่อการลงทุนกลุ่มความยั่งยืน	-
โทเคนดิจิทัลเพื่ออนุรักษ์สิ่งแวดล้อม (green token)	-
โทเคนดิจิทัลเพื่อความยั่งยืน (sustainability token)	-
โทเคนดิจิทัลเพื่อส่งเสริมความยั่งยืน (sustainability-linked token)	-
ทรัพย์สินอื่น ๆ	-
หน่วยทรัสต์ของทรัสต์เพื่อการลงทุนในอสังหาริมทรัพย์ที่ได้รับการจัดอันดับหรือคะแนนด้านความยั่งยืน	-
หน่วยลงทุนของกองทุนรวมโครงสร้างพื้นฐานที่ได้รับการจัดอันดับหรือคะแนนด้านความยั่งยืน	-
ผลรวมสัดส่วนการลงทุน	90.55

ข้อมูล ณ วันที่ 30 กันยายน 2569

หมายเหตุ : กองทุนไม่มีการลงทุนในตราสารทุน

(2) การแสดงข้อมูลรายละเอียดการลงทุนด้านความยั่งยืน

(2.1) หุ้กลุ่มที่ได้รับการจัดอันดับหรือคะแนนด้านความยั่งยืน

ตารางสัดส่วนการลงทุนตามอันดับหรือคะแนนด้านสิ่งแวดล้อม หรือความยั่งยืน ของหุ้กลุ่มที่มีความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อม หรือความยั่งยืน

อันดับหรือคะแนนด้านสิ่งแวดล้อม หรือความยั่งยืน	จำนวนบริษัท	สัดส่วน (% ของ NAV)
AAA	-	-
AA	-	-
A	-	-
BBB	-	-
NA	-	-
รวม	-	-
อันดับหรือคะแนนเฉลี่ยของพอร์ต	-	-

ข้อมูล ณ วันที่ 30 กันยายน 2569

หมายเหตุ : กองทุนไม่มีการลงทุนในตราสารทุน

(2.2) หุ้กลุ่มที่เปิดเผยข้อมูลเกี่ยวกับการปล่อยก๊าซเรือนกระจก (“GHGs”) แผนการจัดการ และการตั้งเป้าหมายเพื่อให้บรรลุเป้าหมายในการลดปริมาณการปล่อย GHGs ของ ประเทศไทย รวมทั้งจัดให้มีการทวนสอบการจ้ดทำคาร์บอนฟุตพริ้นท์โดยผู้ทวนสอบที่สำนักงานยอมรับ

(2.2.1) สถานะการตั้งเป้าหมายการลดการปล่อย GHGs ของบริษัทในพอร์ตการลงทุน

ตารางการตั้งเป้าหมายลดก๊าซเรือนกระจกของหุ้กลุ่มที่เปิดเผยข้อมูลเกี่ยวกับการปล่อยก๊าซเรือนกระจก ที่กองทุนรวมลงทุน

คุณสมบัติของบริษัทที่ลงทุน	จำนวนบริษัท	สัดส่วน (% ของ NAV)
บริษัทที่มีการตั้งเป้าหมายการลดก๊าซเรือนกระจกระยะสั้นและยาว	-	-
บริษัทที่มีการตั้งเป้าหมายการลดก๊าซเรือนกระจกเฉพาะระยะยาว	-	-
บริษัทที่มีการตั้งเป้าหมายการลดก๊าซเรือนกระจกเฉพาะระยะสั้น	-	-
รวมบริษัทที่เปิดเผยก๊าซเรือนกระจกและมีการตั้งเป้าหมายการลดก๊าซเรือนกระจก	-	-

ข้อมูล ณ วันที่ 30 กันยายน 2569

หมายเหตุ : กองทุนไม่มีการลงทุนในหุ้กลุ่มดังกล่าว

(2.2.2) ข้อมูลการปล่อยก๊าซเรือนกระจกรวม (ต้นคาร์บอนไดออกไซด์เทียบเท่า: “ตัน CO₂e”)² ของพอร์ตการลงทุนในภาพรวม และตัวชี้วัดเชิงคุณภาพที่เกี่ยวข้อง โดยเปรียบเทียบข้อมูลระหว่างรอบการรายงานปัจจุบันกับรอบการรายงานปีก่อนหน้า (หากมีข้อมูล) ภายใต้รูปแบบตารางที่กำหนด ดังนี้

ตารางปริมาณการปล่อยก๊าซเรือนกระจกรวมของหุ้กลุ่มที่เปิดเผยข้อมูลการปล่อยก๊าซเรือนกระจก ที่กองทุนรวมลงทุน

ตัวชี้วัด	รอบการรายงาน ปีก่อนหน้า	รอบการรายงาน ปีปัจจุบัน (ปี 2568)	การเปลี่ยนแปลง YoY (%)
ปริมาณการปล่อยก๊าซเรือนกระจกรวม (ตัน CO ₂ e)	-	-	-

ข้อมูล ณ วันที่ 30 กันยายน 2569

ตัวชี้วัดการพัฒนาของบริษัทที่ลงทุน	จำนวนบริษัท	สัดส่วน (% ของ NAV)
บริษัทที่ปริมาณการปล่อยก๊าซเรือนกระจกลดลงจากกรอบการรายงานปีก่อนหน้า (YoY)	-	-
บริษัทที่มีการปรับปีเป้าหมายการลดก๊าซเรือนกระจก ให้เร็วขึ้น	-	-

ข้อมูล ณ วันที่ 30 กันยายน 2569

หมายเหตุ :

- (1) ข้อมูลปริมาณการปล่อยก๊าซเรือนกระจกรวมข้างต้น เป็นการเปิดเผยปริมาณการปล่อยก๊าซเรือนกระจกในลักษณะตัวเลขรวม (absolute) ของหุ้นกลุ่มที่เปิดเผยข้อมูลเกี่ยวกับการปล่อยก๊าซเรือนกระจกที่กองทุนรวมถือครอง มีใช้การคำนวณปริมาณการปล่อยก๊าซเรือนกระจกที่กองทุนรวมมีส่วนรับผิดชอบโดยตรง (financed emissions)
- (2) การเปิดเผยปริมาณการปล่อยก๊าซเรือนกระจกรวม มีวัตถุประสงค์เพื่อสร้างความโปร่งใส โดยกองทุนรวมทำหน้าที่เป็นกลไกขับเคลื่อนกิจการให้มีการตั้งเป้าหมายระยะสั้นและยาวในการลดการปล่อยก๊าซเรือนกระจก และผลักดันกิจการให้ดำเนินธุรกิจโดยคำนึงถึงการลดการปล่อยก๊าซเรือนกระจกอย่างต่อเนื่อง
- (3) ผู้ลงทุนควรพิจารณาข้อมูลนี้ร่วมกับปัจจัยอื่น เช่น รายงานการมีส่วนร่วมกับการ (engagement) การใช้สิทธิออกเสียง ในนามกองทุนรวม เป็นต้น เพื่อให้ผู้ลงทุนเห็นภาพรวมของระดับการติดตามกิจการที่ลงทุนของบริษัทจัดการ และผลลัพธ์ ที่ตรวจสอบได้ ในการผลักดันให้กิจการที่ลงทุนลดการปล่อยก๊าซเรือนกระจกอย่างเป็นรูปธรรม

(2.3) หุ้นกลุ่มที่มีธรรมาภิบาลดีเลิศและมีการเปิดเผยแผนธุรกิจที่เกี่ยวข้องกับ การเพิ่มมูลค่าของกิจการ (“corporate value up plan”)

(2.3.1) สัดส่วนการลงทุนตามประเภทแผนการยกระดับการดำเนินงาน:

เปิดเผยสัดส่วนการลงทุนในหุ้นกลุ่ม corporate value up plan ตามประเภทของแผนการยกระดับการดำเนินงานในเรื่องใดเรื่องหนึ่ง ดังนี้

- หุ้นกลุ่มที่มีแผนจะเข้ารับการประเมินด้าน E หรือ ESG จากผู้ประเมินฯ
- หุ้นกลุ่มที่มีเป้าหมายและแผนการดำเนินงานเพื่อลดปริมาณ การปล่อย GHGs ของประเทศไทย

ตารางสรุปการลงทุนในหุ้นกลุ่ม corporate value up plan

ประเภทหุ้นกลุ่ม corporate value up	จำนวนบริษัท	สัดส่วน (% ของ NAV)
หุ้นกลุ่มที่มีแผนจะเข้ารับการประเมินด้านสิ่งแวดล้อม (E) หรือความยั่งยืน (ESG) จากผู้ประเมินผลการดำเนินงานด้านความยั่งยืนตามมาตรฐานสากล	-	-
หุ้นกลุ่มที่มีเป้าหมายและแผนการดำเนินงานเพื่อลดปริมาณ การปล่อยก๊าซเรือนกระจกของประเทศไทย	-	-

ข้อมูล ณ วันที่ 30 กันยายน 2569

(2.3.2) ข้อมูลการมีส่วนร่วมกับบริษัทที่ลงทุน

เปิดเผยสัดส่วนร้อยละของจำนวนบริษัทในกลุ่ม corporate value up plan ที่กองทุนรวมลงทุน ซึ่งบริษัทจัดการได้เข้ามีส่วนร่วม ภายในรอบ 1 ปีที่ผ่านมา

ตารางความครอบคลุมการมีส่วนร่วมกับบริษัทในกลุ่ม corporate value up plan

จำนวนบริษัทที่บริษัทจัดการได้ไป มีส่วนร่วมแล้วในรอบการรายงาน (N)	จำนวนบริษัทในกลุ่ม corporate value up plan ที่กองทุนรวมลงทุน (M)	สัดส่วนความครอบคลุมของการมีส่วนร่วม (N/M, %)
-	-	-

ข้อมูล ณ วันที่ 30 กันยายน 2569

หมายเหตุ :

- (1) การมีส่วนร่วมกับบริษัทครอบคลุมการมีส่วนร่วมกับบริษัทโดยตรง (direct engagement) การร่วมมือกับผู้ลงทุนอื่น ตามความเหมาะสม (collective engagement) หรือการเข้าร่วมเวทีสาธารณะ (เช่น SET Opportunity Day) เพื่อสนับสนุน การดำเนินงานตาม corporate value up plan ของบริษัท
- (2) นับบริษัทละ 1 ครั้งต่อรอบรายงาน หากเกิดการมีส่วนร่วมอย่างน้อยหนึ่งกิจกรรมในช่วงระยะเวลาการเปิดเผยข้อมูล

(2.4) ตราสารหนี้เพื่อความยั่งยืน (Green Bond หรือ Sustainability Bond)

(2.4.1) รายละเอียดเกี่ยวกับวัตถุประสงค์การใช้เงินที่ได้จากการระดมทุน (use of proceeds) ของตราสารหนี้เพื่อความยั่งยืนที่ลงทุนสูงสุด 5 อันดับแรก

ตารางวัตถุประสงค์การใช้เงินที่ได้จากการระดมทุนของตราสารหนี้เพื่อความยั่งยืนที่ลงทุนสูงสุด 5 อันดับแรก

ลำดับ	ชื่อตราสาร - ชื่อโครงการ	วัตถุประสงค์การใช้เงินที่ได้ จากการระดมทุน (use of proceeds)	สัดส่วน (% ของ NAV)
1	ESGLB35DA - พันธบัตรรัฐบาลเพื่อความยั่งยืน	โครงการรถไฟฟ้าสายสีส้ม และ COVID-19 Financing	54.24%
2	ESGLB376A - พันธบัตรรัฐบาลเพื่อความยั่งยืน	ปรับโครงสร้างหนี้ตาม พ.ร.ก. กู้เงินโควิด-19	23.44%
3	-	-	-
4	-	-	-
5	-	-	-

ข้อมูล ณ วันที่ 30 กันยายน 2569

หมายเหตุ: พอร์ตการลงทุน ณ 30 กันยายน 2569: ThaiBMA ข้อมูลตราสาร ESGLB35DA, ESGLB376A และ SLB406A ณ 14 ตุลาคม 2569

(2.4.2) สัดส่วนการลงทุนในตราสารหนี้เพื่อความยั่งยืน จำแนกตาม กลุ่มอุตสาหกรรมของผู้ออกตราสาร

ตารางสัดส่วนการลงทุนตามกลุ่มอุตสาหกรรมของผู้ออกตราสารหนี้เพื่อความยั่งยืน

กลุ่มอุตสาหกรรมของผู้ออกตราสารหนี้เพื่อความยั่งยืน	สัดส่วน (% ของ NAV)
ภาครัฐ / กระบวนการคลัง	77.67%
-	-
-	-
รวม	77.67%

ข้อมูล ณ วันที่ 30 กันยายน 2569

(2.5) ตราสารหนี้ส่งเสริมความยั่งยืน (Sustainability-Linked Bond)

(2.5.1) รายละเอียดของตัวชี้วัดและเป้าหมายด้านความยั่งยืนที่ผู้ออก ตราสารหนี้ส่งเสริมความยั่งยืนกำหนด

ตารางรายละเอียดของตัวชี้วัดและเป้าหมายด้านความยั่งยืนที่ผู้ออกตราสารหนี้ส่งเสริมความยั่งยืนกำหนด

ลำดับ	ชื่อผู้ออก	ตัวชี้วัดและเป้าหมาย ด้านความยั่งยืน	ระยะเวลาเป้าหมาย	ดอกเบี้ย (%) / อัตราการ เพิ่มขึ้นของ ดอกเบี้ยหากไม่บรรลุ เป้าหมาย (bps)	สัดส่วน (% ของ NAV)
1	กระทรวงการคลัง / SLB406A	KPI 1: Total Greenhouse Gas Emission; KPI 2: Zero Emission Vehicle (ZEV)	ทดสอบผล ณ 31 ธ.ค. 2573; รายงาน KPI 2 ภายใน 30 มิ.ย. 2574 และ KPI 1 ภายใน 30 มิ.ย. 2578	Coupon 2.70%; ปรับเพิ่ม/ลด 2.5 bps ต่อ KPI ตามผลการบรรลุ SPT	12.88%
	-	-	-	-	-
	-	-	-	-	-
รวม					12.88%

ข้อมูล ณ วันที่ 30 กันยายน 2569

หมายเหตุ : ข้อมูลข้างต้นสะท้อนตัวชี้วัดและเป้าหมายด้านความยั่งยืนที่ผู้ออกตราสารหนี้ส่งเสริมความยั่งยืนกำหนด

(2.5.2) สัดส่วนการลงทุนในตราสารหนี้ส่งเสริมความยั่งยืน จำแนกตาม กลุ่มอุตสาหกรรมของผู้ออกตราสารหนี้ส่งเสริมความยั่งยืน
 ตารางสัดส่วนการลงทุนตามกลุ่มอุตสาหกรรมของผู้ออกตราสารหนี้ส่งเสริมความยั่งยืน

กลุ่มอุตสาหกรรมของผู้ออกตราสารหนี้ส่งเสริมความยั่งยืน	สัดส่วน (% ของ NAV)
ภาครัฐ / กระบวนการคลัง	12.88%
-	-
-	-
-	-
-	-
รวม	12.88%

ข้อมูล ณ วันที่ 30 กันยายน 2569

(2.6) โทเคนดิจิทัลเพื่อการลงทุนกลุ่มความยั่งยืน

ตารางรายละเอียดด้านความยั่งยืนของโทเคนดิจิทัลเพื่อการลงทุนกลุ่มความยั่งยืน ที่ลงทุนสูงสุด 5 อันดับแรก

ลำดับ	ชื่อโทเคน	ประเภทโครงการอ้างอิง	รายละเอียดด้านความยั่งยืน	สัดส่วน (% ของ NAV)
1	-	-	-	-
2	-	-	-	-
3	-	-	-	-
4	-	-	-	-
รวม				

ข้อมูล ณ วันที่ 30 กันยายน 2569

(2.7) หน่วยทรัสต์ของทรัสต์เพื่อการลงทุนในอสังหาริมทรัพย์ (Real Estate Investment Trusts: “REITs”) และหน่วยลงทุนของกองทุนรวม
 โครงสร้างพื้นฐาน (Infrastructure Funds: “Infra Funds”) ที่ได้รับการจัดอันดับหรือคะแนนด้านความยั่งยืน

ตารางสัดส่วนการลงทุนตามอันดับหรือคะแนนด้าน E หรือ ESG ของ REITs หรือ Infra Funds

อันดับหรือคะแนนด้าน E หรือ ESG	จำนวนกองทุน	สัดส่วน (% ของ NAV)
-	-	-
-	-	-
-	-	-
รวม		
อันดับหรือคะแนนเฉลี่ยของพอร์ต -		

ข้อมูล ณ วันที่ 30 กันยายน 2569

นโยบายการลงทุนเพิ่มเติม

1.1.วัตถุประสงค์การลงทุนที่เกี่ยวข้องกับความยั่งยืน

กองทุนมีวัตถุประสงค์ในการส่งเสริมการลงทุนเพื่อความยั่งยืนผ่านการลงทุนในพันธบัตรรัฐบาล พันธบัตรที่กระทรวงการคลังค้ำประกันต้นเงินและดอกเบี้ย หรือหุ้นกู้ที่กระทรวงการคลังค้ำประกันต้นเงินและดอกเบี้ย แต่ไม่รวมถึงหุ้นกู้แปลงสภาพ ซึ่งเป็นพันธบัตรหรือหุ้นกู้เพื่ออนุรักษ์สิ่งแวดล้อม (Green bond) พันธบัตรหรือหุ้นกู้เพื่อความยั่งยืน (Sustainability bond) หรือพันธบัตรหรือหุ้นกู้ส่งเสริมความยั่งยืน (Sustainability-linked bond)

1.2. เป้าหมายด้านความยั่งยืน (ถ้ามี)

เพื่อสนับสนุนตราสารภาครัฐเพื่อสิ่งแวดล้อม สังคม และธรรมาภิบาล (Environmental, Social and Governance Bond: ESG Bond) ที่มีการเปิดเผยวัตถุประสงค์การใช้เงินที่ได้จากการระดมทุน (use of proceeds) เพื่อไปส่งเสริมและสนับสนุนการดำเนินการด้านอนุรักษ์สิ่งแวดล้อมและสังคมของประเทศไทย ภายใต้กรอบการระดมทุนเพื่อความยั่งยืน และการบรรลุเป้าหมายการพัฒนาที่ยั่งยืนตามหลักสากล เช่น Sustainable Development Goals (SDGs) ขององค์การสหประชาชาติ

1.3.กรอบการลงทุน (Investment Universe)

กองทุนจะลงทุนในพันธบัตรรัฐบาล พันธบัตร หรือหุ้นกู้ที่กระทรวงการคลังค้ำประกันต้นเงินและดอกเบี้ย (ต่อไปรวมเรียกว่า “ตราสาร”) ซึ่งเป็นตราสารเพื่ออนุรักษ์สิ่งแวดล้อม (Green bond) ตราสารเพื่อความยั่งยืน (Sustainability bond) หรือตราสารส่งเสริมความยั่งยืน (Sustainability-linked bond) ที่ผู้ออกต้องการระดมทุนเพื่อนำเงินไปลงทุนหรือชำระหนี้สินเดิม (re-financing) ในโครงการที่เกี่ยวข้องกับการอนุรักษ์สิ่งแวดล้อม หรือความยั่งยืน

1.4. การอ้างอิงดัชนีชี้วัดที่เกี่ยวกับความยั่งยืน (Investment Benchmark)

1. ThaiBMA Government Bond ESG Index Net Total Return ร้อยละ 80
2. ThaiBMA Short-term Government Bond Index Total Return ร้อยละ 20

กองทุนใช้ดัชนี ThaiBMA Government Bond ESG Index Net Total Return ในสัดส่วน ร้อยละ 80 เนื่องจากเป็นดัชนีที่รวมตราสารหนี้ ESG ที่ออกโดยภาครัฐที่ขึ้นทะเบียนกับ ThaiBMA โดยเป็นไปตามกรอบนโยบายการลงทุนในตราสารเพื่อการอนุรักษ์สิ่งแวดล้อมหรือความยั่งยืน และใช้ดัชนี ThaiBMA Short-term Government Bond Index Total Return ในสัดส่วนร้อยละ 20 ซึ่งเป็นดัชนีที่รวมตราสารหนี้ภาครัฐระยะสั้นที่ขึ้นทะเบียนกับ ThaiBMA โดยกองทุนอาจลงทุนในตราสารหนี้ดังกล่าวที่นอกเหนือจากตราสารเพื่อการอนุรักษ์สิ่งแวดล้อมหรือความยั่งยืน

ผู้ลงทุนสามารถศึกษาวิธีการจัดทำดัชนีที่รวมตราสารหนี้ ESG ได้ที่สมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย <http://www.thaibma.or.th/pdf/Article/esgBondIndex.pdf>

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

คำอธิบาย

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

Recovering Period ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาตั้งแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลาเท่าใด

FX Hedging เพอร์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตกองทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลาหนึ่ง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์กับผลรวมของมูลค่าการขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 1 ปีหารด้วยมูลค่า NAV ของกองทุนรวมเฉลี่ยในรอบระยะเวลาเดียวกัน กองทุนรวมที่มีค่า portfolio turnover สูงบ่งชี้ถึงการซื้อขายหลักทรัพย์บ่อยครั้งของผู้จัดการกองทุนและทำให้มีต้นทุนการซื้อขายหลักทรัพย์ที่สูง จึงต้องพิจารณาเปรียบเทียบกับผลการดำเนินงานของกองทุนรวมเพื่อประเมินความคุ้มค่าของการซื้อขายหลักทรัพย์ดังกล่าว

Sharpe Ratio อัตราส่วนระหว่างผลตอบแทนส่วนเพิ่มของกองทุนรวมเปรียบเทียบกับความเสี่ยงจากการลงทุน โดยคำนวณจากผลต่างระหว่างอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมกับอัตราผลตอบแทนที่ปราศจากความเสี่ยง (risk-free rate) เปรียบเทียบกับค่าเบี่ยงเบนมาตรฐาน (standard deviation) ของกองทุนรวม ค่า Sharpe Ratio สะท้อนถึงอัตราผลตอบแทนที่กองทุนรวมควรได้รับเพิ่มขึ้นเพื่อชดเชยกับความเสี่ยงที่กองทุนรวมรับมา โดยกองทุนรวมที่มีค่า Sharpe Ratio สูงกว่าจะเป็นกองทุนที่มีประสิทธิภาพในการบริหารจัดการการลงทุนที่ดีกว่าเนื่องจากได้รับผลตอบแทนส่วนเพิ่มที่สูงกว่าภายใต้ระดับความเสี่ยงเดียวกัน

Alpha ผลตอบแทนส่วนเกินของกองทุนรวมเมื่อเปรียบเทียบกับดัชนีชี้วัด (benchmark) โดยค่า Alpha ที่สูง หมายถึง กองทุนสามารถสร้างผลตอบแทนได้สูงกว่าดัชนีชี้วัด ซึ่งเป็นผลจากประสิทธิภาพของผู้จัดการกองทุนในการคัดเลือกหรือหาจังหวะเข้าลงทุนในหลักทรัพย์ได้อย่างเหมาะสม

Beta ระดับและทิศทางการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุน โดยเปรียบเทียบกับอัตราการเปลี่ยนแปลงของตลาด Beta น้อยกว่า 1 แสดงว่าหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนน้อยกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด Beta มากกว่า 1 แสดงว่า หลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนมากกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด

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

Yield to Maturity อัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในตราสารหนี้โดยถือจนครบกำหนดอายุ ซึ่งคำนวณจากดอกเบี้ยที่จะได้รับในอนาคตตลอดอายุตราสารและเงินต้นที่จะได้รับคืนนำมาคิดลดเป็นมูลค่าปัจจุบัน โดยใช้วิธีอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมตราสารหนี้ คำนวณจากค่าเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักของ Yield to Maturity ของตราสารหนี้แต่ละตัวที่กองทุนมีการลงทุน และเนื่องจาก Yield to Maturity มีหน่วยมาตรฐานเป็นเปอร์เซ็นต์ต่อปี จึงสามารถนำไปใช้เปรียบเทียบอัตราผลตอบแทนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีนโยบายถือครองตราสารหนี้จนครบกำหนดอายุและมีลักษณะการลงทุนที่ใกล้เคียงกันได้

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน แลนด์ แอนด์ เฮาส์ จำกัด
เลขที่ 1 อาคารคิวเฮาส์ ลุมพินี ชั้น 14 ถนนสาทรใต้
แขวงทุ่งมหาเมฆ เขตสาทร กรุงเทพมหานคร 10120
โทรศัพท์ 02-286-3484 www.lhfund.co.th