



กองทุนเปิด แอล เอช เฟล็กซิเบิลไทยเพื่อความยั่งยืนแบบพิเศษ

LH FLEXIBLE THAILAND ESG EXTRA FUND

LHTHAIESGX

ชนิดเงินลงทุนเดิม

LHTHAIESGX-LT

ประเภทกองทุนรวม/กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมผสม / กองทุนรวมไทยเพื่อความยั่งยืนแบบพิเศษ (Thailand ESG Extra Fund : Thai ESGX) / กองทุนรวมเพื่อความยั่งยืน (SRI Fund) / Cross Investing Fund
- กองทุนที่ลงทุนแบบมีความเสี่ยงทั้งในและต่างประเทศ
- กลุ่มกองทุน Moderate Allocation

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

1. กองทุนมีนโยบายกระจายการลงทุนในหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินอย่างใดอย่างหนึ่งหรือหลายอย่างที่ออกโดยผู้ออกที่เป็นภาครัฐไทยหรือกิจการที่จัดตั้งขึ้นตามกฎหมายไทยที่มีคุณสมบัติด้านความยั่งยืน ดังนี้ และมี net exposure ในทรัพย์สินที่ลงทุนดังกล่าว โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน

1.1 หุ้นที่เป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย และ/หรือ ตลาดหลักทรัพย์ เอ็ม เอ ไอ ที่มีลักษณะดังนี้ โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 65 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน

1.1.1 หุ้นที่เป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET) และ/หรือตลาดหลักทรัพย์ เอ็ม เอ ไอ (mai) หรือกระดาน mai ที่ได้รับการคัดเลือกจาก SET ว่ามีความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน (Environmental, Social and Governance: ESG) และ/หรือ

1.1.2 หุ้นที่เป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET) และ/หรือตลาดหลักทรัพย์ เอ็ม เอ ไอ (mai) หรือกระดาน mai ที่มีการเปิดเผยข้อมูลเกี่ยวกับการปล่อยก๊าซเรือนกระจก แผนการจัดการ และการตั้งเป้าหมายเพื่อให้บรรลุเป้าหมายในการลดปริมาณการปล่อยก๊าซเรือนกระจกของประเทศไทย รวมทั้งจัดให้มีการทวนสอบการจัดทำคาร์บอนฟุตพริ้นท์โดยผู้ทวนสอบที่สำนักงาน ก.ล.ต. ยอมรับ และ/หรือ

1.1.3 หุ้นที่เป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET) และ/หรือตลาดหลักทรัพย์ เอ็ม เอ ไอ (mai) หรือกระดาน mai ที่มีลักษณะดังนี้

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

(1.2) พันธบัตรรัฐบาล พันธบัตรที่กระทรวงการคลังค้ำประกันต้นเงินและดอกเบี้ย หรือหุ้นกู้ที่กระทรวงการคลังค้ำประกันต้นเงินและดอกเบี้ย และ/หรือตราสารหนี้อื่น ๆ ที่เป็นตราสารเพื่ออนุรักษ์สิ่งแวดล้อม (green bond) ตราสารเพื่อความยั่งยืน (sustainability bond) ตราสารส่งเสริมความยั่งยืน (sustainability - linked bond) โดยเป็นไปตามหลักเกณฑ์ที่คณะกรรมการกำกับตลาดทุน คณะกรรมการ ก.ล.ต. หรือสำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ต. ประกาศกำหนด

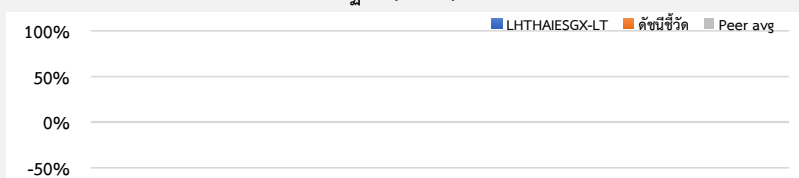
ทั้งนี้ กองทุนจะกำหนดกรอบการลงทุนในตราสารหนี้ โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชี ไม่น้อยกว่าร้อยละ 65 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน และตราสารหนี้ โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่เกินกว่าร้อยละ 35 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน

กองทุนอาจพิจารณาลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) เพื่อเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน (Efficient portfolio management) และ/หรือ เพื่อป้องกันความเสี่ยง (Hedging) จากอัตราแลกเปลี่ยน (Foreign Exchange Rate Risk) ทั้งหมดหรือเกือบทั้งหมด

กองทุนมีการลงทุนในกองทุนรวมอื่นภายใต้ บลจ. เดียวกัน (Cross Investing Fund) ในสัดส่วนไม่เกินร้อยละ 20 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน

กลยุทธ์การบริหารกองทุน (Management Style) : กองทุนมุ่งหวังให้ผลตอบแทนการเคลื่อนไหวสูงกว่าดัชนีชี้วัด (Active Management)

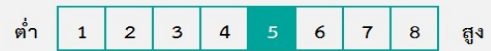
ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปี ปฏิทิน (%ต่อปี)



ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปีกลุ่ม (1%ต่อปี)

	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี ¹
LHTHAIESGX-LT	19.14	0.95	7.78	21.73
ดัชนีชี้วัด	19.23	3.57	11.17	19.03
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	9.03	-0.09	6.00	9.49
ความผันผวนกองทุน	13.83	6.49	8.68	15.47
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	9.43	4.15	5.62	10.58
	3 ปี ¹	5 ปี ¹	10 ปี ¹	ตั้งแต่จัดตั้ง ¹
LHTHAIESGX-LT	N/A	N/A	N/A	15.79
ดัชนีชี้วัด	N/A	N/A	N/A	17.57
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	4.78	1.49	1.55	12.99
ความผันผวนกองทุน	N/A	N/A	N/A	14.91
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	N/A	N/A	N/A	10.99

ระดับความเสี่ยง



เสี่ยงปานกลางค่อนข้างสูง

ลงทุนในตราสารทุน และ/หรือตราสารหนี้

โดยมีสัดส่วนการลงทุนในตราสารทุนน้อยกว่า 80% ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน	9 พฤษภาคม 2568
วันเริ่มต้น class	9 พฤษภาคม 2568
นโยบายการจ่ายเงินปันผล	ไม่มี
อายุกองทุน	ไม่กำหนด
การป้องกันความเสี่ยง FX	ป้องกันทั้งหมด (fully hedged)
การเรียกเก็บค่าธรรมเนียมตามผลการดำเนินงาน	ไม่มี

ผู้จัดการกองทุนรวม

ชื่อ-นามสกุล	วันเริ่มบริหารกองทุน
คุณจารุสร กิจประกอบ	9 พฤษภาคม 2568
คุณณัฐวัตร กิตติสมานคุณ	9 พฤษภาคม 2568

ดัชนีชี้วัด :

- 1) ดัชนีผลตอบแทนรวม SET ESG (SETESG TRI) สัดส่วนร้อยละ 70
- 2) ThaiBMA Government Bond ESG Index Net Total Return สัดส่วนร้อยละ 20
- 3) ThaiBMA Short-term Government Bond Index Total Return สัดส่วนร้อยละ 10

คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวม มิได้เป็นสัญญาณถึงผลการดำเนินงานในอนาคต
- กองทุนที่ไม่เหมาะสมกับผู้ลงทุนที่ต้องการผลตอบแทนอย่างสม่ำเสมอ หรือต้องการรักษาเงินต้น ผู้ลงทุนโปรดศึกษาและลงทุนให้เหมาะสมกับระดับความเสี่ยงที่ยอมรับได้

การเข้าร่วมการต่อต้านทุจริต : ได้รับการรับรองจาก CAC

การจัดอันดับกองทุน Morningstar

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือ
บริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่องได้
ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

www.lhfund.co.th

LHTHAIESGX-LT: หน้า 2 / 10

กองทุนเปิด แอล เอช เฟลิกซ์เบิลไทยเพื่อความยั่งยืนแบบพิเศษ (LHTHAIESGX)

สรุปข้อมูลด้านความยั่งยืน (Sustainability Corner)

(1) ประเภทของกองทุนรวม SRI และเกณฑ์การพิจารณาโดยสรุป

ประเภท SRI ตามวัตถุประสงค์	SRI Focus
เกณฑ์การพิจารณาโดยสรุป	กองทุนพิจารณาลงทุนหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินของภาครัฐไทยหรือกิจการที่จัดตั้งขึ้นตามกฎหมายไทยที่มีคุณสมบัติด้านความยั่งยืน โดยสำหรับตราสารทุนจะพิจารณาเลือกหลักทรัพย์ที่ได้รับ SET ESG Ratings หรือเข้าเงื่อนไขการเปิดเผยข้อมูลก๊าซเรือนกระจก / ธรรมชาติและแผนเพิ่มมูลค่ากิจการหรือ JUMP+ ควบคู่กับการวิเคราะห์ปัจจัย ESG ส่วนตราสารหนี้จะพิจารณาลงทุนใน Green Bond, Sustainability Bond หรือ Sustainability-Linked Bond เพื่อให้บรรลุวัตถุประสงค์ด้านความยั่งยืนของกองทุน
(2) เป้าหมายด้านความยั่งยืนของกองทุนรวม SRI	
เป้าหมายด้านความยั่งยืน	มีเป้าหมายด้านความยั่งยืน แบบไม่เฉพาะเจาะจง (ESG โดยรวม)

(3) กลยุทธ์การลงทุน (เพื่อการบรรลุวัตถุประสงค์ด้านความยั่งยืน)

กลยุทธ์การลงทุนเพื่อบรรลุเป้าหมายด้านความยั่งยืน	- Screening - ESG Integration
เหตุผลและหลักการที่เลือกใช้กลยุทธ์ดังกล่าว	กองทุนมีวัตถุประสงค์ด้านความยั่งยืน โดยเลือกใช้กลยุทธ์การลงทุนแบบ Negative Screening และ ESG Integration สำหรับการลงทุนในตราสารทุน เพื่อคัดกรองหลักทรัพย์ที่ไม่เป็นไปตามหลักการ ESG และผนวกปัจจัยด้านสิ่งแวดล้อม สังคม และธรรมาภิบาล (ESG) เข้ากับกระบวนการวิเคราะห์และ ตัดสินใจลงทุนควบคู่กับการพิจารณาปัจจัยทางการเงิน รวมถึงคัดเลือกตราสารหนี้ด้านความยั่งยืน เช่น Green Bond, Sustainability Bond และ Sustainability - Linked Bond ซึ่งมีวัตถุประสงค์หรือคุณลักษณะที่สนับสนุนการอนุรักษ์สิ่งแวดล้อมและความยั่งยืน เพื่อให้การลงทุนเป็นไปตามวัตถุประสงค์ด้านความยั่งยืนของกองทุน

(4) กรอบการลงทุน

ลักษณะ/ขอบเขตการลงทุนหลัก	ตราสารทุน กองทุนจะเน้นลงทุนในบริษัทจดทะเบียนฯ ที่มีความโดดเด่นในการบริหารจัดการสิ่งแวดล้อม สังคม และธรรมาภิบาล (Environmental, Social and Governance: ESG) ที่ผ่านการคัดเลือกโดยสถาบันที่มีความน่าเชื่อถือ อาทิ เช่น SET ESG Ratings ที่จัดทำโดยตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย หรือผู้ประเมินผลการดำเนินงานด้านความยั่งยืนตามมาตรฐานสากล (ถ้ามี) เป็นต้น โดยทีมผู้จัดการกองทุนจะพิจารณาผนวกการวิเคราะห์ปัจจัยด้าน ESG ในกระบวนการตัดสินใจลงทุน (ESG Integration) ภายใต้กรอบการพิจารณา ดังต่อไปนี้ (1) เป็นบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย และ/หรือตลาดหลักทรัพย์ เอ็ม เอ ไอ (mai) ที่ได้รับการคัดเลือกจากตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย ที่มีการปรับเปลี่ยนกลยุทธ์การดำเนินงานธุรกิจ พัฒนาผลิตภัณฑ์และบริการ หรือปรับปรุงกระบวนการผลิต ตลอดจนห่วงโซ่อุปทาน ซึ่งเป็นผลมาจากการปรับตัวเชิงโครงสร้างเพื่อสอดคล้องกับแนวทางการดำเนินธุรกิจอย่างยั่งยืน และ/หรือ (2) เป็นหุ้นของบริษัทที่ตั้งเป้าหมายในการลดปริมาณการปล่อยก๊าซเรือนกระจกของประเทศไทย และ/หรือหุ้นของบริษัทจดทะเบียนที่มีธรรมาภิบาล (Governance) ไม่น้อยกว่าร้อยละ 65 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน และ/หรือ
---------------------------	---

สรุปข้อมูลด้านความยั่งยืน (Sustainability Corner)

(4) เป็นหุ้นที่เป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET) บนกระดานหลัก หรือกระดาน mai ที่มีลักษณะดังนี้

(4.1) เป็นหุ้นของบริษัทจดทะเบียนที่มีธรรมาภิบาล (Governance) โดยได้รับการประเมินการกำกับดูแลกิจการบริษัทจดทะเบียน (Corporate Governance Report of Thai Listed Companies: CGR) จากสมาคมส่งเสริมสถาบันกรรมการบริษัทไทยตั้งแต่ 90 คะแนนขึ้นไป หรือเทียบเท่า

(4.2) เป็นหุ้นในโครงการส่งเสริมการเพิ่มมูลค่าของบริษัทจดทะเบียน (JUMP+) ของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย ที่มีการเปิดเผยเป้าหมายและแผนการดำเนินงานตามโครงการดังกล่าวแล้ว

ตราสารหนี้

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

ข้อกำหนดเพิ่มเติม

(1) สัดส่วนการลงทุน:

ตารางสัดส่วนการลงทุนตามคุณลักษณะด้านความยั่งยืน (% ของ NAV)

คุณลักษณะด้านความยั่งยืน	สัดส่วน (% ของ NAV)
ตราสารทุน	
หุ้นกลุ่มที่ได้รับการจัดอันดับหรือคะแนนด้านความยั่งยืน	87.96
หุ้นกลุ่มที่เปิดเผยข้อมูลการปล่อยก๊าซเรือนกระจก (GHGs)	87.11
หุ้นกลุ่มที่มีธรรมาภิบาลดีเลิศและมีการเปิดเผยแผนธุรกิจที่เกี่ยวข้องกับการเพิ่มมูลค่าของกิจการ (corporate value up plan)	5.04
ตราสารหนี้	
ตราสารเพื่ออนุรักษ์สิ่งแวดล้อม (green bond)	0.00
ตราสารเพื่อความยั่งยืน (sustainability bond)	4.39
ตราสารส่งเสริมความยั่งยืน (sustainability-linked bond)	0.00
โทเคนดิจิทัลเพื่อการลงทุนกลุ่มความยั่งยืน	
โทเคนดิจิทัลเพื่ออนุรักษ์สิ่งแวดล้อม (green token)	0.00
โทเคนดิจิทัลเพื่อความยั่งยืน (sustainability token)	0.00
โทเคนดิจิทัลเพื่อส่งเสริมความยั่งยืน (sustainability-linked token)	0.00
ทรัพย์สินอื่น ๆ	
หน่วยทรัสต์ของทรัสต์เพื่อการลงทุนในอสังหาริมทรัพย์ที่ได้รับการจัดอันดับหรือคะแนนด้านความยั่งยืน	0.00
หน่วยลงทุนของกองทุนรวมโครงสร้างพื้นฐานที่ได้รับการจัดอันดับหรือคะแนนด้านความยั่งยืน	0.00
ผลรวมสัดส่วนการลงทุน	99.83

ข้อมูล ณ วันที่ 30 กันยายน 2569

หมายเหตุ : สัดส่วนข้างต้นคำนวณจากพอร์ตการลงทุน ณ วันที่ 30 กันยายน 2569 โดยข้อมูล SET ESG Ratings และสถานะ Corporate Value Up/JUMP+ อ้างอิงฐานข้อมูล Thai ESG ณ วันที่ 13 ตุลาคม 2569 ข้อมูลก๊าซเรือนกระจกอ้างอิงฐานข้อมูล GHG Q3/2026 ณ วันที่ 30 กันยายน 2569 และข้อมูล Sustainability Bond อ้างอิงพอร์ตการลงทุน ณ วันที่ 30 กันยายน 2569 ประกอบข้อมูลพันธบัตรรุ่น ESGLB35DA ของสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย ทั้งนี้ รายการแต่ละคุณลักษณะอาจซ้ำกันได้

(2) การแสดงข้อมูลรายละเอียดการลงทุนด้านความยั่งยืน

(2.1) หุ้นกลุ่มที่ได้รับการจัดอันดับหรือคะแนนด้านความยั่งยืน

ตารางสัดส่วนการลงทุนตามอันดับหรือคะแนนด้านสิ่งแวดล้อม หรือความยั่งยืน ของหุ้นกลุ่มที่มีความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อม หรือความยั่งยืน

อันดับหรือคะแนนด้านสิ่งแวดล้อม หรือความยั่งยืน	จำนวนบริษัท	สัดส่วน (% ของ NAV)
AAA	24	66.35
AA	6	21.61
A	0	0.00
BBB	0	0.00
NA	1	7.48
รวม	31	95.44

อันดับหรือคะแนนเฉลี่ยของพอร์ต : อยู่ระหว่างระดับ AA และ AAA โดยมีน้ำหนักเอนเข้าใกล้ระดับ AAA

ข้อมูล ณ วันที่ 30 กันยายน 2569

หมายเหตุ : ข้อมูล SET ESG Ratings อ้างอิงฐานข้อมูล Thai ESG ณ วันที่ 13 ตุลาคม 2569 ขณะที่น้ำหนักการลงทุนอ้างอิงพอร์ต ณ วันที่ 30 กันยายน 2569

(2.2) หุ่นกลุ่มที่เปิดเผยข้อมูลเกี่ยวกับการปล่อยก๊าซเรือนกระจก (“GHGs”) แผนการจัดการ และการตั้งเป้าหมายเพื่อให้บรรลุเป้าหมายในการลดปริมาณการปล่อย GHGs ของ ประเทศไทย รวมทั้งจัดให้มีการทวนสอบการจัดทำคาร์บอนฟุตพริ้นท์โดยผู้ทวนสอบที่สำนักงานยอมรับ

(2.2.1) สถานะการตั้งเป้าหมายการลดการปล่อย GHGs ของบริษัทในพอร์ตการลงทุน

ตารางการตั้งเป้าหมายลดก๊าซเรือนกระจกของหุ่นกลุ่มที่เปิดเผยข้อมูลเกี่ยวกับการปล่อยก๊าซเรือนกระจก ที่กองทุนรวมลงทุน

คุณสมบัติของบริษัทที่ลงทุน	จำนวนบริษัท	สัดส่วน (% ของ NAV)
บริษัทที่มีการตั้งเป้าหมายการลดก๊าซเรือนกระจกระยะสั้นและยาว	25	79.46
บริษัทที่มีการตั้งเป้าหมายการลดก๊าซเรือนกระจกเฉพาะระยะยาว	1	0.97
บริษัทที่มีการตั้งเป้าหมายการลดก๊าซเรือนกระจกเฉพาะระยะสั้น	2	6.68
รวมบริษัทที่เปิดเผยก๊าซเรือนกระจกและมีการตั้งเป้าหมายการลดก๊าซเรือนกระจก	28	87.11

ข้อมูล ณ วันที่ 30 กันยายน 2569

หมายเหตุ : ข้อมูลการเปิดเผยและการตั้งเป้าหมายการลดก๊าซเรือนกระจกอ้างอิงฐานข้อมูล GHG Q3/2026 ของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย และสัดส่วนการลงทุนคำนวณจากพอร์ตการลงทุนของกองทุน ณ วันที่ 30 กันยายน 2569

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

ตารางปริมาณการปล่อยก๊าซเรือนกระจกรวมของหุ่นกลุ่มที่เปิดเผยข้อมูลการปล่อยก๊าซเรือนกระจก ที่กองทุนรวมลงทุน

ตัวชี้วัด	รอบการรายงาน ปีก่อนหน้า	รอบการรายงาน ปีปัจจุบัน (ปี 2568)	การเปลี่ยนแปลง YoY (%)
ปริมาณการปล่อยก๊าซเรือนกระจกรวม (ตัน CO ₂ e)	ไม่มีข้อมูล	239,442,843.03	ไม่สามารถคำนวณได้

ข้อมูล ณ วันที่ 30 กันยายน 2569

ตัวชี้วัดการพัฒนาของบริษัทที่ลงทุน	จำนวนบริษัท	สัดส่วน (% ของ NAV)
บริษัทที่ปริมาณการปล่อยก๊าซเรือนกระจกลดลงจากรอบการรายงานปีก่อนหน้า (YoY)	ไม่มีข้อมูล	ไม่มีข้อมูล
บริษัทที่มีการปรับเป้าหมายการลดก๊าซเรือนกระจก ให้เร็วขึ้น	ไม่มีข้อมูล	ไม่มีข้อมูล

ข้อมูล ณ วันที่ 30 กันยายน 2569

หมายเหตุ :

- ข้อมูลปริมาณการปล่อยก๊าซเรือนกระจกรวมข้างต้น เป็นการเปิดเผยปริมาณการปล่อยก๊าซเรือนกระจกในลักษณะตัวเลขรวม (absolute) ของหุ่นกลุ่มที่เปิดเผยข้อมูลเกี่ยวกับการปล่อยก๊าซเรือนกระจกที่กองทุนรวมถือครอง มิใช่การคำนวณปริมาณการปล่อยก๊าซเรือนกระจกที่กองทุนรวมมีส่วนรับผิดชอบโดยตรง (financed emissions)
- การเปิดเผยปริมาณการปล่อยก๊าซเรือนกระจกรวม มีวัตถุประสงค์เพื่อสร้างความโปร่งใส โดยกองทุนรวมทำหน้าที่เป็นกลไกขับเคลื่อนกิจการให้มีการตั้งเป้าหมายระยะสั้นและยาวในการลดการปล่อยก๊าซเรือนกระจก และผลักดันกิจการให้ดำเนินธุรกิจโดยคำนึงถึงการลดการปล่อยก๊าซเรือนกระจกอย่างต่อเนื่อง
- ผู้ลงทุนควรพิจารณาข้อมูลนี้ร่วมกับปัจจัยอื่น เช่น รายงานการมีส่วนร่วมกับกิจการ (engagement) การใช้สิทธิออกเสียง ในนามกองทุนรวม เป็นต้น เพื่อให้ผู้ลงทุนเห็นภาพรวมของระดับการติดตามกิจการที่ลงทุนของบริษัทจัดการ และผลลัพธ์ ที่ตรวจสอบได้ ในการผลักดันให้กิจการที่ลงทุนลดการปล่อยก๊าซเรือนกระจกอย่างเป็นรูปธรรม

(2.3) หุ้นกลุ่มที่มีธรรมาภิบาลดีเลิศและมีการเปิดเผยแผนเพิ่มมูลค่ากิจการ (Corporate Value Up Plan หรือ JUMP+)

(2.3.1) สัดส่วนการลงทุนตามประเภทแผนการยกระดับการดำเนินงาน:

เปิดเผยสัดส่วนการลงทุนในหุ้นกลุ่ม corporate value up plan ตามประเภทของแผนการยกระดับการดำเนินงานในเรื่องใดเรื่องหนึ่ง ดังนี้

(i) หุ้นกลุ่มที่มีแผนจะเข้ารับการประเมินด้าน E หรือ ESG จากผู้ประเมินฯ

(ii) หุ้นกลุ่มที่มีเป้าหมายและแผนการดำเนินงานเพื่อลดปริมาณ การปล่อย GHGs ของประเทศไทย

ตารางสรุปการลงทุนในหุ้นกลุ่ม Corporate Value Up Plan / JUMP+

ประเภทหุ้นกลุ่ม Corporate Value Up Plan / JUMP+	จำนวนบริษัท	สัดส่วน (% ของ NAV)
หุ้นในโครงการส่งเสริมการเพิ่มมูลค่าของบริษัทจดทะเบียน (JUMP+) ที่เปิดเผยเป้าหมายและแผนการดำเนินงานแล้ว	2	5.04
หุ้นกลุ่ม Corporate Value Up Plan (CVUP) ตามฐานข้อมูลที่ใช้อ้างอิง	0	0.00

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, %)
ไม่มีข้อมูล	ไม่มีข้อมูล	ไม่มีข้อมูล

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
- (3) พอร์ตการลงทุนถือพันธบัตรรัฐบาลเพื่อความยั่งยืนรุ่น ESGLB35DA ในสัดส่วน 4.39% ของ NAV

(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 และการจัดหาเงินเพื่อรองรับผลกระทบจาก COVID-19	4.39
2	-	-	-
3	-	-	-
4	-	-	-
5	-	-	-

ข้อมูล ณ วันที่ 30 กันยายน 2569

หมายเหตุ : ข้อมูลตราสารและสัดส่วนการลงทุนอ้างอิงพอร์ตของกองทุน ณ วันที่ 30 กันยายน 2569 ส่วนประเภทตราสารและวัตถุประสงค์การใช้เงินอ้างอิงข้อมูลพันธบัตรรุ่น ESGLB35DA ของสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย

(2.4.2) สัดส่วนการลงทุนในตราสารหนี้เพื่อความยั่งยืน จำแนกตาม กลุ่มอุตสาหกรรมของผู้ออกตราสาร

ตารางสัดส่วนการลงทุนตามกลุ่มอุตสาหกรรมของผู้ออกตราสารหนี้เพื่อความยั่งยืน

กลุ่มอุตสาหกรรมของผู้ออกตราสารหนี้เพื่อความยั่งยืน	สัดส่วน (% ของ NAV)
ภาครัฐ (กระทรวงการคลัง)	4.39
-	0.00
-	0.00
รวม	4.39

ข้อมูล ณ วันที่ 30 กันยายน 2569

หมายเหตุ : ผู้ออกตราสารคือกระทรวงการคลัง จึงจำแนกอยู่ในกลุ่มภาครัฐ

(2.5) ตราสารหนี้ส่งเสริมความยั่งยืน (Sustainability-Linked Bond)

(2.5.1) รายละเอียดของตัวชี้วัดและเป้าหมายด้านความยั่งยืนที่ผู้ออก ตราสารหนี้ส่งเสริมความยั่งยืนกำหนด

ตารางรายละเอียดของตัวชี้วัดและเป้าหมายด้านความยั่งยืนที่ผู้ออกตราสารหนี้ส่งเสริมความยั่งยืนกำหนด

ลำดับ	ชื่อผู้ออก	ตัวชี้วัดและเป้าหมาย ด้านความยั่งยืน	ระยะเวลาเป้าหมาย	ดอกเบี้ย (%) / อัตราการเพิ่มขึ้นของดอกเบี้ยหากไม่บรรลุเป้าหมาย (bps)	สัดส่วน (% ของ NAV)
-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-
รวม					

ข้อมูล ณ วันที่ 30 กันยายน 2569

หมายเหตุ : ข้อมูลข้างต้นสะท้อนตัวชี้วัดและเป้าหมายด้านความยั่งยืนที่ผู้ออกตราสารหนี้ส่งเสริมความยั่งยืนกำหนด

(2.5.2) สัดส่วนการลงทุนในตราสารหนี้ส่งเสริมความยั่งยืน จำแนกตาม กลุ่มอุตสาหกรรมของผู้ออกตราสารหนี้ส่งเสริมความยั่งยืน

ตารางสัดส่วนการลงทุนตามกลุ่มอุตสาหกรรมของผู้ออกตราสารหนี้ส่งเสริมความยั่งยืน

กลุ่มอุตสาหกรรมของผู้ออกตราสารหนี้ส่งเสริมความยั่งยืน	สัดส่วน (% ของ NAV)
-	-
-	-
-	-
-	-
-	-
รวม	-

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”) และหน่วยลงทุนของกองทุนรวมโครงสร้างพื้นฐาน (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

ข้อมูลอื่น ๆ

1.1 วัตถุประสงค์การลงทุนที่เกี่ยวข้องกับความยั่งยืน

กองทุนมีวัตถุประสงค์ที่จะส่งเสริมการลงทุนเพื่อความยั่งยืนของประเทศไทย โดยจะลงทุนในหุ้นของบริษัทที่ได้รับการคัดเลือกจากตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET) ว่ามีความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน (Environmental, Social and Governance: ESG) และ/หรือหุ้นของบริษัทที่ตั้งเป้าหมายในการลดปริมาณการปล่อยก๊าซเรือนกระจกของประเทศไทย และ/หรือหุ้นของบริษัทจดทะเบียนที่มีธรรมาภิบาล (Governance) ในระดับดีเลิศ ซึ่งต้องได้รับ CGR ซึ่งจัดทำโดย IOD ตั้งแต่ 90 คะแนนเป็นต้นไป นอกจากนี้ กองทุนจะลงทุนในพันธบัตรรัฐบาล พันธบัตรที่กระทรวงการคลังค้าประกันต้นเงินและดอกเบี้ย หรือหุ้นกู้ที่กระทรวงการคลังค้าประกันต้นเงินและดอกเบี้ย และ/หรือตราสารหนี้อื่นๆ ที่เป็นตราสารเพื่ออนุรักษ์สิ่งแวดล้อม (green bond) ตราสารเพื่อความยั่งยืน (sustainability bond) ตราสารส่งเสริมความยั่งยืน (sustainability – linked bond) โดยเป็นไปตามหลักเกณฑ์ที่คณะกรรมการกำกับตลาดทุน คณะกรรมการ ก.ล.ต. หรือสำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ต. ประกาศกำหนด

1.2 เป้าหมายด้านความยั่งยืน (ถ้ามี)

กองทุนจะเน้นลงทุนในบริษัทที่มีผลการดำเนินงานด้านสิ่งแวดล้อม สังคม และธรรมาภิบาล (Environmental, Social and Governance หรือ ESG) โดดเด่น เพื่อสร้างผลตอบแทนอย่างยั่งยืนให้กับผู้ลงทุน และเป็นแรงสนับสนุนให้มิกิจกรรมที่มุ่งเน้นการดำเนินงานด้าน ESG ให้มากขึ้น ส่งผลให้เศรษฐกิจไทยสามารถเติบโตได้อย่างยั่งยืน และยังเป็นอีกกลไกหนึ่งที่ช่วยสนับสนุนบริษัทจดทะเบียน และประเทศไทยให้บรรลุเป้าหมายการพัฒนาที่ยั่งยืน (Sustainable Development Goals: SDGs) ขององค์การสหประชาชาติ รวมถึงช่วยสนับสนุนบริษัทจดทะเบียนที่มีการบริหารจัดการและดำเนินงานด้าน ESG ที่ดีและยังเป็นการส่งเสริมให้บริษัทอื่น ๆ ให้ความสำคัญด้าน ESG

1.3 กรอบการลงทุน (Investment Universe)

ตราสารทุน

กองทุนจะเน้นลงทุนในบริษัทจดทะเบียนที่มีความโดดเด่นในการบริหารจัดการสิ่งแวดล้อม สังคม และธรรมาภิบาล (Environmental, Social and Governance: ESG : ESG) ที่ผ่านการคัดเลือกโดยสถาบันที่มีความน่าเชื่อถือ อาทิเช่น SET ESG Ratings ที่จัดทำโดยตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย โดยที่ผู้จัดการกองทุนจะพิจารณาผนวกการวิเคราะห์ปัจจัยด้าน ESG ในกระบวนการตัดสินใจลงทุน (ESG Integration) ภายใต้กรอบการพิจารณา ดังต่อไปนี้

- เป็นบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย และ/หรือตลาดหลักทรัพย์ เอ็ม เอ ไอ (mai) ที่ได้รับการคัดเลือกจากตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย ที่มีการปรับเปลี่ยนกลยุทธ์การดำเนินงานธุรกิจ พัฒนาผลิตภัณฑ์และบริการ หรือปรับปรุงกระบวนการผลิต ตลอดจนห่วงโซ่อุปทาน ซึ่งเพิ่มผลมาจากการปรับตัวเชิงโครงสร้างเพื่อสอดคล้องกับแนวทางการดำเนินธุรกิจอย่างยั่งยืน และ/หรือ
- และ/หรือหุ้นของบริษัทที่ตั้งเป้าหมายในการลดปริมาณการปล่อยก๊าซเรือนกระจกของประเทศไทย และ/หรือหุ้นของบริษัทจดทะเบียนที่มีธรรมาภิบาล (Governance) ไม่น้อยกว่าร้อยละ 65 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน
- เป็นบริษัทจดทะเบียนที่มีการเตรียมตัวและตอบสนองต่อการเปลี่ยนแปลงจากนโยบายภาครัฐหรือกฎระเบียบต่าง ๆ ในอนาคต และ/หรือ
- เป็นหุ้นของบริษัทจดทะเบียนที่มีธรรมาภิบาล (Governance) โดยได้รับการประเมินการกำกับดูแลกิจการบริษัทจดทะเบียน (Corporate Governance Report of Thai Listed Companies: CGR) จากสมาคมส่งเสริมสถาบันกรรมการบริษัทไทย ตั้งแต่ 90 คะแนนขึ้นไป หรือเทียบเท่า

ตราสารหนี้

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

การอ้างอิงดัชนีชี้วัดที่สอดคล้องกับความยั่งยืน (Investment Benchmark)

ดัชนีชี้วัด (Benchmark) ของกองทุนนี้ คือ

1) ดัชนีผลตอบแทนรวม SET ESG (SETESG TRI) ดังกล่าวมีแนวทางในการคัดเลือกหุ้นเพื่อเป็นองค์ประกอบของดัชนี ดังนี้ 1. เป็นบริษัทที่อยู่ในรายชื่อหุ้นยั่งยืนปีล่าสุดซึ่งจะเปลี่ยนในตลาดหลักทรัพย์ฯ 2. เป็นหลักทรัพย์ที่มีมูลค่าหลักทรัพย์ตามราคาตลาด (Market Capitalization) ไม่น้อยกว่า 5,000 ล้านบาท 3. มีสัดส่วนผู้ถือหลักทรัพย์รายย่อย (Free-float) ไม่น้อยกว่า 20% ของทุนชำระแล้ว 4. จำนวนหุ้นซื้อขาย ไม่น้อยกว่า 0.5% ของจำนวนหุ้นจดทะเบียนของบริษัท เป็นเวลาไม่ต่ำกว่า 9 ใน 12 เดือน 5. ไม่จำกัดจำนวนหลักทรัพย์ในดัชนี

ดัชนีดังกล่าวจึงเป็นดัชนีที่เหมาะสมภายใต้กรอบการลงทุนด้านความยั่งยืนของกองทุน อีกทั้งบริษัทที่เป็นองค์ประกอบของดัชนี SETESG เป็นบริษัทที่มีสภาพคล่องตามหลักเกณฑ์ที่ SET กำหนด และมีการเปิดเผยข้อมูลเพื่อนำไปใช้ในการวิเคราะห์ได้อย่างเพียงพอ / นอกจากนี้ ผู้ลงทุนสามารถศึกษาวิธีการจัดทำดัชนี (Index Methodologies) ได้ที่ : <https://www.set.or.th/th/market/index/setesg/profile/แหล่งข้อมูล> : www.set.or.th

2) ดัชนี ThaiBMA Government Bond ESG Index Net Total Return เนื่องจากเป็นดัชนีที่รวมตราสารหนี้ ESG ที่ออกโดยภาครัฐที่ขึ้นทะเบียนกับสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย (ThaiBMA) โดยเป็นไปตามกรอบนโยบายการลงทุนในตราสารเพื่อการอนุรักษ์สิ่งแวดล้อมหรือความยั่งยืน / ผู้ลงทุนสามารถศึกษาวิธีการจัดทำดัชนีที่รวมตราสารหนี้ ESG ได้ที่สมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย <https://www.thaibma.or.th/pdf/Article/esgBondIndex.pdf>

3) ดัชนี ThaiBMA Short-term Government Bond Index Total Return เนื่องจากเป็นดัชนีที่รวมตราสารหนี้ประเภทพันธบัตรรัฐบาลระยะสั้นที่ออกโดยกระทรวงการคลังและธนาคารแห่งประเทศไทย จึงเป็นดัชนีที่สะท้อนการลงทุนเพื่อเพิ่มโอกาสในการสร้างผลตอบแทนของกองทุน / ผู้ลงทุนสามารถศึกษาคุณลักษณะและองค์ประกอบของดัชนี รวมถึงวิธีการจัดทำดัชนีดังกล่าวได้ที่สมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย หรือ https://www.thaibma.or.th/pdf/remark_ThaiBMA/ShorttermGovernmentBondIndex.pdf

คำอธิบาย

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

Recovering Period ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาตั้งแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่คืนกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลาเท่าใด

FX Hedging เปอร์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลานึง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 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 หมายถึงกองทุนมีประสิทธิภาพในการสร้างผลตอบแทนให้ใกล้เคียงกับดัชนีชี้วัด กองทุนรวมที่มีค่า tracking error สูง จะมีอัตราผลตอบแทนโดยเฉลี่ยห่างจากดัชนีชี้วัดมากขึ้น

Yield to Maturity อัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในตราสารหนี้โดยถือจนครบกำหนดอายุ ซึ่งคำนวณจากดอกเบี้ยที่จะได้รับในอนาคตตลอดอายุตราสารและเงินต้นที่จะได้รับคืนนำมาคิดลดเป็นมูลค่าปัจจุบัน โดยใช้ตัวอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมตราสารหนี้ ค่ารวมจากค่าเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักของ Yield to Maturity ของตราสารหนี้แต่ละตัวที่กองทุนมีการลงทุน และเนื่องจาก Yield to Maturity มีหน่วยมาตรฐานเป็นเปอร์เซ็นต์ต่อปี จึงสามารถนำไปใช้เปรียบเทียบอัตราผลตอบแทนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีนโยบายถือครองตราสารหนี้จนครบกำหนดอายุและมีลักษณะการลงทุนที่ใกล้เคียงกันได้

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