บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน แลนด์ แอนด์ เฮ้าส์ จำกัด

ข้อมูล ณ วันที่ 30 ตุลาคม 2569

# 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

**ระดับความเสี่ยง**

ต่ำ | 1 | 2 | **3** | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | สูง

**เสี่ยงปานกลางค่อนข้างต่ำ**

ลงทุนในตราสารภาครัฐไทย โดยมี net exposure โดยเฉลี่ยรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของ NAV

## นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- กองทุนมีนโยบายลงทุนในตราสารภาครัฐไทย อาทิ ตั๋วเงินคลัง พันธบัตรรัฐบาล พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย พันธบัตร ตั๋วแลกเงิน ตั๋วสัญญาใช้เงิน หุ้นกู้ ทีกระทรวงการคลังหรือกองทุนฟื้นฟูเป็นผู้ออก ผู้สั่งจ่าย ผู้รับรอง ผู้รับอาวัล ผู้สลักหลัง หรือผู้ค้ำประกันแล้วแต่กรณี ทั้งนี้ กองทุนจะเน้นลงทุนในพันธบัตรรัฐบาล พันธบัตรทีกระทรวงการคลังค้ำประกันต้นเงินและดอกเบี้ย หรือหุ้นกู้ ที่กระทรวงการคลังค้ำประกันต้นเงินและดอกเบี้ย แต่ไม่รวมถึงหุ้นกู้แปลงสภาพ ซึ่งเป็นพันธบัตร หรือหุ้นกู้เพื่ออนุรักษ์สิ่งแวดล้อม (Green bond) พันธบัตรหรือ หุ้นกู้เพื่อความยั่งยืน (Sustainability bond) หรือพันธบัตรหรือหุ้นกู้ส่งเสริมความยั่งยืน (Sustainability-linked bond) โดยมีฐานะการลงทุนสุทธิ (net exposure) ในทรัพย์สินที่ลงทุนดังกล่าวโดยเฉลี่ยรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน
- กองทุนอาจลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมที่อยู่ภายใต้การจัดการของบริษัทจัดการในสัดส่วนไม่เกินร้อยละ 20 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน
- กองทุนมุ่งหวังให้ผลประกอบการสูงกว่าดัชนีชี้วัด (Active Management)

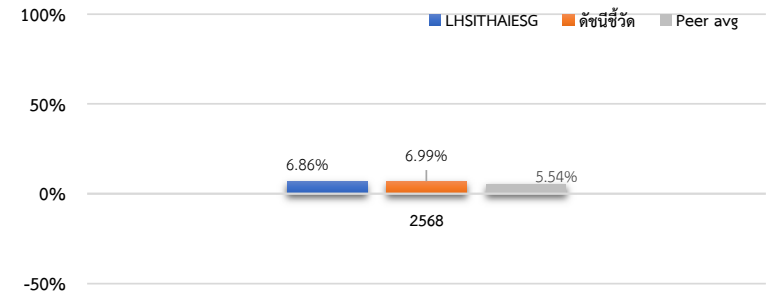
**ข้อมูลกองทุนรวม**

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

**ผู้จัดการกองทุนรวม**

| ชื่อ-นามสกุล | วันเริ่มบริหารกองทุน |
|---|---|
| คุณพัชสกันณ์ ธนวรกิจสกุล | 29 พฤศจิกายน 2567 |
| คุณพรเพ็ญ ชุลีประเสริฐ | 29 พฤศจิกายน 2567 |

**ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปี ปฏิทิน (%ต่อปี)**




**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

**ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด ([1]%ต่อปี)**

| | YTD | 3 เดือน | 6 เดือน | 1 ปี[1] |
|---|---|---|---|---|
| LHSITHAIESG | -2.10 | 0.22 | 1.60 | -1.46 |
| ดัชนีชี้วัด | -2.22 | 0.61 | 1.96 | -1.47 |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน | -1.72 | 0.44 | 1.39 | -1.09 |
| ความผันผวนกองทุน | 5.06 | 1.86 | 2.96 | 5.34 |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด | 4.90 | 1.66 | 2.75 | 5.20 |

| | 3 ปี[1] | 5 ปี[1] | 10 ปี[1] | ตั้งแต่จัดตั้ง[1] |
|---|---|---|---|---|
| LHSITHAIESG | N/A | N/A | N/A | 2.21 |
| ดัชนีชี้วัด | N/A | N/A | N/A | 2.69 |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน | 3.05 | 1.76 | 1.58 | N/A |
| ความผันผวนกองทุน | N/A | N/A | N/A | 5.05 |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด | N/A | N/A | N/A | 4.67 |

**คำเตือน**

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวม มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต
- กองทุนที่ไม่เหมาะสมกับผู้ลงทุนที่ต้องการผลตอบแทนอย่างสม่ำเสมอ หรือต้องการรักษาเงินต้น ผู้ลงทุนโปรดศึกษาและลงทุนให้เหมาะกับระดับความเสี่ยงที่ยอมรับได้

**การเข้าร่วมการต่อต้านทุจริต :** ได้รับการรับรองจาก CAC

**การจัดอันดับกองทุน Morningstar**

**ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือบริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่องได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม**

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

www.lhfund.co.th

**การซื้อหน่วยลงทุน**

| | |
|---|---|
| วันทำการซื้อ : | ทุกวันทำการ |
| เวลาทำการ : | 8.30 - 15.30 น |
| การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ : | ไม่กำหนด |
| การซื้อครั้งถัดไปขั้นต่ำ : | ไม่กำหนด |

**การขายคืนหน่วยลงทุน**

| | |
|---|---|
| วันทำการขายคืน : | ทุกวันทำการ |
| เวลาทำการ : | 8.30 - 15.30 น |
| การขายคืนขั้นต่ำ : | ไม่กำหนด |
| ยอดคงเหลือขั้นต่ำ : | ไม่กำหนด |
| ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน* : | T+1 |

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

**ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)** ค่าธรรมเนียมต่อไปนี้จะส่งผลกระทบต่อผู้ลงทุน เนื่องจากจะทำให้ผลตอบแทนจากการลงทุนลดลง 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 โดยกองทุนปลายทางจะไม่มีการเรียกเก็บค่าธรรมเนียมดังกล่าวเพิ่มเติมอีก เป็นต้น

* สามารถดูข้อมูลเพิ่มเติมได้ที่ www.lhfund.co.th

**ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)** ผู้ลงทุนจะถูกเรียกเก็บค่าธรรมเนียมต่อไปนี้โดยตรงทุกครั้ง เมื่อทำรายการซื้อขายหรือสับเปลี่ยนหน่วยลงทุน

| 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

**ข้อมูลเชิงสถิติ**

| | |
|---|---|
| Maximum Drawdown | -8.90% |
| Recovering Period | N/A |
| FX Hedging | N/A |
| อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน | 0.4622 |
| Sharpe Ratio | N/A |
| Alpha | N/A |
| Beta | N/A |
| Tracking Error | N/A |
| อายุเฉลี่ยของตราสารหนี้ | 7 ปี 10 เดือน |
| Yield to Maturity | 1.98 |

**การจัดสรรการลงทุนในต่างประเทศ**

**หมายเหตุ :**

**การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม / ผู้ออกตราสาร 5 อันดับแรก**

| | |
|---|---|
| MINISTRY OF FINANCE | 88.07 |
| BANK OF THAILAND | 8.13 |
| KRUNG THAI BANK PUBLIC COMPANY LIMITED | 4.11 |
| อื่นๆ | -0.31 |

**หมายเหตุ :** การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม 5 อันดับแรก

**สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน**

| | |
|---|---|
| พันธบัตรรัฐบาล | 88.07% |
| พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย | 8.13% |
| เงินฝากธนาคาร | 4.11% |
| อื่นๆ | -0.31% |

**ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก**

| | |
|---|---|
| พันธบัตรรัฐบาลเพื่อความยั่งยืนสำหรับบริหารหนี้ให้กู้ต่อในปีงบประมาณ พ.ศ. 2563 ครั้งที่ 1 | 52.66% |
| พันธบัตรรัฐบาลเพื่อความยั่งยืนสำหรับปรับโครงสร้างหนี้ (พ.ร.ก.กู้เงินโควิด-19) ในปีงบประมาณ พ.ศ. 2565 | 22.76% |
| พันธบัตรรัฐบาลส่งเสริมความยั่งยืน ในปีงบประมาณ พ.ศ. 2568 ครั้งที่ 1 | 12.65% |
| บัญชีเงินฝากออมทรัพย์ ธนาคารกรุงไทย จำกัด (มหาชน) | 4.11% |
| พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 11/364/68 | 4.06% |

**การจัดสรรการลงทุนตามอันดับความน่าเชื่อถือ (%)**

| | ในประเทศ | national | international |
|---|---|---|---|
| GOV Bond/ AAA | 100.31% | | |
| 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 โดยมุ่งคัดเลือกพันธบัตรหรือหุ้นกู้ที่มีการระดมทุนเพื่อสนับสนุนการระดมทุนเพื่อสิ่งแวดล้อม 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 โดยเลือกใช้กลยุทธ์การลงทุนแบบScreening สำหรับการลงทุนในตราสารหนี้เพื่อคัดเลือกตราสารที่มีคุณลักษณะด้านความยั่งยืนและสอดคล้องกับวัตถุประสงค์ด้านความยั่งยืนของกองทุน โดยนำปัจจัยด้านสิ่งแวดล้อม สังคม และธรรมาภิบาล (ESG) มาประกอบการวิเคราะห์และตัดสินใจลงทุน ควบคู่กับการพิจารณาปัจจัยทางการเงิน รวมถึงคัดเลือกตราสารหนี้ด้านความยั่งยืน เช่น Green Bond, Sustainability Bond และ Sustainability-Linked Bond ซึ่งมีวัตถุประสงค์หรือคุณลักษณะที่สนับสนุนการอนุรักษ์สิ่งแวดล้อมและความยั่งยืน เพื่อให้การลงทุนเป็นไปตามวัตถุประสงค์ด้านความยั่งยืนของกองทุน |
| **(4) กรอบการลงทุน** | |
| **ลักษณะ/ขอบเขตการลงทุนหลัก** | กองทุนจะลงทุนในพันธบัตรรัฐบาล พันธบัตร หรือหุ้นกู้ที่กระทรวงการคลังค้ำประกันต้นเงินและดอกเบี้ย (ต่อไปเรียกว่า “ตราสาร”) ซึ่งเป็นตราสารเพื่ออนุรักษ์สิ่งแวดล้อม (Green Bond) ตราสารเพื่อความยั่งยืน (Sustainability Bond) หรือตราสารส่งเสริมความยั่งยืน (Sustainability-Linked Bond) ที่ออกเพื่อนำเงินไปลงทุนหรือชำระหนี้เดิม (re-financing) ในโครงการที่เกี่ยวข้องกับการอนุรักษ์สิ่งแวดล้อม หรือความยั่งยืน โดยมีฐานะการลงทุนสุทธิ (Net exposure) เฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่า 80% มูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน<br>โดยภาพรวมของกรอบการลงทุนของกองทุน ทั้งในด้านประเภทหลักทรัพย์คุณสมบัติผู้ออก กลุ่มอุตสาหกรรม และขอบเขตประเทศ เอื้อต่อการใช้กระบวนการผนวกปัจจัยด้านสิ่งแวดล้อม สังคม และธรรมาภิบาล (ESG Integration) อย่างเป็นระบบ โดยสามารถนำข้อมูล ESG มาประกอบการวิเคราะห์ตราสารและผู้ออกตราสารตลอดจนประเมินปัจจัย ESG ควบคู่กับปัจจัยทางการเงิน เพื่อสนับสนุนการตัดสินใจลงทุน |

## ข้อกำหนดเพิ่มเติม

**(1) สัดส่วนการลงทุน:**

**ตารางสัดส่วนการลงทุนตามคุณลักษณะด้านความยั่งยืน (% ของ NAV)**

| คุณลักษณะด้านความยั่งยืน | สัดส่วน (% ของ NAV) |
|---|---|
| **ตราสารทุน** | - |
| หุ้นกลุ่มที่ได้รับการจัดอันดับหรือคะแนนด้านความยั่งยืน | - |
| หุ้นกลุ่มที่เปิดเผยข้อมูลการปล่อยก๊าซเรือนกระจก (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 ตุลาคม 2569

**หมายเหตุ :** กองทุนไม่มีการลงทุนในตราสารทุน

**(2.2) หุ้นกลุ่มที่เปิดเผยข้อมูลเกี่ยวกับการปล่อยก๊าซเรือนกระจก (“GHGs”) แผนการจัดการ และการตั้งเป้าหมายเพื่อให้บรรลุเป้าหมายในการลดปริมาณการปล่อย GHGs ของ ประเทศไทย รวมทั้งจัดให้มีการทวนสอบการจัดทำคาร์บอนฟุตพริ้นท์โดยผู้ทวนสอบที่สำนักงานยอมรับ**

**(2.2.1) สถานะการตั้งเป้าหมายการลดการปล่อย GHGs ของบริษัทในพอร์ตการลงทุน**

**ตารางการตั้งเป้าหมายลดก๊าซเรือนกระจกของหุ้นกลุ่มที่เปิดเผยข้อมูลเกี่ยวกับการปล่อยก๊าซเรือนกระจก ที่กองทุนรวมลงทุน**

| คุณสมบัติของบริษัทที่ลงทุน | จำนวนบริษัท | สัดส่วน (% ของ NAV) |
|---|---|---|
| บริษัทที่มีการตั้งปีเป้าหมายการลดก๊าซเรือนกระจกระยะสั้นและยาว | - | - |
| บริษัทที่มีการตั้งปีเป้าหมายการลดก๊าซเรือนกระจกเฉพาะระยะยาว | - | - |
| บริษัทที่มีการตั้งปีเป้าหมายการลดก๊าซเรือนกระจกเฉพาะระยะสั้น | - | - |
| รวมบริษัทที่เปิดเผยก๊าซเรือนกระจกและมีการตั้งปีเป้าหมายการลดก๊าซเรือนกระจก | - | - |

ข้อมูล ณ วันที่ 30 ตุลาคม 2569

**หมายเหตุ : ไม่มีการลงทุนในตราสารทุน**

**(2.2.2) ข้อมูลการปล่อยก๊าซเรือนกระจกรวม** (ตันคาร์บอนไดออกไซด์เทียบเท่า: "ตัน $CO_2e$")[2] ของพอร์ตการลงทุนในภาพรวม และตัวชี้วัดเชิงคุณภาพที่เกี่ยวข้อง โดยเปรียบเทียบข้อมูลระหว่างรอบการรายงานปัจจุบันกับรอบการรายงานปีก่อนหน้า (หากมีข้อมูล) ภายใต้รูปแบบตารางที่กำหนด ดังนี้

**ตารางปริมาณการปล่อยก๊าซเรือนกระจกรวมของหุ้นกลุ่มที่เปิดเผยข้อมูลการปล่อยก๊าซเรือนกระจก ที่กองทุนรวมลงทุน**

| ตัวชี้วัด | รอบการรายงาน ปีก่อนหน้า | รอบการรายงาน ปีปัจจุบัน (ปี 2568) | การเปลี่ยนแปลง YoY (%) |
|---|---|---|---|
| **ปริมาณการปล่อยก๊าซเรือนกระจกรวม (ตัน $CO_2e$)** | - | - | - |

ข้อมูล ณ วันที่ 30 ตุลาคม 2569

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

ข้อมูล ณ วันที่ 30 ตุลาคม 2569

**หมายเหตุ :**

(1) ข้อมูลปริมาณการปล่อยก๊าซเรือนกระจกรวมข้างต้น เป็นการเปิดเผยปริมาณการปล่อยก๊าซเรือนกระจกในลักษณะตัวเลขรวม (absolute) ของหุ้นกลุ่มที่เปิดเผยข้อมูลเกี่ยวกับการปล่อยก๊าซเรือนกระจกที่กองทุนรวมถือครอง มิใช่การคำนวณปริมาณการปล่อยก๊าซเรือนกระจกที่กองทุนรวมมีส่วนรับผิดชอบโดยตรง (financed emissions)

(2) การเปิดเผยปริมาณการปล่อยก๊าซเรือนกระจกรวม มีวัตถุประสงค์เพื่อสร้างความโปร่งใส โดยกองทุนรวมทำหน้าที่เป็นกลไกขับเคลื่อนกิจการให้มีการตั้งเป้าหมายระยะสั้นและยาวในการลดการปล่อยก๊าซเรือนกระจก และผลักดันกิจการให้ดำเนินธุรกิจโดยคำนึงถึงการลดการปล่อยก๊าซเรือนกระจกอย่างต่อเนื่อง

(3) ผู้ลงทุนควรพิจารณาข้อมูลนี้ร่วมกับปัจจัยอื่น เช่น รายงานการมีส่วนร่วมกับกิจการ (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

(i) หุ้นกลุ่มที่มีแผนจะเข้ารับการประเมินด้าน E หรือ ESG จากผู้ประเมินฯ

(ii) 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 ตุลาคม 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 ตุลาคม 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 | 52.84% |
| 2 | ESGLB376A - พันธบัตรรัฐบาลเพื่อความยั่งยืน | ปรับโครงสร้างหนี้ตาม พ.ร.ก. กู้เงินโควิด-19 | 22.84% |
| 3 | - | - | - |
| 4 | - | - | - |
| 5 | - | - | - |

ข้อมูล ณ วันที่ 30 ตุลาคม 2569

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

**(2.4.2) สัดส่วนการลงทุนในตราสารหนี้เพื่อความยั่งยืน จำแนกตาม กลุ่มอุตสาหกรรมของผู้ออกตราสาร**

**ตารางสัดส่วนการลงทุนตามกลุ่มอุตสาหกรรมของผู้ออกตราสารหนี้เพื่อความยั่งยืน**

| กลุ่มอุตสาหกรรมของผู้ออกตราสารหนี้เพื่อความยั่งยืน | สัดส่วน (% ของ NAV) |
|---|---|
| ภาครัฐ / กระทรวงการคลัง | 75.68% |
| - | - |
| - | - |
| **รวม** | **75.68%** |

ข้อมูล ณ วันที่ 30 ตุลาคม 2569

**(2.5) ตราสารหนี้ส่งเสริมความยั่งยืน (Sustainability-Linked Bond)**

**(2.5.1) รายละเอียดของตัวชี้วัดและเป้าหมายด้านความยั่งยืนที่ผู้ออก ตราสารหนี้ส่งเสริมความยั่งยืนกำหนด**

**ตารางรายละเอียดของตัวชี้วัดและเป้าหมายด้านความยั่งยืนที่ผู้ออกตราสารหนี้ส่งเสริมความยั่งยืนกำหนด**

| ลำดับ | ชื่อผู้ออก | ตัวชี้วัดและเป้าหมาย ด้านความยั่งยืน | ระยะเวลาเป้าหมาย | ดอกเบี้ย (%)/ อัตราการเพิ่มขึ้นของดอกเบี้ยหากไม่บรรลุเป้าหมาย (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 | 12.70% |
| | - | - | - | - | - |
| | - | - | - | - | - |
| **รวม** | | | | | **12.70%** |

ข้อมูล ณ วันที่ 30 ตุลาคม 2569

**หมายเหตุ :** ข้อมูลข้างต้นสะท้อนตัวชี้วัดและเป้าหมายด้านความยั่งยืนที่ผู้ออกตราสารหนี้ส่งเสริมความยั่งยืนกำหนด

**(2.5.2) สัดส่วนการลงทุนในตราสารหนี้ส่งเสริมความยั่งยืน จำแนกตาม กลุ่มอุตสาหกรรมของผู้ออกตราสารหนี้ส่งเสริมความยั่งยืน**

**ตารางสัดส่วนการลงทุนตามกลุ่มอุตสาหกรรมของผู้ออกตราสารหนี้ส่งเสริมความยั่งยืน**

| กลุ่มอุตสาหกรรมของผู้ออกตราสารหนี้ส่งเสริมความยั่งยืน | สัดส่วน (% ของ NAV) |
|---|---|
| ภาครัฐ / กระทรวงการคลัง | 12.70% |
| - | - |
| - | - |
| - | - |
| - | - |
| **รวม** | **12.70%** |

ข้อมูล ณ วันที่ 30 ตุลาคม 2569

**(2.6) โทเคนดิจิทัลเพื่อการลงทุนกลุ่มความยั่งยืน**

**ตารางรายละเอียดด้านความยั่งยืนของโทเคนดิจิทัลเพื่อการลงทุนกลุ่มความยั่งยืน ที่ลงทุนสูงสุด 5 อันดับแรก**

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

ข้อมูล ณ วันที่ 30 ตุลาคม 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 ตุลาคม 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 และธรรมมาภิบาล (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** เปอร์เซ็นต์ผลขาดทุนสูงสุดของกองทุนรวมในระยะเวลา 5 ปีย้อนหลัง (หรือตั้งแต่จัดตั้งกองทุนกรณีที่ยังไม่ครบ 5 ปี) โดยวัดจากระดับ NAV ต่อหน่วยที่จุดสูงสุดไปจนถึงจุดต่ำสุดในช่วงที่ NAV ต่อหน่วยปรับตัวลดลง ค่า Maximum Drawdown เป็นข้อมูลที่ช่วยให้ทราบถึงความเสี่ยงที่อาจจะขาดทุนจากการลงทุนในกองทุนรวม

**Recovering Period** ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาตั้งแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลานานเท่าใด

**FX Hedging** เปอร์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

**อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน** ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตกองทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลาหนึ่ง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อหลักทรัพย์กับผลรวมของมูลค่าการขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 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 สูงกว่าจะเป็นกองทุนที่มีประสิทธิภาพในการบริหารจัดการลงทุนที่ดีกว่าเนื่องจากได้รับผลตอบแทนส่วนเพิ่มที่สูงกว่าภายใต้ระดับความเสี่ยงเดียวกัน

**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 โดยใช้วัดอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมตราสารหนี้ คำนวณจากค่าเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักของ 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**