

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ทาลิส จำกัด

ข้อมูล ณ วันที่ 30 ก.ย. 2568



กองทุนเปิด MEGA 20 ไทยเพื่อความยั่งยืน

SRI Fund

MEGA20THAIESG

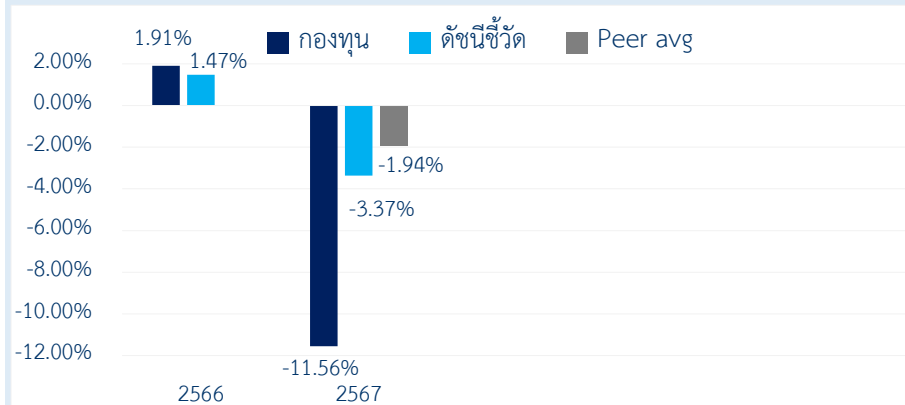
ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมตราสารทุน / กองทุนรวมไทยเพื่อความยั่งยืน (ThaiESG) / กองทุนรวมเพื่อความยั่งยืน (SRI Fund) / กองทุนที่ลงทุนแบบไม่มีความเสี่ยงต่างประเทศ
- กลุ่ม Equity Large Cap

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- ลงทุนในหุ้นของบริษัทที่ได้รับการประเมินยอมรับว่ามีความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน (Environmental, Social and Governance: ESG) จาก SET โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV ตามหลักเกณฑ์การคัดเลือกที่บริษัทจัดการกำหนด (รายละเอียดเพิ่มเติมในข้อมูลอื่น ๆ หน้า 4)
- กองทุนมีกลยุทธ์การลงทุนในตราสารทุนตามหลักเกณฑ์การคัดเลือกหลักทรัพย์และการบริหารจัดการที่กำหนด (Rules based Approach) โดยมุ่งหวังให้ผลประโยชน์การเคลื่อนไหวสูงกว่าดัชนีชี้วัดในระยะยาว

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (%ต่อปี)



หมายเหตุ: ปีที่เริ่มต้นกองทุน ผลการดำเนินงานกองทุนและดัชนีชี้วัดจะแสดงตั้งแต่วันที่จดทะเบียนกองทุน/วันเริ่มต้น class จนถึงสิ้นปีปฏิทิน และเนื่องจากมีระยะเวลาไม่ถึง 1 ปี จึงไม่มีค่า Peer avg ในระยะเวลาดังกล่าว

ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด (%ต่อปี*)

	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี*
กองทุน	-7.49	12.07	3.19	-14.48
ดัชนีชี้วัด	-3.58	16.87	11.35	-10.23
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	-6.47	14.85	9.26	-10.15
ความผันผวนกองทุน	18.49	14.76	19.11	17.03
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	19.80	15.87	20.90	18.28
	3 ปี*	5 ปี*	10 ปี*	ตั้งแต่จัดตั้ง*
กองทุน	N/A	N/A	N/A	-9.67
ดัชนีชี้วัด	N/A	N/A	N/A	-3.09
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	N/A	N/A	N/A	N/A
ความผันผวนกองทุน	N/A	N/A	N/A	15.16
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	N/A	N/A	N/A	15.81

ระดับความเสี่ยง

ต่ำ 1 2 3 4 5 6 7 8 สูง

เสี่ยงสูง

ลงทุนในตราสารทุนเป็นหลักโดยเฉลี่ย
ในรอบปีไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน	18 ธ.ค. 2566
นโยบายการจ่ายเงินปันผล	ไม่จ่าย
อายุกองทุน	ไม่กำหนด

ผู้จัดการกองทุนรวม

นาย วีระพล สิมะโรจน์ (ตั้งแต่ 18 ธ.ค. 2566)

นาย บุญประสิทธิ์ ไรจน์พฤกษ์ (ตั้งแต่ 18 ธ.ค. 2566)

ดัชนีชี้วัด :

ดัชนีผลตอบแทนรวม SETESG (SETESG TRI) สัดส่วน 100%

วัตถุประสงค์ในการอ้างอิงดัชนีชี้วัด : เพื่อเปรียบเทียบกับผลการดำเนินงานของกองทุน

คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวม มิได้เป็นสิ่งที่ยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต: ได้รับการรับรองจาก CAC
จัดอันดับกองทุน Morningstar

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



"ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือ
บริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่อง
ได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม"

www.talisam.co.th

การซื้อขายหน่วยลงทุน	การขายคืนหน่วยลงทุน
วันทำการซื้อ : ทุกวันทำการ	วันทำการขายคืน : ทุกวันทำการ
เวลาทำการ : 8.30 น. - 15.30 น.	เวลาทำการ : 8.30 น. - 15.30 น.
การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ : 1,000 บาท	การขายคืนขั้นต่ำ : ไม่กำหนด
การซื้อครั้งถัดไปขั้นต่ำ : 1 บาท	ยอดคงเหลือขั้นต่ำ : ไม่กำหนด
	ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน : T+3

หมายเหตุ สำหรับผู้ลงทุนที่ซื้อหน่วยลงทุนและปฏิบัติตามหลักเกณฑ์ วิธีการ และเงื่อนไขที่ประกาศอธิบดีกรมสรรพากร และกฎหมายอื่นใดที่เกี่ยวข้องกำหนดทั้งในปัจจุบันและที่แก้ไขเพิ่มเติมในอนาคตจึงจะได้รับสิทธิประโยชน์ทางภาษี ทั้งนี้ผู้ลงทุนควรศึกษาเงื่อนไขการลงทุนในกองทุนรวมไทยเพื่อความยั่งยืนและคู่มือการลงทุนให้เข้าใจก่อนการลงทุน

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)		
ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	1.6050	1.6050
รวมค่าใช้จ่าย	2.3754	1.8214

หมายเหตุ 1) ค่าธรรมเนียมหรือค่าใช้จ่ายดังกล่าวได้รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะ หรือภาษีอื่นใดแล้ว
2) ค่าใช้จ่ายรวมที่เรียกเก็บจริง เป็นข้อมูลของรอบระยะเวลาบัญชี วันที่ 18 ธ.ค. 66 - 30 พ.ย. 67
3) สามารถดูค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวมย้อนหลัง 3 ปี ในหนังสือชี้ชวนส่วนข้อมูลกองทุนรวมได้ที่ www.talisam.co.th
4) บริษัทอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)		
ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การขาย	1.50	ยกเว้น
การรับซื้อคืน	1.50	ยกเว้น
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า	1.50	ยกเว้น
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก	1.50*	ยกเว้น*
การโอนหน่วย	ไม่มี	ไม่มี

หมายเหตุ (1) ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ลงทุนได้รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะ หรือภาษีอื่นใดแล้ว โดยบริษัทจัดการอาจเรียกเก็บค่าธรรมเนียมจากผู้ลงทุนโดยตรง (2) ค่าธรรมเนียมการขาย/การรับซื้อคืน/การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนอาจเรียกเก็บจากผู้ถือหน่วยลงทุนแต่ละกลุ่มหรือแต่ละรายในอัตราที่ไม่เท่ากัน โดยบริษัทจัดการจะแจ้งรายละเอียดและหลักเกณฑ์ให้ทราบต่อไป (3)* ค่าธรรมเนียมการสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนไปกองทุน ThaiESG ภายใต้การจัดการของบลจ.อื่นมีค่าธรรมเนียมสูงสุดไม่เกิน 1.50%/ขั้นต่ำ 200 บาท และเรียกเก็บเป็นเงินสด โดยเรียกเก็บจริง 200 บาทต่อรายการ (3)* ค่าธรรมเนียมการสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนไปกองทุน ThaiESG ภายใต้การจัดการของบลจ.อื่นมีค่าธรรมเนียมสูงสุดไม่เกิน 1.50%/ขั้นต่ำ 200 บาท และเรียกเก็บเป็นเงินสด โดยเรียกเก็บจริง 200 บาทต่อรายการ

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน		ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก	
breakdown	% NAV	holding	% NAV
หุ้นสามัญ	95.72	บริษัท ปูนซิเมนต์ไทย จำกัด(มหาชน)	6.61
เงินฝากธนาคาร	4.99	บริษัท ทางด่วนและรถไฟฟ้ากรุงเทพ จำกัด (มหาชน)	6.07
สินทรัพย์อื่นหรือหนี้สินอื่น	-0.71	บริษัท เซ็นทรัลพัฒนา จำกัด (มหาชน)	6.07
		บริษัท แอดวานซ์ อินโฟร์ เซอร์วิส จำกัด (มหาชน)	6.05
		บริษัท โฮม โปรดักส์ เซ็นเตอร์ จำกัด (มหาชน)	6.05

ข้อมูลเชิงสถิติ	
Maximum Drawdown	-29.42%
Recovering Period	N/A
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน	0.39 เท่า
Sharpe Ratio	-0.78
Alpha	-6.58
Beta	0.91

การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม	
sector	% NAV
บริการ	38.89
ธุรกิจการเงิน	29.29
อสังหาริมทรัพย์และก่อสร้าง	12.68
เทคโนโลยี	6.05
ทรัพยากร	5.85

คำอธิบาย

Maximum Drawdown เพอร์เซ็นต์ผลขาดทุนสูงสุดของกองทุนรวมในระยะเวลา 5 ปีย้อนหลัง (หรือตั้งแต่จัดตั้งกองทุนกรณีที่ยังไม่ครบ 5 ปี) โดยวัดจากระดับ NAV ต่อหน่วยที่จุดสูงสุดไปจนถึงจุดต่ำสุดในช่วงที่ NAV ต่อหน่วยปรับตัวลดลง ค่า Maximum Drawdown เป็นข้อมูลที่ช่วยให้ทราบถึงความเสี่ยงที่อาจจะขาดทุนจากการลงทุนในกองทุนรวม **Recovering Period** ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาตั้งแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลานานเท่าใด **FX Hedging** เพอร์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตกองทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลานึง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์กับผลรวมของมูลค่าการขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 1 ปี หารด้วยมูลค่า NAV ของกองทุนรวมเฉลี่ยในรอบระยะเวลาเดียวกัน กองทุนรวมที่มีค่า portfolio turnover สูง บ่งชี้ถึงการซื้อขายหลักทรัพย์บ่อยครั้งของผู้จัดการกองทุนและทำให้มีต้นทุนการซื้อขายหลักทรัพย์ที่สูง จึงต้องพิจารณาเปรียบเทียบกับผลการดำเนินงานของกองทุนรวมเพื่อประเมินความคุ้มค่าของการซื้อขายหลักทรัพย์ดังกล่าว

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

Alpha ผลตอบแทนส่วนเกินของกองทุนรวมเมื่อเปรียบเทียบกับดัชนีชี้วัด (benchmark) โดยค่า Alpha ที่สูง หมายถึง กองทุนสามารถสร้างผลตอบแทนได้สูงกว่าดัชนีชี้วัด ซึ่งเป็นผลจากประสิทธิภาพของผู้จัดการกองทุนในการคัดเลือกหรือหาจังหวะเข้าลงทุนในหลักทรัพย์ได้อย่างเหมาะสม

Beta ระดับและทิศทางของการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุน โดยเปรียบเทียบกับอัตราการเปลี่ยนแปลงของตลาด

Beta น้อยกว่า 1 แสดงว่าหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนน้อยกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด

Beta มากกว่า 1 แสดงว่าหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนมากกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด

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

Yield to Maturity อัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในตราสารหนี้โดยถือจนครบกำหนดอายุ ซึ่งคำนวณจากดอกเบี้ยที่จะได้รับในอนาคตตลอดอายุตราสารและเงินต้นที่จะได้รับคืน นำมาคิดลดเป็นมูลค่าปัจจุบัน โดยใช้วัดอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมตราสารหนี้ คำนวณจากค่าเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักของ Yield to Maturity ของตราสารหนี้แต่ละตัวที่กองทุนมีการลงทุน และเนื่องจาก Yield to Maturity มีหน่วยมาตรฐานเป็นเปอร์เซ็นต์ต่อปี จึงสามารถนำไปใช้เปรียบเทียบอัตราผลตอบแทนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีนโยบายถือครองตราสารหนี้จนครบกำหนดอายุและมีลักษณะการลงทุนที่ใกล้เคียงกันได้

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ทาลิส จำกัด

โทรศัพท์: 02 015 0222 www.talisam.co.th

เลขที่ 89 ชั้น 10 ห้อง 1001-1002 อาคาร AIA Capital Center ถนนรัชดาภิเษก แขวงดินแดง เขตดินแดง กรุงเทพฯ 10400

ข้อมูลอื่น ๆ

นโยบายการลงทุนเพิ่มเติม

วัตถุประสงค์การลงทุนที่เกี่ยวข้องกับความยั่งยืน

เพื่อสะท้อนให้เห็นถึงการลงทุนที่คำนึงถึงปัจจัยด้านความยั่งยืน และมุ่งเน้นลงทุนในหุ้นของบริษัทจดทะเบียนฯ ที่เห็นความสำคัญและดำเนินธุรกิจที่มีความยั่งยืนในระยะยาว (Sustainability) และสร้างผลกระทบเชิงบวกต่อสังคมและสิ่งแวดล้อม โดยกองทุนจะลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งหุ้นของบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย และ/หรือตลาดหลักทรัพย์เอ็มเอ ไอ ที่ได้รับการคัดเลือกจากตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยหรือองค์กรหรือสถาบันอื่นที่สำนักงาน ก.ล.ต. ยอมรับว่ามีความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน (Environmental, Social and Governance: ESG) โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน

เป้าหมายด้านความยั่งยืน

เพื่อเป็นแรงขับเคลื่อนให้กิจกรรมที่มุ่งเน้นการดำเนินงานที่คำนึงถึงปัจจัยด้าน ESG มากขึ้น ส่งผลให้เกิดระบบนิเวศที่ยั่งยืนต่อระบบเศรษฐกิจไทย และเป็นกลไกหนึ่งที่ช่วยสนับสนุนบริษัทจดทะเบียนฯ และประเทศไทยให้บรรลุเป้าหมายการพัฒนาที่ยั่งยืน (Sustainable Development Goals : SDGs) ขององค์การสหประชาชาติ

กรอบการลงทุน (Investment Universe)

กองทุนจะเน้นลงทุนในหุ้นที่ได้รับการประเมินผลการดำเนินงานด้านความยั่งยืน (ESG Rating) ในระดับ AA ขึ้นไป โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน

ดัชนีอ้างอิง

ดัชนีผลตอบแทนรวม SETESG (SETESG TRI) จัดทำโดยตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย ซึ่งเป็นดัชนีที่สะท้อนการเคลื่อนไหวราคาของกลุ่มหลักทรัพย์ของบริษัทจดทะเบียนที่มีการดำเนินธุรกิจอย่างยั่งยืนซึ่งมีขนาดมูลค่าหลักทรัพย์ตามราคาตลาด (Market Capitalization) และสภาพคล่องผ่านตามเกณฑ์ที่กำหนด โดยไม่ได้จำกัดจำนวนหลักทรัพย์ในดัชนี ผู้ลงทุนสามารถศึกษาวิธีการจัดทำดัชนี (Index Methodology) ได้ที่ www.set.or.th/th/market/index/setesg/profile

หลักเกณฑ์การพิจารณาคัดเลือกหลักทรัพย์ที่กองทุนเข้าลงทุน

ขั้นตอนที่ 1: คัดเลือกหลักทรัพย์ที่ได้รับการประเมินผลการดำเนินงานด้านความยั่งยืน (ESG Rating)

ขั้นตอนที่ 2: คัดเลือกหลักทรัพย์ที่ได้รับการประเมินผลการดำเนินงานด้านความยั่งยืน (ESG Rating) จากตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยว่ามีความโดดเด่นด้าน ESG ในระดับตั้งแต่ AA ขึ้นไปเท่านั้น (รวมถึง AA และ AAA)

ขั้นตอนที่ 3: หลักทรัพย์ที่คัดเลือกต้องมีสภาพคล่องสูง โดยพิจารณาจาก Free Float ของบริษัทนั้น ๆ และหลักทรัพย์นั้นต้องไม่มีการถือหุ้นโดยผู้ถือหุ้นรายใหญ่เพื่อประโยชน์ในการประกอบธุรกิจอย่างเป็นอิสระ โดยเป็นไปตามหลักเกณฑ์และดุลยพินิจของผู้จัดการกองทุน

ขั้นตอนที่ 4: คัดเลือกหลักทรัพย์ที่มีมูลค่าหลักทรัพย์ตามราคาตลาด (Market Capitalization) สูงสุดจำนวน 20 - 25 หลักทรัพย์ โดยจะพิจารณาลงทุนในหลักทรัพย์ที่มีมูลค่าหลักทรัพย์ตามราคาตลาด (Market Capitalization) สูงสุดลำดับ 1 – 12 หลักทรัพย์แรกในสัดส่วนการลงทุนที่ใกล้เคียงกัน รวมกันประมาณร้อยละ 70 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน ทั้งนี้ ในสถานการณ์ปกติ กองทุนจะจำกัดสัดส่วนการลงทุนในแต่ละหมวดอุตสาหกรรม (sector) ไม่เกินกว่าร้อยละ 30 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน

กองทุนจะทำการพิจารณาปรับรายชื่อหลักทรัพย์ และ/หรือ ปรับสัดส่วนการลงทุนอย่างน้อยปีละ 2 ครั้ง

ทั้งนี้ ในกรณีที่บริษัทจัดการพิจารณาแล้วเห็นว่าหลักเกณฑ์การพิจารณาคัดเลือกหลักทรัพย์ ความถี่ในการปรับสมดุลของสัดส่วนน้ำหนักการลงทุน (Rebalance) และการปรับรายชื่อหลักทรัพย์ที่กำหนดไว้ข้างต้นไม่เพียงพอ และ/หรือไม่เหมาะสมกับสถานการณ์การลงทุน ณ ขณะใดแล้ว บริษัทจัดการขอสงวนสิทธิที่จะปรับปรุงหลักเกณฑ์ฯ ดังกล่าวนั้นโดยเป็นไปในลักษณะที่ไม่ด้อยกว่าหลักเกณฑ์เดิมที่กำหนดแต่ยังคงวัตถุประสงค์และกรอบการลงทุนเพื่อการลงทุนที่เกี่ยวข้องกับความยั่งยืน โดยถือประโยชน์ของผู้ถือหน่วยลงทุนเป็นสำคัญ ทั้งนี้ บริษัทจัดการจะแจ้งรายละเอียดของการปรับเปลี่ยนหลักเกณฑ์ฯ ข้างต้นให้ผู้ถือหน่วยลงทุน และ/หรือผู้ลงทุนทราบล่วงหน้าไม่น้อยกว่า 3 วันทำการ

อนึ่ง บริษัทจัดการสงวนสิทธิที่จะปรับเปลี่ยนรายชื่อหลักทรัพย์ของบริษัทใดบริษัทหนึ่งหรือหลายบริษัทจากรายชื่อหลักทรัพย์ที่กองทุนลงทุนหรือจะเข้าลงทุน เมื่อพิจารณาจากเหตุการณ์ที่เกิดขึ้น ณ ขณะนั้นหรืออาจเกิดขึ้น หรือข้อมูลจากแหล่งที่เชื่อถือได้ หรือที่บริษัทจัดการคาดการณ์ว่าอาจส่งผลกระทบทางลบต่อราคาในทิศทางที่จะทำให้ราคาตราสารทุนของบริษัทนั้นลดลงอย่างมาก หรือปัจจัยทางการเงิน หากผู้จัดการกองทุนพิจารณาแล้วเห็นว่ามีเหมาะสมตามสภาวะการณ์ในแต่ละขณะ โดยบริษัทจัดการจะดำเนินการเพื่อประโยชน์ของผู้ถือหน่วยลงทุนหรือลดความเสี่ยงของกองทุนเป็นสำคัญ