

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ทาลิส จำกัด

ข้อมูล ณ วันที่ 30 เม.ย. 2569



# กองทุนเปิด MEGA 20 ไทยเพื่อความยั่งยืนแบบพิเศษ 80-20 U ชนิดเงินลงทุนเดิม

SRI Fund

MEGATX8020U-L

## ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมตราสารทุน / กองทุนรวมไทยเพื่อความยั่งยืนแบบพิเศษ (ThaiESGX) / กองทุนรวมเพื่อความยั่งยืน (SRI Fund) / กองทุนรวมที่มีนโยบายเปิดให้มีการลงทุนในกองทุนรวมอื่นภายใต้ บลจ. เดียวกัน (Cross Investing Fund) / กองทุนที่ลงทุนแบบมีความเสี่ยงทั้งในและต่างประเทศ
- กลุ่ม Equity Large Cap

## นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- ลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งหุ้นของบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย และ/หรือตลาดหลักทรัพย์เอ็ม เอ ไอ (“บริษัทจดทะเบียน”) ที่ได้รับการคัดเลือกจากตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย ว่ามีความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน (Environmental, Social and Governance: ESG) หรือหุ้นของบริษัทจดทะเบียนที่มีธรรมาภิบาล (Governance) (รายละเอียดปรากฏตามกรอบการลงทุน (Investment Universe)) โดยมี net exposure ในทรัพย์สินที่ลงทุนดังกล่าวโดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV (รายละเอียดเพิ่มเติมในข้อมูลอื่น ๆ หน้า 4) เงินลงทุนส่วนที่เหลือกองทุนจะพิจารณาลงทุนในกองทุนเปิด MEGA 10 ซึ่งเป็นกองทุนที่อยู่ภายใต้การบริหารจัดการของบริษัทจัดการ โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่เกิน 20% ของ NAV
- กองทุนมีกลยุทธ์การลงทุนในตราสารทุนตามหลักเกณฑ์การคัดเลือกหลักทรัพย์และการบริหารจัดการที่กำหนด (Rules based Approach) โดยมุ่งหวังให้ผลประโยชน์การเคลื่อนไหวสูงกว่าดัชนีชี้วัดในระยะยาว

## ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (%ต่อปี)

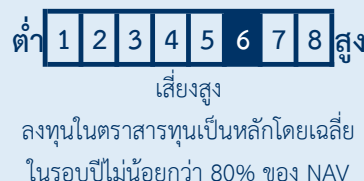


หมายเหตุ: ปีที่เริ่มต้นกองทุน ผลการดำเนินงานกองทุนและดัชนีชี้วัดจะแสดงตั้งแต่วันที่จดทะเบียนกองทุน/วันเริ่มต้น class จนถึงสิ้นปีปฏิทิน และเนื่องจากมีระยะเวลาไม่ถึง 1 ปี จึงไม่มีค่า Peer avg ในระยะเวลาดังกล่าว

## ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด (%ต่อปี\*)

	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี*
กองทุน	4.73	3.22	3.35	N/A
ดัชนีชี้วัด	12.53	9.48	11.91	N/A
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	17.44	12.55	14.97	N/A
ความผันผวนกองทุน	16.60	18.33	14.52	N/A
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	14.26	15.76	12.72	N/A
	3 ปี*	5 ปี*	10 ปี*	ตั้งแต่จัดตั้ง*
กองทุน	N/A	N/A	N/A	8.03
ดัชนีชี้วัด	N/A	N/A	N/A	21.74
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	N/A	N/A	N/A	N/A
ความผันผวนกองทุน	N/A	N/A	N/A	13.92
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	N/A	N/A	N/A	13.07

## ระดับความเสี่ยง



## ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน	9 พ.ค. 2568
วันเริ่มต้น class	13 พ.ค. 2568
นโยบายการจ่ายเงินปันผล	ไม่จ่าย
อายุกองทุน	ไม่กำหนด
การป้องกันความเสี่ยง FX	ไม่ป้องกัน (unhedged)
การเรียกเก็บค่าธรรมเนียมตามผลการดำเนินงาน	ไม่มี

## ผู้จัดการกองทุนรวม

นาย วีระพล สิมะโรจน์ (ตั้งแต่ 13 พ.ค. 2568)  
นาย จักรกฤษณ์ กิ่งชุม (ตั้งแต่ 25 พ.ย. 2568)

## ดัชนีชี้วัด :

ดัชนีผลตอบแทนรวม SETESG (SETESG TRI) สัดส่วน 80% และ ดัชนี Hang Seng Total Return ปรับด้วยอัตราแลกเปลี่ยนเพื่อคำนวณผลตอบแทนเป็นสกุลเงินบาท ณ วันที่คำนวณผลตอบแทน สัดส่วน 20%  
วัตถุประสงค์ในการอ้างอิงดัชนีชี้วัด : เพื่อเปรียบเทียบกับผลการดำเนินงานของกองทุน

## คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวม มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต: ได้รับการรับรองจาก CAC  
จัดอันดับกองทุน Morningstar

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



"ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือบริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่องได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม"

www.talisam.co.th

**การซื้อขายหน่วยลงทุน**

วันทำการซื้อ : ทุกวันทำการ

เวลาทำการ : 8.30 น. - 15.30 น.

การซื้อขายครั้งแรกขั้นต่ำ : 1,000 บาท

การซื้อขายครั้งถัดไปขั้นต่ำ : 1 บาท

**การขายคืนหน่วยลงทุน**

วันทำการขายคืน : ทุกวันทำการ

เวลาทำการ : 8.30 น. - 15.30 น.

การขายคืนขั้นต่ำ : ไม่กำหนด

ยอดคงเหลือขั้นต่ำ : ไม่กำหนด

ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน : T+3

**ข้อมูลเชิงสถิติ**

Maximum Drawdown	-9.80%
Recovering Period	N/A
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน	N/A
Sharpe Ratio	N/A
Alpha	N/A
Beta	N/A

หมายเหตุ กองทุนรับสับเปลี่ยนกองทุนรวมหุ้นระยะยาว (LTF) จากทุกบริษัทจัดการ โดยสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้าหน่วยลงทุนชนิดเงินลงทุนเดิม (L) เท่านั้น และต้องทำรายการสับเปลี่ยนตั้งแต่วันที่ 13 พ.ค. - 30 มิ.ย. 2568 โดยบริษัทจัดการจะทำรายการสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนตามคำสั่งที่ได้รับในแต่ละสัปดาห์ในทุกวันศุกร์ของสัปดาห์นั้น ๆ และวันที่ 30 มิ.ย. 2568 ทั้งนี้ผู้ลงทุนควรศึกษาเงื่อนไขการลงทุนในกองทุนรวมไทยเพื่อความยั่งยืนและคู่มือการลงทุนให้เข้าใจก่อนการลงทุน

**ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV) ค่าธรรมเนียมต่อไปนี้จะส่งผลกระทบต่อ**

ต่อผู้ลงทุน เนื่องจากจะทำให้ผลตอบแทนจากการลงทุนลดลง ดังนั้น ผู้ลงทุนควรตรวจสอบทุกครั้งที่ก่อนตัดสินใจลงทุน

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	1.6050	1.6050
ค่าตอบแทนแก่ตัวแทนขายหน่วยลงทุนของกองทุนรวม (trailer fee) : มี		
รวมค่าใช้จ่าย	2.9425	1.7334

หมายเหตุ 1) ค่าธรรมเนียมหรือค่าใช้จ่ายดังกล่าวได้รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะ หรือภาษีอื่นใดแล้ว 2)\* ค่าใช้จ่ายรวมที่เรียกเก็บจริง ยังไม่รวมค่าใช้จ่ายอื่น 3) บริษัทอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ 4) กองทุนมีการลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมอื่นภายใต้การบริหารจัดการของบริษัทจัดการเดียวกัน (กองทุนปลายทาง) บริษัทจัดการจะไม่คิดค่าธรรมเนียมการจัดการซ้ำซ้อนกับกองทุนปลายทาง โปรดดูข้อมูลกองทุนและอัตราค่าธรรมเนียมการจัดการของกองทุนปลายทางเพิ่มเติม

**ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย) ผู้ลงทุนจะถูกเรียกเก็บค่าธรรมเนียม**

ต่อไปนี้อย่างตรงทุกครั้งที่เมื่อทำการซื้อขายหรือสับเปลี่ยนหน่วยลงทุน

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การขาย	1.00	ยกเว้น
การรับซื้อคืน	1.00	ยกเว้น
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า	1.00	ยกเว้น
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก	1.00	ยกเว้น*
การโอนหน่วย	ไม่มี	ไม่มี

หมายเหตุ (1) ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วยได้รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะ หรือภาษีอื่นใดแล้ว โดยบริษัทจัดการอาจเรียกเก็บ

ค่าธรรมเนียมจากผู้ลงทุนโดยตรง (2) ค่าธรรมเนียมการขาย/การรับซื้อคืน/การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนอาจเรียกเก็บจากผู้ถือหน่วยลงทุนแต่ละกลุ่มหรือแต่ละรายในอัตราที่ไม่เท่ากัน โดยบริษัทจัดการจะแจ้งรายละเอียดและหลักเกณฑ์ให้ทราบต่อไป (3)\* ค่าธรรมเนียมการสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนไปกองทุน ThaiESG ภายใต้การจัดการของบลจ.อ.มีค่าธรรมเนียมสูงสุดไม่เกิน 1.50%/ขั้นต่ำ 200 บาท และเรียกเก็บเป็นเงินสด โดยเรียกเก็บจริง 200 บาทต่อรายการ (4) กรณีกองทุนลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมอื่นภายใต้การบริหารจัดการของบริษัทจัดการเดียวกัน (กองทุนปลายทาง) บริษัทจัดการจะไม่คิดค่าธรรมเนียมการขายหน่วยลงทุนและค่าธรรมเนียมการรับซื้อคืนหน่วยลงทุนซ้ำซ้อนกับกองทุนปลายทาง รวมถึงกรณี ที่กองทุนปลายทางอาจลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมใด ๆ ของบริษัทจัดการอีกทอดหนึ่ง บริษัทจัดการจะไม่เรียกเก็บค่าธรรมเนียมดังกล่าวซ้ำซ้อนด้วยเช่นกัน

**สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน**

breakdown	% NAV	holding	% NAV
หุ้นสามัญ	80.45	กองทุนเปิด MEGA 10 (ชนิดสะสมมูลค่า)	16.63
หน่วยลงทุนที่ไม่ได้จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์	16.63	ธนาคารกรุงเทพ จำกัด (มหาชน)	5.51
สินทรัพย์อื่นหรือหนี้สินอื่น	2.28	บริษัท เอสซีบี เอกซ์ จำกัด (มหาชน)	5.45
		ธนาคารทหารไทยธนชาติ จำกัด (มหาชน)	5.35
		ธนาคารกสิกรไทย จำกัด (มหาชน)	5.27

**การจัดสรรการลงทุนในกลุ่ม****อุตสาหกรรม**

sector	% NAV
บริการ	32.95
ธุรกิจการเงิน	28.08
อสังหาริมทรัพย์และก่อสร้าง	7.75
เทคโนโลยี	4.91
ทรัพยากร	4.53

## คำอธิบาย

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

**Recovering Period** ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาตั้งแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลานานเท่าใด

**FX Hedging** เปรอ์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

**อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน** ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลาหนึ่ง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อหลักทรัพย์กับผลรวมของมูลค่าการขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 1 ปี หาดด้วยมูลค่า 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 สูงกว่าจะเป็นกองทุนที่มีประสิทธิภาพในการบริหารจัดการการลงทุนที่ดีกว่า 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](http://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) โดยกองทุนจะลงทุนในหุ้นที่มีวซึ่งหุ้นของบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย และ/หรือตลาดหลักทรัพย์เอ็ม เอ ไอ ที่ได้รับการคัดเลือกจากตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยว่ามีความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน (Environmental, Social and Governance: ESG) หรือหุ้นของบริษัทจดทะเบียนฯ ที่มีธรรมาภิบาล (Governance) (รายละเอียดปรากฏตามกรอบการลงทุน (Investment Universe)) โดยมี net exposure ในทรัพย์สินที่ลงทุนดังกล่าวโดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน

#### เป้าหมายด้านความยั่งยืน

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

#### กรอบการลงทุน (Investment Universe)

กองทุนจะเน้นลงทุนในหุ้นที่ได้รับการประเมินผลการดำเนินงานด้านความยั่งยืน (ESG Rating) จากตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย ในระดับ AA ขึ้นไป หรือหุ้นของบริษัทจดทะเบียนที่มีธรรมาภิบาล (Governance) โดยมี net exposure ในทรัพย์สินที่ลงทุนดังกล่าวโดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน

หมายเหตุ: หุ้นของบริษัทจดทะเบียนที่มีธรรมาภิบาล (Governance) ต้องมีคุณสมบัติดังนี้

1. ได้รับการประเมินการกำกับดูแลกิจการบริษัทจดทะเบียน (Corporate Governance Report of Thai Listed Companies: CGR) จากสมาคมส่งเสริมสถาบันกรรมการบริษัทไทยตั้งแต่ 90 คะแนนขึ้นไปหรือเทียบเท่า
2. มีการเปิดเผยเป้าหมายและแผนในเรื่องดังนี้ และรายงานความคืบหน้าการปฏิบัติตามเป้าหมายหรือแผนผ่านช่องทางของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย ซึ่งจัดไว้สำหรับการเปิดเผยข้อมูลดังกล่าวโดยเฉพาะ

(1) การมีเป้าหมายและแผนธุรกิจที่เกี่ยวข้องกับการเพิ่มมูลค่าของกิจการ (corporate value up plan)

(2) การมีเป้าหมายและแผนการยกระดับการดำเนินงานในเรื่องใดเรื่องหนึ่ง ดังนี้ โดยต้องตั้งเป้าหมายเพื่อดำเนินการให้เป็นไปตามแผนการยกระดับดังกล่าวให้แล้วเสร็จภายใน 2 ปีนับ

แต่วันที่เปิดเผยเป้าหมายและแผนการยกระดับ

(2.1) แผนดำเนินการที่ชัดเจนเพื่อเข้ารับการประเมินจากผู้ประเมินผลการดำเนินงานด้านความยั่งยืนตามมาตรฐานสากลตามที่ประกาศการลงทุนของกองทุนกำหนด

(2.2) เป้าหมายและแผนดำเนินการเพื่อลดปริมาณการปล่อยก๊าซเรือนกระจกของประเทศไทย

(3) มีการเพิ่มประสิทธิภาพการสื่อสารกับนักลงทุน ตามที่ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยกำหนด

**กลยุทธ์การลงทุน :** ในส่วนของการลงทุนในหุ้นของบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย และ/หรือตลาดหลักทรัพย์เอ็ม เอ ไอ (“บริษัทจดทะเบียนฯ”) ที่ได้รับการคัดเลือกจากตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยว่ามีความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน (Environmental, Social and Governance: ESG) นั้น กองทุนจะใช้กลยุทธ์การลงทุนแบบ Positive Screening โดยจะคัดเลือกหลักทรัพย์ที่ได้รับการประเมินผลการดำเนินงานด้านความยั่งยืน (ESG Rating) จากตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยว่ามีความโดดเด่นด้าน ESG ในระดับตั้งแต่ AA ขึ้นไป เป็นหลักเกณฑ์ (Rule-based Investment Strategy) ซึ่งเป็นการกำหนดหลักเกณฑ์ เงื่อนไข รวมถึงขั้นตอนการคัดเลือกหลักทรัพย์เพื่อเข้าลงทุนไว้ล่วงหน้า

**หลักเกณฑ์ในการคัดเลือกหลักทรัพย์ :** กองทุนจะใช้การบริหารแบบ Rule-based Approach ซึ่งจะกำหนดเกณฑ์ในการคัดเลือกจากหลักทรัพย์เฉพาะที่ได้รับการประเมินผลการดำเนินงานด้านความยั่งยืน (ESG Rating) จากตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย ในระดับ AA ขึ้นไป ณ ขณะลงทุน

#### กระบวนการวิเคราะห์และคัดเลือกหลักทรัพย์

**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 โดยจะพิจารณาจากหุ้นในหลักทรัพย์ที่มีมูลค่าหลักทรัพย์ตามราคาตลาด (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 รวมถึงบริษัทจัดการอาจพิจารณาเลือกหุ้นของบริษัทจดทะเบียนที่มีธรรมาภิบาล (Governance) ที่มีคุณสมบัติเพิ่มเติมเข้าเป็นหนึ่งในกระบวนการวิเคราะห์และคัดเลือกหลักทรัพย์ บริษัทจัดการขอสงวนสิทธิ์ที่จะปรับปรุงหลักเกณฑ์ฯ ดังกล่าวนั้นโดยเป็นไปในลักษณะที่ไม่ด้อยกว่าหลักเกณฑ์เดิมที่กำหนดแต่ยังคงวัตถุประสงค์และกรอบการลงทุนเพื่อการลงทุนที่เกี่ยวข้องกับความยั่งยืนโดยถือประโยชน์ของผู้ถือหุ้นรายละเป็นสำคัญ ทั้งนี้ บริษัทจัดการจะแจ้งรายละเอียดของการปรับเปลี่ยนหลักเกณฑ์ฯ ข้างต้นให้ผู้ถือหุ้นรายละ

ลงทุน และ/หรือผู้ลงทุนทราบล่วงหน้าไม่น้อยกว่า 3 วันทำการ

อนึ่ง บริษัทจัดการขอสงวนสิทธิ์ที่จะปรับเปลี่ยนรายชื่อหลักทรัพย์ของบริษัทใดบริษัทหนึ่งหรือหลายบริษัทจากรายชื่อหลักทรัพย์ที่กองทุนลงทุนหรือจะเข้าลงทุน เมื่อพิจารณาจากเหตุการณ์ที่เกิดขึ้น ณ ขณะนั้นหรืออาจเกิดขึ้น หรือข้อมูลจากแหล่งที่เชื่อถือได้ หรือที่บริษัทจัดการคาดการณ์ว่าจะส่งผลกระทบต่อราคาในทิศทางที่จะทำให้ราคาตราสารทุนของบริษัทนั้นลดลงอย่างมาก หรือปัจจัยทางการเงิน หากผู้จัดการกองทุนพิจารณาแล้วเห็นว่าความเหมาะสมตามสภาวะการณ์ในแต่ละขณะ โดยบริษัทจัดการจะดำเนินการเพื่อประโยชน์ของผู้ถือหุ้นรายละลงทุนหรือลดความเสี่ยงของกองทุนเป็นสำคัญ

## ข้อมูลอื่น ๆ

### นโยบายการลงทุนเพิ่มเติม

#### การอ้างอิงดัชนีชี้วัดที่สอดคล้องกับความยั่งยืน

(1) ดัชนีผลตอบแทนรวม SETESG (SETESG TRI) ซึ่งเป็นดัชนีที่จัดทำโดยตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย ที่สะท้อนการเคลื่อนไหวราคาของกลุ่มหลักทรัพย์ของบริษัทจดทะเบียนที่มีการดำเนินธุรกิจอย่างยั่งยืนซึ่งมีขนาดมูลค่าหลักทรัพย์ตามราคาตลาด (Market Capitalization) และสภาพคล่องผ่านตามเกณฑ์ที่กำหนด โดยไม่ได้จำกัดจำนวนหลักทรัพย์ในดัชนี ในสัดส่วนร้อยละ 80 ผู้ลงทุนสามารถศึกษาวิธีการจัดทำดัชนีผลตอบแทนรวม SETESG (SETESG TRI) (Index Methodology) ได้ที่ [www.set.or.th/th/market/index/setesg/profile](http://www.set.or.th/th/market/index/setesg/profile) ทั้งนี้ บริษัทจัดการจะเปลี่ยนแปลงดัชนีชี้วัดของกองทุนตามข้างต้นที่จัดทำโดยตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เมื่อตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยมีการจัดทำดัชนี TRI ที่นำสัดส่วนผู้ถือหลักทรัพย์รายย่อยของแต่ละหลักทรัพย์ (free float) มาถ่วงน้ำหนักในการคำนวณดัชนี (ดัชนี free float TRI) เพื่อให้เป็นไปตามหลักเกณฑ์ที่คณะกรรมการกำกับตลาดทุนประกาศกำหนด

(2) ดัชนี S&P500 Total Return ปรับด้วยอัตราแลกเปลี่ยนเพื่อคำนวณผลตอบแทนเป็นสกุลเงินบาท ณ วันที่คำนวณผลตอบแทน ในสัดส่วนร้อยละ 20 กองทุนใช้ดัชนี S&P500 Total Return ในสัดส่วนร้อยละ 20 เป็นส่วนหนึ่งของดัชนีชี้วัดของกองทุน แมื่อดัชนีดังกล่าวไม่มีความเกี่ยวข้องกับความเสี่ยง เนื่องจากกองทุนมีการลงทุนในกองทุนเปิด MEGA 10 ซึ่งเป็นกองทุนที่อยู่ภายใต้การบริหารจัดการของบริษัทจัดการ ในสัดส่วนโดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่เกิน ร้อยละ 20 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน และดัชนีดังกล่าวเป็นดัชนีชี้วัดของกองทุนเปิด MEGA 10A

#### ข้อจำกัดด้านการลงทุน

กองทุนจะไม่ลงทุนในหลักทรัพย์ที่เกี่ยวข้องกับธุรกิจบางประเภทที่ขัดต่อขนบธรรมเนียม จารีตประเพณี ศีลธรรมอันดีงาม หรือสังคมโดยรวม ภายใต้ดุลยพินิจของผู้จัดการกองทุน เช่น

- เครื่องดื่มแอลกอฮอล์หรือของมีเมา
- ยาสูบ
- อาวุธสงคราม
- สื่อลามก
- การพนัน

ทั้งนี้ จะอ้างอิงจากเกณฑ์สัดส่วนรายได้จากรูรกิจดังกล่าวมากกว่า 15% ของรายได้รวม

#### ความเสี่ยงที่เกี่ยวกับการลงทุนของกองทุน

- กองทุนเน้นลงทุนในหลักทรัพย์ของบริษัทที่ได้รับการประเมินผลการดำเนินงานด้านความยั่งยืน (ESG Rating) จาก SET ในระดับตั้งแต่ AA ขึ้นไป ซึ่งข้อมูลอาจไม่มีการปรับปรุงให้เป็นปัจจุบันได้ทันทีเมื่อมีเหตุการณ์เกี่ยวกับ ESG มากระทบกับบริษัทนั้นในเชิงลบ
- กองทุนมีนโยบายมุ่งเน้นลงทุนในหุ้นของบริษัทจดทะเบียนฯ ที่เห็นความสำคัญและดำเนินธุรกิจที่มีความยั่งยืนในระยะยาว (Sustainability) จึงอาจมีความเสี่ยงจากการกระจุกตัวในทรัพย์สินที่เกี่ยวกับความยั่งยืน และการไม่สามารถซื้อหรือขายหลักทรัพย์บางตัวได้ในราคาหรือช่วงเวลาที่เหมาะสมด้วยเงื่อนไขด้านความยั่งยืนที่กองทุนกำหนด นอกจากนี้ กองทุนมีการจำกัดสัดส่วนการลงทุนของแต่ละหมวดอุตสาหกรรม (sector) ไว้ไม่เกินกว่าร้อยละ 30 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน ดังนั้น กองทุนอาจมีการลงทุนกระจุกตัวในหมวดอุตสาหกรรมใดอุตสาหกรรมหนึ่งในบางขณะได้
- ตราสารที่กองทุนเข้าลงทุนเกินกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุนจะใช้วิธีคัดเลือกจากบริษัทที่ได้รับการประเมินผลการดำเนินงานด้านความยั่งยืน (ESG Rating) จาก SET ว่ามีความโดดเด่นด้าน ESG ในระดับตั้งแต่ AA ขึ้นไปที่มีมูลค่าหลักทรัพย์ตามราคาตลาด (Market Capitalization) สูงสุดและมีสภาพคล่องสูงเพียง 20 - 25 หลักทรัพย์ โดยมีการจำกัดสัดส่วนการลงทุนของแต่ละหมวดอุตสาหกรรม (sector) รวมทั้งเกณฑ์อื่น ๆ ที่บริษัทจัดการพิจารณา กำหนด โดยไม่ใช้การวิเคราะห์มูลค่า (Valuation) และทิศทางราคาหลักทรัพย์ ดังนั้น ผู้ลงทุนจึงควรรับทราบและยอมรับความเสี่ยงของวิธีการนี้ โดยในบางสถานการณ์ผลตอบแทนของกองทุนอาจน้อยกว่าหรือมากกว่าการลงทุนแบบวิเคราะห์มูลค่า และการพิจารณาทิศทางราคาหลักทรัพย์ก็ไม่ได้ นอกจากนี้ การที่กองทุนมีการบริหารแบบ Rules based Approach โดยมีการปรับสมดุลของสัดส่วนน้ำหนักการลงทุน (Rebalance) รวมถึงปรับรายชื่อหลักทรัพย์การลงทุนอย่างน้อยปีละ 2 ครั้ง ซึ่งหากเกิดเหตุการณ์ที่มีผลกระทบต่อราคาหลักทรัพย์ที่กองทุนเข้าลงทุนในช่วงระยะเวลาก่อนการปรับสัดส่วนฯ และรายชื่อหลักทรัพย์ดังกล่าว กองทุนอาจดำเนินการไม่เป็นไปตามความคาดหวังของผู้ลงทุนบางกลุ่มที่ต้องการให้กองทุนบริหารจัดการแบบ active management ที่ปรับ Portfolio กองทุนอย่างรวดเร็ว
- ในส่วนของการลงทุนในหลักทรัพย์ของบริษัทที่ได้รับการประเมินผลการดำเนินงานด้านความยั่งยืน (ESG Rating) จาก SET กองทุนจะเน้นเฉพาะการลงทุนในกลุ่มตราสารที่มีมูลค่าหลักทรัพย์ตามราคาตลาด (Market Capitalization) สูง เพียง 20 - 25 หลักทรัพย์ โดยมีการจำกัดสัดส่วนการลงทุนของแต่ละหมวดอุตสาหกรรม (sector) ซึ่งในบางสถานการณ์ผลตอบแทนที่ได้จากการลงทุนในตราสารกลุ่มนี้อาจน้อยกว่าผลตอบแทนของการลงทุนในตราสารที่มูลค่าตามราคาตลาดน้อยกว่า และ/หรือที่ไม่ได้คัดเลือก เช่น ตราสารที่มีมูลค่าหลักทรัพย์ตามราคาตลาดขนาดกลางและขนาดเล็กอาจจะให้ผลตอบแทนมากกว่าตราสารที่มีมูลค่าหลักทรัพย์ตามราคาตลาด (Market Capitalization) สูงได้
- การลงทุนในหุ้นของกลุ่มบริษัทที่มีความโดดเด่นด้าน ESG อาจมีสภาพคล่องต่ำกว่าหุ้นของบริษัททั่วไป ดังนั้น หากเกิดความผันผวนในตลาดหรือวิกฤตทางเศรษฐกิจ กองทุนอาจไม่สามารถซื้อหรือขายหุ้นได้ในราคาหรือในเวลาที่เหมาะสม ซึ่งอาจส่งผลกระทบต่อสภาพคล่องและผลการดำเนินงานของกองทุนได้
- กองทุนอาจมีการนำเงินไปลงทุนในต่างประเทศ โดยกองทุนจะไม่ทำการป้องกันความเสี่ยงด้านอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ ดังนั้น กองทุนจึงอาจมีความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยนจากการที่กองทุนนำเงินบาทไปลงทุน ซึ่งทำให้ผู้ลงทุนอาจจะขาดทุนหรือได้รับกำไรจากอัตราแลกเปลี่ยนหรือได้รับเงินคืนต่ำกว่าเงินลงทุนเริ่มแรกได้

#### แนวทางดำเนินการ และมาตรการควบคุมผลกระทบในกรณีการลงทุนไม่เป็นไปตามนโยบายการลงทุน

- กองทุนใช้กลยุทธ์การลงทุนแบบ Screening เป็นหลักเกณฑ์ (Rule-based Investment Strategy) แต่หากบริษัทจัดการพิจารณาแล้วเห็นว่าหลักเกณฑ์การพิจารณาคัดเลือกหลักทรัพย์ที่กำหนดไว้ข้างต้นไม่เพียงพอ และ/หรือไม่เหมาะสมกับสถานการณ์การลงทุน ณ ขณะใดแล้ว บริษัทจัดการสงวนสิทธิที่จะปรับปรุงหลักเกณฑ์ฯ ดังกล่าวนั้นโดยเป็นไปในลักษณะที่ไม่ขัดแย้งหลักเกณฑ์เดิมที่กำหนดแต่ยังคงวัตถุประสงค์และกรอบการลงทุนเพื่อการลงทุนที่เกี่ยวข้องกับความยั่งยืน โดยถือประโยชน์ของผู้ถือหน่วยลงทุนเป็นสำคัญ
- บริษัทจัดการจะทำการติดตามผลการประเมินผลการดำเนินงานด้านความยั่งยืน (ESG Rating) จาก SET อย่างสม่ำเสมอ และพิจารณาปรับรายชื่อหลักทรัพย์เพื่อให้เป็นไปตามหลักเกณฑ์การคัดเลือกหลักทรัพย์ตามนโยบายการลงทุน