

กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Global Sustainable Equity

ชนิดผู้ลงทุนกลุ่ม/บุคคล
SCBGEESGP

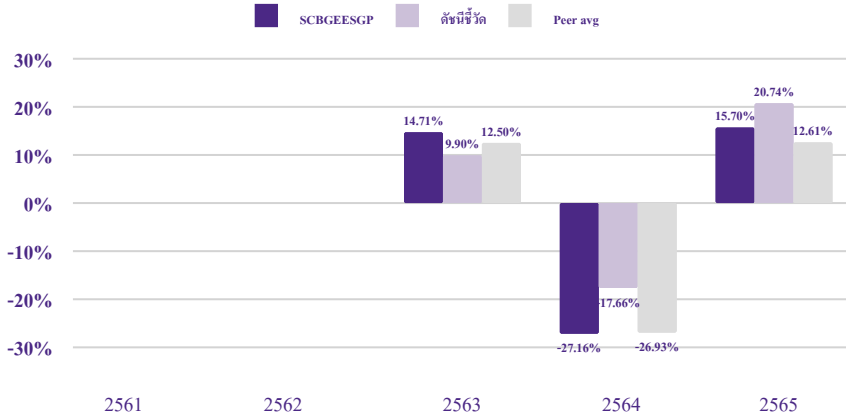
ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- ประเภทกองทุนรวม: กองทุนรวมตราสารทุน/กองทุนรวมที่มีนโยบายเปิดให้มีการลงทุนในกองทุนรวมอื่น ภายใต้ บลจ. เดียวกัน/กองทุนรวมฟีดเดอร์ (Feeder Fund)/กองทุนรวม ESG (non-SRI Fund)/กองทุนรวมที่เน้นลงทุนแบบมีความเสี่ยงต่างประเทศ
- กลุ่มกองทุนรวม: Global Equity

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- เน้นลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมต่างประเทศเพียงกองทุนเดียว (Feeder Fund) ได้แก่ Janus Henderson Horizon - GLOBAL SUSTAINABLE EQUITY FUND (กองทุนหลัก) Class IU2 สกุลเงิน USD กองทุนหลักมีวัตถุประสงค์การลงทุน คือ การสร้างการเติบโตของเงินลงทุนในระยะยาว โดยลงทุนในหลักทรัพย์ของบริษัทที่มีผลิตภัณฑ์หรือการให้บริการที่ได้รับความพิจารณาโดยผู้จัดการการลงทุนว่ามีส่วนทำให้เกิดการเปลี่ยนแปลงด้านสิ่งแวดล้อมหรือสังคมในเชิงบวกและส่งผลกระทบต่อการพัฒนาเศรษฐกิจโลกที่ยั่งยืน กองทุนอาจลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวม หรือกองทุนรวมอสังหาริมทรัพย์ (กอง1) หรือทรัสต์เพื่อการลงทุนในอสังหาริมทรัพย์ (REITs) หรือกองทุนรวมโครงสร้างพื้นฐาน (infra) ซึ่งอยู่ภายใต้การจัดการของบริษัทจัดการในสัดส่วนไม่เกิน 100% ของ NAV
- ชื่อ บลจ.ที่บริหารจัดการกองทุนหลัก: Henderson Management S.A.
- กองทุนอาจลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) เพื่อเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน (Efficient portfolio management) และ/หรือการบริหารความเสี่ยง โดยป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน (Hedging) ตามดุลยพินิจของผู้จัดการกองทุน
- กลยุทธ์ในการบริหารกองทุนรวม: กองทุนไทยมุ่งหวังให้ผลประกอบการเคลื่อนไหวตามกองทุนหลัก ส่วนกองทุนหลักมุ่งหวังให้ผลประกอบการสูงกว่าดัชนีชี้วัด (Active Management)

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (% ต่อปี)



หมายเหตุ: ในปีที่กองทุนจดทะเบียน ผลการดำเนินงานจะแสดงตั้งแต่วันที่จดทะเบียนกองทุนจนถึงสิ้นปีปฏิทิน

ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปิดหมวด

	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี ¹	3 ปี ¹	5 ปี ¹	10 ปี ¹	ตั้งแต่จัดตั้ง ¹
SCBGEESGP	15.70	10.24	1.80	15.70	N/A	N/A	N/A	-1.35
ดัชนีชี้วัด	20.74	7.59	4.60	20.74	N/A	N/A	N/A	3.61
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน ²	12.61	8.42	1.64	12.61	N/A	N/A	N/A	N/A
ความผันผวนของกองทุน	13.71	5.98	8.48	13.71	N/A	N/A	N/A	20.08
ความผันผวนของดัชนีชี้วัด	11.85	5.72	7.74	11.85	N/A	N/A	N/A	16.18

หมายเหตุ: ¹ % ต่อปี

² ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน ตามการจัดกลุ่มกองทุนรวมของ AIMC category SCBAM เป็นผู้คำนวณผลตอบแทนดัชนีชี้วัดโดยใช้ข้อมูลดัชนี ณ สิ้นวัน

ระดับความเสี่ยง

ต่ำ	1	2	3	4	5	6	7	8	สูง
						6 : เสี่ยงสูง			

ลงทุนในตราสารทุนเป็นหลัก โดยเฉลี่ยในรอบปีไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน	30 พฤศจิกายน 2563
วันเริ่มต้น Class	1 กรกฎาคม 2564
นโยบายการจ่ายเงินปันผล	ไม่จ่าย
อายุกองทุน	ไม่กำหนดอายุโครงการ
ผู้จัดการกองทุนรวม	
นายภาคสุภา จิตมั่นชัยธรรม	17 พฤศจิกายน 2565
น.ส.นริศรา ดิณรัตน์สกุลชัย	2 พฤศจิกายน 2564

ดัชนีชี้วัด

ดัชนี MSCI World NETR USD 100% ปรับด้วยต้นทุนการป้องกันความเสี่ยงอัตราแลกเปลี่ยนเพื่อคำนวณผลตอบแทนเป็นสกุลเงินบาท ณ วันที่ลงทุน (ในอัตราส่วน 50%) และปรับด้วยอัตราแลกเปลี่ยนเพื่อเทียบกับค่าสกุลเงินบาท ณ วันที่คำนวณผลตอบแทน (ในอัตราส่วน 50%) การใช้ดัชนีชี้วัดข้างต้น เป็นเพียงดัชนีอ้างอิง (reference index) เพื่อใช้ประโยชน์ในการเปรียบเทียบผลตอบแทนเท่านั้น ไม่สามารถนำมาเปรียบเทียบกับกลยุทธ์การลงทุน วัตถุประสงค์การลงทุน หรือทรัพย์สินที่กองทุนหลักลงทุนได้ เนื่องจากกองทุนหลักไม่ได้ลงทุนตามสัดส่วนและ/หรือสินทรัพย์ที่เป็นองค์ประกอบของดัชนีชี้วัด

คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวม ไม่ได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต
- กองทุนรวม ESG มิได้อุบัติภายใต้ข้อกำหนดว่าด้วยการเปิดเผยข้อมูลด้านความยั่งยืนของกองทุนรวม การบริหารจัดการกองทุนรวม และการจัดทำรายงานของกองทุนรวมเช่นเดียวกับ SRI Fund

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต

ได้รับการรับรองจาก CAC

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเรื่องมือบริหารความเสี่ยง
ด้านสภาพคล่องได้ที่หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

www.scbam.com

การซื้อขายหน่วยลงทุน	การขายคืนหน่วยลงทุน
วันทำการซื้อ: ทุกวันทำการ	วันทำการขายคืน: ทุกวันทำการ
เวลาทำการ: เปิดทำการ ถึง 15.30 น.	เวลาทำการ: เปิดทำการ ถึง 15.30 น.
มูลค่าขั้นต่ำในการซื้อขายครั้งแรก: 1 บาท	มูลค่าขั้นต่ำในการขายคืน: 1 บาท
มูลค่าขั้นต่ำในการซื้อขายครั้งถัดไป: 1 บาท	ยอดคงเหลือขั้นต่ำ: 1 บาท
	ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน: T+4 คือ 4 วันทำการ หลังจากวันทำการขายคืน
	(ขอสงวนสิทธิ์เปลี่ยนแปลงระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืนจริงซึ่งอาจเร็วขึ้นหรือช้าลงกว่าเดิมได้ ทั้งนี้ไม่เกิน 7 วันทำการนับจากวันทำการขายคืน)

หมายเหตุ: โดยเบื้องต้นบริษัทจัดการกำหนดให้บริการเฉพาะผู้ลงทุนกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ และ/หรือ กองทุนส่วนบุคคลภายใต้การบริหารของบริษัทจัดการเท่านั้น

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV รวม VAT)		
ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	1.61	ยกเว้นไม่เรียกเก็บ
รวมค่าใช้จ่าย	2.14	0.11

หมายเหตุ: - บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย รวม VAT)		
ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การขาย	3.21	ยกเว้นไม่เรียกเก็บ
การรับซื้อคืน	3.21	ยกเว้นไม่เรียกเก็บ
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า	3.21	ยกเว้นไม่เรียกเก็บ
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก	3.21	ยกเว้นไม่เรียกเก็บ
การโอนหน่วย	10 บาท ต่อ 1,000 หน่วย	10 บาท ต่อ 1,000 หน่วย

หมายเหตุ: - บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ
- ค่าใช้จ่ายในการซื้อขายหลักทรัพย์ เมื่อสั่งซื้อ/ส่งขาย/สับเปลี่ยนหน่วยลงทุน ไม่เกินร้อยละ 0.75 ของมูลค่าหน่วยลงทุน (ยกเว้นไม่เรียกเก็บ)

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน		ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก	
ประเภททรัพย์สิน	% NAV	ชื่อทรัพย์สิน	% NAV
หน่วยลงทุน	97.53	หน่วยลงทุน JANUS HENDERSON	97.53
เงินฝาก	1.93	HORIZON FUND - GLOBAL	
ตราสารอนุพันธ์	1.41	SUSTAINABLE EQUITY FUND	
อื่น ๆ	-0.87		

ข้อมูลเชิงสถิติ	
Maximum Drawdown	-36.66%
Recovering Period	N/A
FX Hedging	88.77%
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน	0.07 เท่า
Sharpe ratio	-
Alpha	-7.70%
Beta	-
Tracking Error	-

ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรกของกองทุนหลัก	
ชื่อทรัพย์สิน	% NAV
Microsoft	7.79
NVIDIA	4.09
Westinghouse Air Brake Technologies	3.66
Xylem	3.00
Progressive	2.96

การจัดสรรการลงทุนในต่างประเทศของกองทุนหลัก	
ประเทศ	% NAV
สหรัฐอเมริกา	60.67
ญี่ปุ่น	8.65
ฝรั่งเศส	5.26
แคนาดา	4.99
เนเธอร์แลนด์	3.81

การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรมของกองทุนหลัก	
กลุ่มอุตสาหกรรม (Sector)	% NAV
Information Technology	33.96
Industrials	18.43
Financials	17.99
Health Care	9.00
Consumer Discretionary	4.99
อื่น ๆ	12.45

หมายเหตุ: ข้อมูลกองทุนหลักเป็นข้อมูล ณ วันที่ 30 พฤศจิกายน 2566

การลงทุนในกองทุนรวมอื่นเกินกว่า 20% ของ NAV

ชื่อกองทุน: Janus Henderson Horizon- GLOBAL Sustainable Equity Fund

ISIN code: LU1983259703

Bloomberg code: JHGIU2U LX

คำอธิบาย

Maximum Drawdown เปรอ์เซ็นต์ผลขาดทุนสูงสุดของกองทุนรวมในระยะเวลา 5 ปีย้อนหลัง (หรือตั้งแต่จัดตั้งกองทุนกรณีที่ยังไม่ครบ 5 ปี) โดยวัดจากระดับ NAV ต่อหน่วยที่จุดสูงสุด ไปจนถึงจุดต่ำสุดในช่วงที่ NAV ต่อหน่วยปรับตัวลดลง ค่า Maximum Drawdown เป็นข้อมูลที่ช่วยให้ทราบถึงความเสี่ยงที่อาจจะขาดทุนจากการลงทุนในกองทุนรวม

Recovering Period ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาดังแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่เงินต้นเริ่มคืนใช้ระยะเวลาสั้นเท่าใด

FX Hedging เปรอ์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน (Portfolio Turnover) ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตของกองทุนรวมในช่วงเวลาใดช่วงเวลานึง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์กับผลรวมของมูลค่าการขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 1 ปีหารด้วยมูลค่า 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 สูงกว่าจะเป็นกองทุนรวมที่มีประสิทธิภาพในการบริหารจัดการลงทุนที่ดีกว่า เนื่องจากได้รับผลตอบแทนส่วนเพิ่มที่สูงกว่าภายใต้ระดับความเสี่ยงเดียวกัน

Alpha ผลตอบแทนส่วนเกินของกองทุนรวมเมื่อเปรียบเทียบกับดัชนีชี้วัด (benchmark) โดยค่า Alpha ที่สูง หมายถึง กองทุนรวมสามารถสร้างผลตอบแทนได้สูงกว่าดัชนีชี้วัด ซึ่งเป็นผลจากประสิทธิภาพของผู้จัดการกองทุนรวมในการคัดเลือกหรือหาจังหวะเข้าลงทุนในหลักทรัพย์ได้อย่างเหมาะสม

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

Tracking Error อัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมมีประสิทธิภาพในการเลียนแบบดัชนีชี้วัด โดยหาก Tracking Error ต่ำ หมายถึงกองทุนรวมมีประสิทธิภาพในการสร้างผลตอบแทนให้ใกล้เคียงกับดัชนีชี้วัด กองทุนรวมที่มีค่า Tracking Error สูง จะมีอัตราผลตอบแทนโดยเฉลี่ยห่างจากดัชนีชี้วัดมากขึ้น

Yield to Maturity อัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในตราสารหนี้โดยถือจนครบกำหนดอายุ ซึ่งคำนวณจากดอกเบี้ยที่จะได้รับในอนาคตตลอดอายุตราสารและเงินต้นที่จะได้รับคืนนำมาคิดลดเป็นมูลค่าปัจจุบัน โดยใช้ตัวอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมตราสารหนี้ คำนวณจากค่าเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักของ Yield to Maturity ของตราสารหนี้แต่ละตัวที่กองทุนรวมมีการลงทุน และเนื่องจาก Yield to Maturity มีหน่วยมาตรฐานเป็นเปอร์เซ็นต์ต่อปี จึงสามารถนำไปใช้เปรียบเทียบอัตราผลตอบแทนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีนโยบายถือครองตราสารหนี้จนครบกำหนดอายุและมีลักษณะการลงทุนที่ใกล้เคียงกันได้

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด

โทรศัพท์ : 0-2949-1500 หรือ 0-2777-7777 website: www.scbam.com

ที่อยู่ : ชั้น 7 – 8 อาคาร 1 ไทยพาณิชย์ ปาร์ค พลาซ่า เลขที่ 18 ถนนรัชดาภิเษก

แขวงจตุจักร เขตจตุจักร กรุงเทพฯ 10900