

## กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ หุ้นไทยยั่งยืนแอคทีฟ

ชนิดไทยเพื่อความยั่งยืน  
SCBTA(ThaiESG)



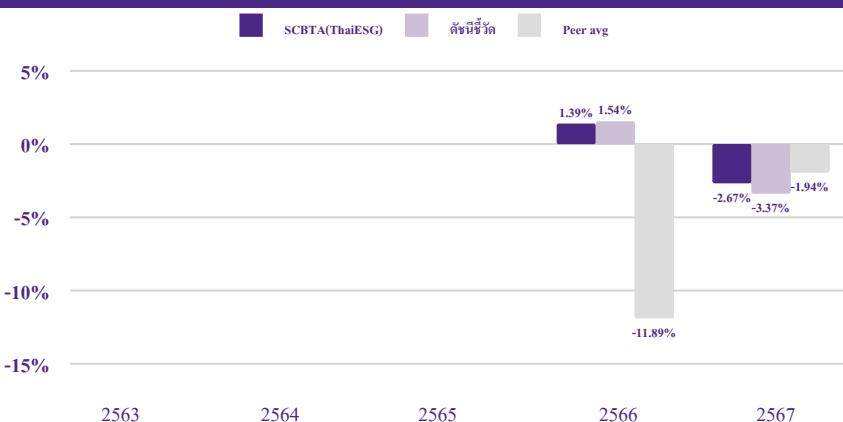
### ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- ประเภทกองทุนรวม:** กองทุนรวมตราสารทุน/กองทุนรวมที่มีเนินนโยบายเปิดให้มีการลงทุนในกองทุนรวมอื่นภายใต้บลจ. เดียวกัน/กองทุนรวมเพื่อความยั่งยืน (SRI Fund)/กองทุนรวมไทยเพื่อความยั่งยืน/กองทุนรวมที่ลงทุนแบบปันแม้มีความเสี่ยงต่างประเทศ
- กลุ่มกองทุนรวม:** Equity General

### นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- กองทุนจะลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งหุ้นของบริษัทที่มีความโดดเด่นในการบริหารจัดการด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน (Environment, Social and Governance: ESG) และ/หรือบริษัทที่ช่วยลดผลกระทบของการเปลี่ยนแปลงของสภาพภูมิอากาศ ซึ่งมีแผนการจัดการ และการตั้งเป้าหมายเพื่อให้นำรัฐเป้าหมายในการลดปัจมุขการปล่อยก๊าซเรือนกระจกของประเทศไทย ซึ่งผ่านกระบวนการการวิเคราะห์การลงทุนแบบ ESG Integration โดยเคลื่อนไปรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่า 80% ของมูลค่าทรัพย์สินถูกเขียนออกกองทุนรวม กองทุนอาจลงทุนในหุ้นของกองทุนรวมซึ่งอยู่ภายใต้การจัดการของบริษัทจัดการ โดยเคลื่อนไปรอบปีบัญชีไม่เกินร้อยละ 20 ของมูลค่าทรัพย์สินถูกเขียนออกกองทุน
- กองทุนอาจลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) เพื่อเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน (Efficient portfolio management) และ/หรือการบริหารความเสี่ยง
- กลยุทธ์ในการบริหารกองทุนรวม: มุ่งหวังให้ผลประกอบการเคลื่อนไหวสูงกว่าดัชนีชี้วัด (Active Management)

### ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (%) ต่อปี



หมายเหตุ: นำไปที่กองทุนจะคงเป็น ผลการดำเนินงานจะแสดงตั้งแต่วันที่จดทะเบียนกองทุนจนถึงอัปเดตปีปฏิทิน

### ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบบึกบึน

	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี <sup>1</sup>	3 ปี <sup>1</sup>	5 ปี <sup>1</sup>	10 ปี <sup>1</sup>	ตั้งแต่จัดตั้ง
SCBTA(ThaiESG)	-15.74	-15.74	-20.24	-15.19	N/A	N/A	N/A	-13.35
ดัชนีชี้วัด	-13.41	-13.41	-19.38	-14.38	N/A	N/A	N/A	-11.88
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน <sup>2</sup>	-14.08	-14.08	-18.17	-14.51	N/A	N/A	N/A	N/A
ความผันผวนของกองทุน	8.92	8.92	11.07	15.18	N/A	N/A	N/A	14.27
ความผันผวนของดัชนีชี้วัด	8.52	8.52	10.56	14.27	N/A	N/A	N/A	13.35

หมายเหตุ: <sup>1</sup> % ต่อปี

<sup>2</sup> ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน ตามการจัดกลุ่มกองทุนรวมของ AIMC category

### ระดับความเสี่ยง

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

ลงทุนในตราสารทุนเป็นหลัก โดยคลื่นอยู่ในรอบปีไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV

### ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน	18 มีนาคม 2566
วันเริ่มต้น Class	18 มีนาคม 2566
นโยบายการจ่ายเงินปันผล	จ่าย
อายุกองทุน	ไม่กำหนดอายุโครงการ

### ผู้จัดการกองทุนรวม

นายไพรินทร์ นิตยาธุภาพ	18 มีนาคม 2566
นายกฤษ จันทร์หนั克	18 มีนาคม 2566

### ดัชนีชี้วัด

SET ESG Total Return Index 100%

### คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวม มิได้เป็นลักษณะที่แสดงผลการดำเนินงานในอนาคต

### การเข้าร่วมต่อต้านพูน Wit

ได้รับการรับรองจาก CAC

หนังสือชี้ชวนฉบับบีทีม

ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือบริหารความเสี่ยง  
ด้านสภาพคล่องได้ที่หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



การซื้อหุ้นทุน		การขายคืนหุ้นทุน		ข้อมูลเชิงสถิติ	
วันทำการซื้อ: ทุกวันทำการ		วันทำการขายคืน: ทุกวันทำการ		Maximum Drawdown	-22.47%
เวลาทำการ: เปิดทำการ อีง 15.30 น. SCB EASY APP อีง 16.00 น.		เวลาทำการ: เปิดทำการ อีง 15.30 น. SCB EASY APP อีง 16.00 น.		Recovering Peroid	N/A
มูลค่าขั้นต่ำในการซื้อขายครั้งแรก: 1,000 บาท		มูลค่าขั้นต่ำในการขายคืน: ไม่กำหนด		FX Hedging	-
มูลค่าขั้นต่ำในการซื้อขายครั้งต่อไป: 1,000 บาท		ยอดคงเหลือขั้นต่ำ: ไม่กำหนด		อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน	1.54 เท่า
		ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน: T+2 คือ 2 วันทำการ หลังจากวันทำการขายคืน		Sharpe ratio	-1.09
		(ขอสงวนสิทธิ์เปลี่ยนแปลงระยะเวลาการรับเงินค่าขายที่ไม่ระบุชื่ออาจรีบันก่อนกำหนดได้)		Alpha	0.68%
		(ขอสงวนสิทธิ์เปลี่ยนแปลงระยะเวลาการรับเงินค่าขายที่ไม่ระบุชื่ออาจรีบันก่อนกำหนดได้)		Beta	0.94
		(ขอสงวนสิทธิ์เปลี่ยนแปลงระยะเวลาการรับเงินค่าขายที่ไม่ระบุชื่ออาจรีบันก่อนกำหนดได้)		Tracking Error	-
การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม					
กลุ่มอุตสาหกรรม (Sector)		% NAV			
ผลิตภัณฑ์และบริการสูงปีก		20.60			
เทคโนโลยีสารสนเทศและการสื่อสาร		12.93			
พาณิชย์		12.76			
ธนาคาร		11.38			
การแพทย์		7.30			
อื่นๆ		32.87			
ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV รวม VAT)					
ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เทียบจริง			
การจัดการ	2.68	1.87			
รวมค่าใช้จ่าย	3.21	1.99			
หมายเหตุ: - บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์ หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ					
ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้อื่นทุน (% ของมูลค่าซื้อขาย รวม VAT)					
ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เทียบจริง			
การขาย	3.21	ยกเว้นไม่เรียกเก็บ			
การรับซื้อคืน	3.21	ยกเว้นไม่เรียกเก็บ			
การซัมเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า	3.21	ยกเว้นไม่เรียกเก็บ			
การซัมเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก	3.21	ยกเว้นไม่เรียกเก็บ			
การโอนหน่วย	10 บาท ต่อ 1,000 หน่วย	10 บาท ต่อ 1,000 หน่วย			
หมายเหตุ: - บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์ หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ					
ค่าธรรมเนียมการซัมเปลี่ยนหน่วยลงทุนออกไปกองทุนรวมไทยเพื่อความยั่งยืนภายใต้การบริหารของบริษัท จัดการอื่น ไม่เกิน 3.21% อย่างไรก็ตาม ในช่วงแรก บริษัทจัดการยังไม่ปฏิบัติให้สัมเปลี่ยนออกไปยังบริษัทจัดการ อื่น					
สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน		ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก			
ประเภททรัพย์สิน	% NAV	ชื่อทรัพย์สิน	% NAV		
หุ้น	92.85	หุ้น บมจ.แอคเวย์ อินฟอร์ เซอร์วิส	8.37		
เงินฝาก	5.67	หุ้น บมจ.อสซีบี เอกซ์	6.13		
อื่นๆ	1.48	หุ้น บมจ.ชีพี ออลส์	5.70		
		หุ้น บมจ.ปคท.	5.50		
		หุ้น บมจ.ธนาคารกรุงไทย	5.24		

## คำอธิบาย

**Maximum Drawdown** เปอร์เซ็นต์ผลขาดทุนสูงสุดของกองทุนรวมในระยะเวลา 5 ปีข้อนหลัง (หรือตั้งแต่จัดตั้งกองทุนครั้งที่ยังไม่ครบ 5 ปี) โดยวัดจากระดับ NAV ต่อหน่วยที่ขาดสูงสุด ไปจนถึงจุดค่าสูงในช่วงที่ NAV ต่ำที่สุดปรับหัวลดลง ค่า Maximum Drawdown เป็นข้อมูลที่ช่วยให้ทราบถึงความเสี่ยงที่อาจจะขาดทุนจากการลงทุนในกองทุนรวม

**Recovering Period** ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาตั้งแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลานานเท่าไหร่

**FX Hedging** เปอร์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน (Portfolio Turnover) ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตของกองทุนรวมในช่วงเวลาใดช่วงเวลาหนึ่ง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อหลักทรัพย์กับผลรวมของมูลค่าการขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 1 ปีหารด้วยมูลค่า NAV ของกองทุนรวมเฉลี่ยในรอบระยะเวลาเดียวกัน กองทุนรวมที่มีค่า Portfolio Turnover สูง บ่งชี้ถึงการซื้อขายหลักทรัพย์ปอยครึ่งของผู้จัดการกองทุนและทำให้มีต้นทุนการซื้อขายหลักทรัพย์ที่สูง จึงต้องพิจารณาเปรียบเทียบกับผลการดำเนินงานของกองทุนรวมเพื่อประเมินความถี่ในการซื้อขายหลักทรัพย์ตั้งแต่ก้าว

**Sharpe Ratio** อัตราส่วนระหว่างผลตอบแทนส่วนเพิ่มของกองทุนรวมเปรียบเทียบกับความเสี่ยงจากการลงทุน โดยคำนวณจากผลต่างระหว่างอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมกับอัตราผลตอบแทนที่ปราศจากความเสี่ยง (risk-free rate) เปรียบเทียบกับค่าเบี่ยงเบนมาตรฐาน (standard deviation) ของกองทุนรวม ค่า Sharpe Ratio สะท้อนถึงอัตราผลตอบแทนที่ก่อ起กองทุนรวมได้รับ รับเพิ่มขึ้นเพื่อชดเชยกับความเสี่ยงที่ก่อตั้งกองทุนรวมรับมา โดยกองทุนรวมที่มีค่า Sharpe Ratio สูงจะเป็นกองทุนรวมที่มีประสิทธิภาพในการบริหารจัดการลงทุนที่ดีกว่า เมื่อจากได้รับผลตอบแทนส่วนเพิ่มที่สูงกว่าภายในตัวตนความเสี่ยงเดียวกัน

**Alpha** ผลตอบแทนต่างกันของกองทุนรวมเมื่อเปรียบเทียบกับดัชนีชี้วัด (benchmark) โดยค่า Alpha ที่สูง หมายถึง กองทุนรวมสามารถสร้างผลตอบแทนได้สูงกว่าดัชนีชี้วัด ซึ่งเป็นผลจากประสิทธิภาพของผู้จัดการกองทุนรวมในการคัดเลือกหรือหาจังหวะเข้าลงทุนในหลักทรัพย์ได้อย่างเหมาะสม

**Beta** ระดับและพิสัยการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุน โดยเปรียบเทียบกับอัตราการเปลี่ยนแปลงของตลาด Beta น้อยกว่า 1 แสดงว่า หลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนน้อยกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด Beta มากกว่า 1 แสดงว่า หลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนมากกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด

**Tracking Error** อัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมมีประสิทธิภาพในการเดินแบบดัชนีชี้วัด โดยหาก Tracking Error ต่ำ หมายถึงกองทุนรวมมีประสิทธิภาพในการสร้างผลตอบแทนให้ใกล้เคียงกับดัชนีชี้วัด กองทุนรวมที่มีค่า Tracking Error สูง จะมีอัตราผลตอบแทนโดยผลลัพธ์ห่างจากดัชนีชี้วัดมากขึ้น

**Yield to Maturity** อัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในตราสารหนี้โดยคิดอัตราดอกเบี้ยที่จะได้รับในอนาคตตลอดอายุตราสารและเงินต้นที่จะได้รับคืนน้ำมันคงคลัง เป็นมูลค่าปัจจุบัน โดยใช้ชี้วัดอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมตราสารหนี้ ค่านิยมจากดัชนีลี้ดั้งน้ำหนักของ Yield to Maturity ของตราสารหนี้แต่ละตัวที่กองทุนรวมมีการลงทุน และเนื่องจาก Yield to Maturity มีหน่วยมาตรฐานเป็นเปอร์เซ็นต์ต่อปี จึงสามารถนำไปใช้เปรียบเทียบอัตราผลตอบแทนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีน้ำมันฯลฯ อัตราดอกเบี้ยที่ต้องการลงทุนที่ใกล้เคียงกันได้

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

## ข้อมูลนโยบายการลงทุนของกองทุนเพิ่มเติม

### 1. วัตถุประสงค์การลงทุนที่เกี่ยวข้องกับความยั่งยืน

กองทุนจะลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งหุ้นของบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยและ/หรือตลาดหลักทรัพย์เอ็ม เอ ไอ โอดี้เจเน็ลลงทุนในบริษัทที่มีความสำคัญในการบริหารจัดการด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน (Environment, Social and Governance: ESG) และ/หรือบริษัทที่ช่วยลดผลกระทบของการเปลี่ยนแปลงของสภาพภูมิอากาศ ซึ่งมีแผนการดัดแปลง และการตั้งเป้าหมายเพื่อให้บรรลุเป้าหมายในการลดปริมาณการปล่อยก๊าซเรือนกระจกของประเทศไทย ซึ่งผ่านกระบวนการบริหารหักทองทุนแบบ ESG Integration โดยเฉพาะในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุนรวม

### 2. เป้าหมายที่กองทุนต้องการบรรลุ

กองทุนจะระหนักถึงบทบาทในฐานะนักลงทุนสถาบันในการสนับสนุนบริษัทที่มีความสำคัญในการบริหารจัดการด้านสิ่งแวดล้อม หรือด้านความยั่งยืน (Environmental, Social and Governance: ESG) โดยมีเป้าหมายในการผลักดันการพัฒนาด้านความยั่งยืนของตลาดทุนไทย รวมถึงส่งเสริมประเทศไทยในการเปลี่ยนผ่านไปสู่ความยั่งยืน (ESG Transition) หรือการบรรลุเป้าหมายในการแก้ไขปัญหาการเพิ่มขึ้นของอุณหภูมิโลกและลดผลกระทบจากการเปลี่ยนแปลงสภาพภูมิอากาศ (Climate Change) ตามเป้าหมายที่ 13 ของเป้าหมายการพัฒนาที่ยั่งยืน (Sustainable Development Goals: SDGs) ขององค์การสหประชาชาติ

### 3. ครอบคลุมของกองทุน (Investment Universe)

กองทุนมีนโยบายลงทุนในตราสารทุนดังต่อไปนี้ โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุนรวม

(1) หุ้นที่เป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนใน SET บนกระดานหลัก หรือกระดาน mai ที่ได้รับการคัดเลือกจาก SET หรือองค์กรหรือสถาบันอื่นที่สำนักงานคณะกรรมการกำกับและส่งเสริมการประกอบธุรกิจการลงทุน (SEC) ที่ผ่านเกณฑ์การคัดเลือกของ SET ESG Rating ในระดับ BBB ขึ้นไป โดยจะพิจารณาพนักงานกับปัจจัยด้าน ESG ในกระบวนการการดัดสินใจลงทุน (ESG Integration) และ/หรือ

(2) หุ้นที่เป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนใน SET บนกระดานหลัก หรือกระดาน mai ที่มีการเปิดเผยข้อมูลเกี่ยวกับการปล่อยก๊าซเรือนกระจก แผนการจัดการ และการตั้งเป้าหมายเพื่อให้บรรลุเป้าหมายในการลดปริมาณการปล่อยก๊าซเรือนกระจกของประเทศไทย รวมทั้งจัดให้มีการทวนสอบการจัดทำครัวเรือนฟุตพรินท์โดยผู้ที่ดูแลห้องสมุดที่สำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ต. ยอมรับ

(3) หุ้นที่เป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนใน SET บนกระดานหลักหรือกระดาน mai ที่มีลักษณะดังนี้

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

(3.2) มีการเปิดเผยเป้าหมายและแผนในเรื่องดังนี้ และรายงานความคืบหน้า การปฏิบัติตามเป้าหมายหรือแผน ผ่านช่องทางของ SET ซึ่งจัดไว้สำหรับการเปิดเผยข้อมูลดังกล่าวโดยเฉพาะ

(3.2.1) การมีเป้าหมายและแผนธุรกิจที่เกี่ยวข้องกับการเพิ่มมูลค่าของกิจการ (corporate value up plan)

(3.2.2) การมีเป้าหมายและแผนการขยายธุรกิจด้วยการดำเนินงานในเรื่องไดเร็ง ไดเร็งหนึ่ง ดังนี้ โดยต้องดึงเป้าหมายที่ดำเนินการให้เป็นไปตามแผนการขยายธุรกิจดังกล่าวให้แล้วเสร็จภายใน 2 ปีนับแต่วันที่เปิดเผยเป้าหมายและแผนการขยายธุรกิจ

(3.2.2.1) แผนดำเนินการที่ขัดเจนเพื่อเข้ารับการประเมินจาก ผู้ประเมินผลการดำเนินงานด้านความยั่งยืนตามมาตรฐานสากลตาม (1)

(3.2.2.2) เป้าหมายและแผนดำเนินการเพื่อลดปริมาณการปล่อยก๊าซเรือนกระจกของประเทศไทยตาม (2)

(3.3) มีการเพิ่มประสิทธิภาพการสื่อสารกับผู้ลงทุน ตามที่ SET กำหนด

4. การอ้างอิงดัชนีชี้วัดที่เกี่ยวข้องกับความยั่งยืน (Investment benchmark) ดัชนีชี้วัดของกองทุน ได้แก่ ดัชนี SET ESG Total Return Index ในสัดส่วน 100% ซึ่งเป็นดัชนีที่สะท้อนการเคลื่อนไหวราคาของกลุ่มหักทรัพย์ของบริษัทที่มีความสำคัญในด้านสิ่งแวดล้อม นิยมใช้ในการประเมินความยั่งยืนของบริษัทจดทะเบียนที่มีการดำเนินธุรกิจอย่างยั่งยืน โดยคำนึงถึงผู้มีส่วนได้เสียของบริษัทและกลุ่มทั้งด้านสังคมและสิ่งแวดล้อม มีกระบวนการบริหารจัดการเพื่อสร้างความยั่งยืนให้ก่อกร เช่น การบริหารความเสี่ยง การจัดการห่วงโซ่อุปทาน และการพัฒนาวัสดุรีไซเคิล รวมถึงเป็นกลุ่มหักทรัพย์ที่มีขนาดและสภาพคล่องผ่านตามเกณฑ์ที่ทางตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยกำหนด

โดยผู้อ้างอิงหุ้นของกองทุนสามารถศึกษาวิธีการจัดทำดัชนี (Index Methodology) ได้ที่ <https://www.set.or.th/th/market/index/setesg/profile>