

กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ หุ้นไทยยั่งยืนแอกทีฟ



ชนิดไทยเพื่อความยั่งยืนผ่านช่องทางอิเล็กทรอนิกส์ SCBTA(ThaiESGE)

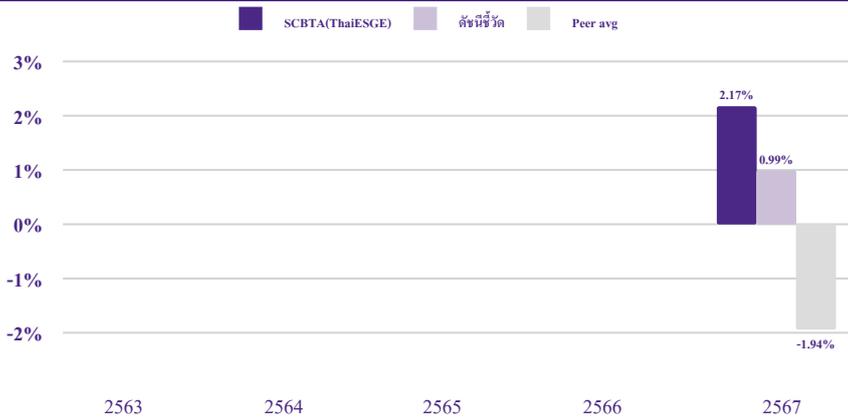
ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- ประเภทกองทุนรวม: กองทุนรวมตราสารทุน/กองทุนรวมที่มีนโยบายเปิดให้มีการลงทุนในกองทุนรวมอื่น ภายใต้ บลจ. เดียวกัน/กองทุนรวมเพื่อความยั่งยืน (SRI Fund)/กองทุนรวมไทยเพื่อความยั่งยืน/กองทุนรวมที่ลงทุนแบบไม่มีความเสี่ยงต่างประเทศ
- กลุ่มกองทุนรวม: Equity General

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- กองทุนจะลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งหุ้นของบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยและ/หรือตลาดหลักทรัพย์ เอ็ม เอ ไอ โดยจะเน้นลงทุนในบริษัทที่มีความโดดเด่นในการบริหารจัดการด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน (Environment, Social and Governance: ESG) และ/หรือบริษัทที่ช่วยลดผลกระทบของการเปลี่ยนแปลงของสภาพภูมิอากาศ ซึ่งมีแผนการจัดการ และการตั้งเป้าหมายเพื่อให้บรรลุเป้าหมายในการลดปริมาณการปล่อยก๊าซเรือนกระจกของประเทศไทย ซึ่งผ่านกระบวนการวิเคราะห์การลงทุนแบบ ESG Integration โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุนรวม กองทุนอาจลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมซึ่งอยู่ภายใต้การจัดการของบริษัทจัดการ โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่เกินร้อยละ 20 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน
- กองทุนอาจลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) เพื่อเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน (Efficient portfolio management) และ/หรือการบริหารความเสี่ยง
- กลยุทธ์ในการบริหารกองทุนรวม: มุ่งหวังให้ผลประกอบการเคลื่อนไหวสูงกว่าดัชนีชี้วัด (Active Management)

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (% ต่อปี)



หมายเหตุ: ในปีที่กองทุนจดทะเบียน ผลการดำเนินงานจะแสดงตั้งแต่วันที่จดทะเบียนกองทุนจนถึงสิ้นปีปฏิทิน

ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปีกumulative

	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี ¹	3 ปี ¹	5 ปี ¹	10 ปี ¹	ตั้งแต่จัดตั้ง ¹
SCBTA(ThaiESGE)	-15.35	-15.35	-19.49	N/A	N/A	N/A	N/A	-13.51
ดัชนีชี้วัด	-13.41	-13.41	-19.38	N/A	N/A	N/A	N/A	-12.55
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน ²	-14.08	-14.08	-18.17	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
ความผันผวนของกองทุน	8.92	8.92	11.07	N/A	N/A	N/A	N/A	11.96
ความผันผวนของดัชนีชี้วัด	8.52	8.52	10.56	N/A	N/A	N/A	N/A	11.88

หมายเหตุ: ¹ % ต่อปี

² ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน ตามการจัดกลุ่มกองทุนรวมของ AIMC category

ระดับความเสี่ยง



ลงทุนในตราสารทุนเป็นหลัก โดยเฉลี่ยในรอบปีไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน	18 ธันวาคม 2566
วันเริ่มต้น Class	2 กันยายน 2567
นโยบายการจ่ายปันผล	จ่าย
อายุกองทุน	ไม่กำหนดอายุโครงการ

ผู้จัดการกองทุนรวม

นายไพรัช นิตยานุภาพ	18 ธันวาคม 2566
นายกฤษ จันทร์หนัก	18 ธันวาคม 2566

ดัชนีชี้วัด

SET ESG Total Return Index 100%

คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวม ไม่ได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต

ได้รับการรับรองจาก CAC



การซื้อขายหน่วยลงทุน	การขายคืนหน่วยลงทุน
วันทำการซื้อ: ทุกวันทำการ	วันทำการขายคืน: ทุกวันทำการ
เวลาทำการ: เปิดทำการ ถึง 15.30 น.	เวลาทำการ: เปิดทำการ ถึง 15.30 น.
มูลค่าขั้นต่ำในการซื้อขายครั้งแรก: 1 บาท	มูลค่าขั้นต่ำในการขายคืน: ไม่กำหนด
มูลค่าขั้นต่ำในการซื้อขายครั้งถัดไป: 1 บาท	ยอดคงเหลือขั้นต่ำ: ไม่กำหนด
	ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน: T+2 คือ 2 วันทำการ หลังจากวันทำการขายคืน
	(ขอสงวนสิทธิ์เปลี่ยนแปลงระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืนจริงซึ่งอาจเร็วขึ้นหรือช้าลงกว่าเดิมได้ ทั้งนี้ ไม่เกิน 5 วันทำการนับจากวันทำการขายคืน)

- บริษัทจัดการอาจปฏิเสธคำสั่งซื้อและ/หรือคำสั่งขายเปลี่ยนแปลงหน่วยลงทุนเข้า หากมูลค่าหน่วยลงทุนคงเหลือมูลค่าการสั่งซื้อหน่วยลงทุนสุทธิ และมูลค่าการสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้าสู่สุทธิของแต่ละบัญชีผู้ถือหน่วยลงทุน และ/หรือผู้ถือหน่วยลงทุนแต่ละราย ในทุกหน่วยลงทุนชนิดช่องทางอิเล็กทรอนิกส์ และทุกหน่วยลงทุนชนิดเพื่อสิทธิประโยชน์ทางภาษีผ่านช่องทางอิเล็กทรอนิกส์* เมื่อรวมกันทุกกองทุนภายใต้การบริหารจัดการของบริษัทจัดการแล้ว มีมูลค่ารวมกันมากกว่าหนึ่งล้านบาท (มูลค่ารวมที่หนึ่ง) ทั้งนี้ สำหรับหน่วยลงทุนชนิดช่องทางอิเล็กทรอนิกส์ของกองทุนรวมเพื่อสิทธิประโยชน์ทางภาษี** และหน่วยลงทุนชนิดเพื่อสิทธิประโยชน์ทางภาษีผ่านช่องทางอิเล็กทรอนิกส์*จะกำหนดมูลค่ารวมกันไม่เกินสามแสนบาท (มูลค่ารวมที่สอง) โดยมูลค่ารวมที่สองนับรวมอยู่ในมูลค่ารวมที่หนึ่ง *หมายถึง ชนิดเพื่อการออมผ่านช่องทางอิเล็กทรอนิกส์ ชนิดไทยเพื่อความยั่งยืนผ่านช่องทางอิเล็กทรอนิกส์ และชนิดเพื่อสิทธิประโยชน์ทางภาษีผ่านช่องทางอิเล็กทรอนิกส์อื่นๆที่อาจมีขึ้นในอนาคต **หมายถึง กองทุนรวมเพื่อการเลี้ยงชีพ และกองทุนรวมเพื่อสิทธิประโยชน์ทางภาษีอื่นๆที่อาจมีขึ้นในอนาคต - การขายคืนหน่วยลงทุนอาจส่งผลให้ผู้ลงทุนต้องชำระคืนสิทธิประโยชน์ทางภาษี ดังนั้น ผู้ลงทุนมีหน้าที่ต้องศึกษาและปฏิบัติตามข้อกำหนดในกฎหมายภาษีอากร ทั้งนี้ สำหรับผู้ลงทุนที่จะได้รับสิทธิประโยชน์ทางภาษี จะต้องถือหน่วยลงทุนครบตามระยะเวลาที่กำหนดในกฎหมายภาษีอากรกำหนด ณ วันที่ขายหน่วยลงทุน

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV รวม VAT)		
ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	2.68	ยกเว้นไม่เรียกเก็บ
รวมค่าใช้จ่าย	3.21	0.12

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

ค่าธรรมเนียมการสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออกไปกองทุนรวมไทยเพื่อความยั่งยืนภายใต้การบริหารของบริษัทจัดการอื่น ไม่เกิน 3.21% อย่างไรก็ตาม ในช่วงแรก บริษัทจัดการยังไม่เปิดให้สับเปลี่ยนออกไปยังบริษัทจัดการอื่น

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน		ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก	
ประเภททรัพย์สิน	% NAV	ชื่อทรัพย์สิน	% NAV
หุ้น	92.85	หุ้น บมจ.แอดวานซ์ อินโฟร์ เซอร์วิส	8.37
เงินฝาก	5.67	หุ้น บมจ.เอสซีบี เอกซ์	6.13
อื่น ๆ	1.48	หุ้น บมจ.ซีพี ออลล์	5.70
		หุ้น บมจ.ปตท.	5.50
		หุ้น บมจ.ธนาคารกรุงไทย	5.24

ข้อมูลเชิงสถิติ	
Maximum Drawdown	-21.81%
Recovering Period	N/A
FX Hedging	-
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน	1.54 เท่า
Sharpe ratio	-1.24
Alpha	-0.98%
Beta	0.94
Tracking Error	-

การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม	
กลุ่มอุตสาหกรรม (Sector)	% NAV
พลังงานและสาธารณูปโภค	20.60
เทคโนโลยีสารสนเทศและการสื่อสาร	12.93
พาณิชย์	12.76
ธนาคาร	11.38
การแพทย์	7.30
อื่น ๆ	32.87

คำอธิบาย

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

Recovering Period ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาดังแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่เงินลงทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลานานเท่าใด

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

ข้อมูลนโยบายการลงทุนของกองทุนเพิ่มเติม

1. วัตถุประสงค์การลงทุนที่เกี่ยวข้องกับความยั่งยืน

กองทุนจะลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งหุ้นของบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยและ/หรือตลาดหลักทรัพย์ เอ็ม เอ ไอ โดยจะเน้นลงทุนในบริษัทที่มีความโดดเด่นในการบริหารจัดการด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน (Environment, Social and Governance: ESG) และ/หรือบริษัทที่ช่วยลดผลกระทบของการเปลี่ยนแปลงของสภาพภูมิอากาศ ซึ่งมีแผนการจัดการ และการตั้งเป้าหมายเพื่อให้บรรลุเป้าหมายในการลดปริมาณการปล่อยก๊าซเรือนกระจกของประเทศไทย ซึ่งผ่านกระบวนการวิเคราะห์การลงทุนแบบ ESG Integration โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุนรวม

2. เป้าหมายที่กองทุนต้องการบรรลุ

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

3. กรอบการลงทุน (Investment Universe)

กองทุนมีนโยบายลงทุนในตราสารทุนดังต่อไปนี้ โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุนรวม

(1) หุ้นที่เป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนใน SET บนกระดานหลัก หรือกระดาน mai ที่ได้รับการคัดเลือกจาก SET หรือองค์กรหรือสถาบันอื่นที่สำนักงานยอมรับว่ามีความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน (Environment, Social and Governance: ESG) ที่ผ่านเกณฑ์การคัดเลือกของ SET ESG Rating ในระดับ BBB ขึ้นไป โดยจะพิจารณาผนวกกับปัจจัยด้าน ESG ในกระบวนการตัดสินใจลงทุน (ESG Integration) และ/หรือ

(2) หุ้นที่เป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนใน SET บนกระดานหลัก หรือกระดาน mai ที่มีกรเปิดเผยข้อมูลเกี่ยวกับการปล่อยก๊าซเรือนกระจก แผนการจัดการ และการตั้งเป้าหมายเพื่อให้บรรลุเป้าหมายในการลดปริมาณการปล่อยก๊าซเรือนกระจกของประเทศไทย รวมทั้งจัดให้มีการทวนสอบการจัดทำคาร์บอนฟุตพริ้นท์โดยผู้ทวนสอบที่สำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ด. ยอมรับ

(3) หุ้นที่เป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนใน SET บนกระดานหลักหรือกระดาน mai ที่มีลักษณะดังนี้

(3.1) เป็นหุ้นของบริษัทจดทะเบียนที่มีธรรมาภิบาล (Governance) โดยได้รับการประเมินการกำกับดูแลกิจการบริษัทจดทะเบียน (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) การมีเป้าหมายและแผนการยกระดับการดำเนินงานในเรื่องใดเรื่องหนึ่ง ดังนี้ โดยต้องตั้งเป้าหมายเพื่อดำเนินการให้เป็นไปตามแผนการยกระดับดังกล่าวให้แล้วเสร็จภายใน 2 ปีนับแต่วันที่เปิดเผยเป้าหมายและแผนการยกระดับ

(3.2.2.1) แผนดำเนินการที่ชัดเจนเพื่อเข้ารับการประเมินจาก ผู้ประเมินผลการดำเนินงานด้านความยั่งยืนตามมาตรฐานสากลตาม (1)

(3.2.2.2) เป้าหมายและแผนดำเนินการเพื่อลดปริมาณการปล่อยก๊าซเรือนกระจกของประเทศไทยตาม (2)

(3.3) มีการเพิ่มประสิทธิภาพการสื่อสารกับผู้ลงทุน ตามที่ SET กำหนด

4. การอ้างอิงดัชนีชี้วัดที่เกี่ยวกับความยั่งยืน (investment benchmark) ดัชนีชี้วัดของกองทุน ได้แก่ ดัชนี SET ESG Total Return Index ในสัดส่วน 100% ซึ่งเป็นดัชนีที่สะท้อนการเคลื่อนไหวราคาของกลุ่มหลักทรัพย์ของบริษัทที่มีความโดดเด่นด้านปัจจัย ESG ซึ่งจะเป็นการสนับสนุนบริษัทจดทะเบียนที่มีการดำเนินธุรกิจอย่างยั่งยืน โดยคำนึงถึงผู้มีส่วนได้เสียอย่างครอบคลุมทั้งด้านสังคมและสิ่งแวดล้อม มีกระบวนการบริหารจัดการเพื่อสร้างความยั่งยืนให้แก่องค์กร เช่น การบริหารความเสี่ยง การจัดการห่วงโซ่อุปทาน และการพัฒนานวัตกรรม รวมถึงเป็นกลุ่มหลักทรัพย์ที่มีขนาดและสภาพคล่องผ่านตามเกณฑ์ที่ทางตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยกำหนด

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