



กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ ตราสารหนี้ไทยยั่งยืน

ชนิดไทยเพื่อความยั่งยืนผ่านช่องทางอิเล็กทรอนิกส์ SCBTB(ThaiESGE)

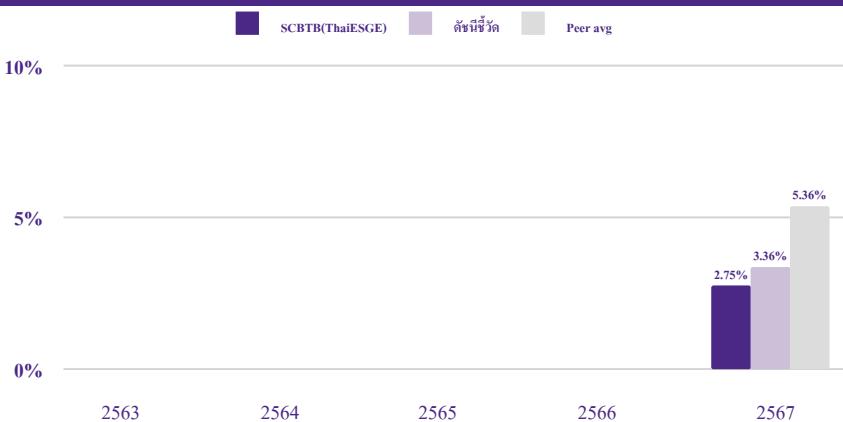
ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- ประเภทกองทุนรวม:** กองทุนรวมตราสารหนี้/กองทุนรวมที่มีเนินนโยบายเปิดให้รับการลงทุนในกองทุนรวมอื่นภายใต้ บลจ. เดียวทัน/กองทุนรวมเพื่อความยั่งยืน (SRI Fund)/กองทุนรวมไทยเพื่อความยั่งยืน/กองทุนรวมที่ลงทุนแบบปันแม้มีความเสี่ยงต่างประเทศ
- กลุ่มกองทุนรวม:** Long Term General Bond

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- กองทุนมีนโยบายการลงทุนในตราสารเพื่อหุ้นรักษ์สิ่งแวดล้อม (green bond) ตราสารเพื่อความยั่งยืน (sustainability bond) หรือตราสารส่งเสริมความยั่งยืน (sustainability - linked bond) ที่มีการเปิดเผยข้อมูลตามที่สำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ต. กำหนด หรือพันธบัตรหรือหุ้นที่เพื่อหุ้นรักษ์สิ่งแวดล้อม (green bond) พันธบัตรหรือหุ้นที่เพื่อความยั่งยืน (sustainability bond) หรือพันธบัตรหรือหุ้นที่ส่งเสริมความยั่งยืน (sustainability - linked bond) โดยมี net exposure ในทรัพย์สินดังกล่าวโดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่เกินร้อยละ 20 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุนรวม**
- กองทุนอาจลงทุนในหุ้นรายเดียวอย่างเดียวได้หากการจัดการของบิรชัยจัดการ โดยฉลุยในรอบปีบัญชีไม่เกินร้อยละ 20 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน
- กองทุนอาจลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) เพื่อเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน (Efficient portfolio management) และ/หรือการบริหารความเสี่ยง
- กลยุทธ์ในการบริหารกองทุนรวม: มุ่งหวังให้ผลประกอบการเคลื่อนไหวสูงกว่าดัชนีชี้วัด (active management)

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (%) ต่อปี



หมายเหตุ: ไม่ใช่กองทุนจดทะเบียน ผลการดำเนินงานจะแสดงตั้งแต่วันที่จดทะเบียนกองทุนจนถึงอัปเดตปีปฏิทิน

ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบบึกบึน

	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี ¹	3 ปี ¹	5 ปี ¹	10 ปี ¹	ตั้งแต่ จัดตั้ง
SCBTB(ThaiESGE)	3.42	3.42	6.14	N/A	N/A	N/A	N/A	6.26
ดัชนีชี้วัด	3.92	3.92	6.86	N/A	N/A	N/A	N/A	7.40
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน ²	2.49	2.49	4.12	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
ความผันผวนของกองทุน	1.73	1.73	2.19	N/A	N/A	N/A	N/A	2.21
ความผันผวนของดัชนีชี้วัด	2.03	2.03	2.54	N/A	N/A	N/A	N/A	2.60

หมายเหตุ: ¹ % ต่อปี

² ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน ตามการจัดกลุ่มกองทุนรวมของ AIMC category

ระดับความเสี่ยง

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

ลงทุนในพันธบัตรรัฐบาล และตราสารหนี้ออกชน โดยมีตราสาร non-investment grade / unrated ไม่เกิน 20% ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน	17 กันยายน 2567
วันเริ่มต้น Class	17 กันยายน 2567
นโยบายการจ่ายเงินปั๊บผล	ไม่จ่าย
อายุกองทุน	ไม่กำหนดอายุโครงการ

ผู้จัดการกองทุนรวม

นายพีรวิชญ์ ลิ้มเดชาพันธ์	17 กันยายน 2567
น.ส.วชรา สอดพิริยานวย	17 กันยายน 2567

ดัชนีชี้วัด

ThaiBMA Government Bond ESG Index Net Total Return 100%

คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวม ไม่ได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านพุทธิ

ได้รับการรับรองจาก CAC

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือบริหารความเสี่ยง
ด้านสภาพคล่องได้ที่หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



www.scbam.com

การซื้อหุ้นนำ返しลงทุน		การขายคืนหุ้นนำ返しลงทุน		ข้อมูลเชิงสถิติ						
วันทำการซื้อ: ทุกวันทำการ	วันทำการขายคืน: ทุกวันทำการ	เวลาทำการ: เปิดทำการ อีง 15.30 น.	เวลาทำการ: เปิดทำการ อีง 15.30 น.	Maximum Drawdown	-1.58%					
เวลาทำการ: เปิดทำการ อีง 15.30 น.	มูลค่าหุ้นต่อในการซื้อขายครั้งแรก: 1 บาท	มูลค่าหุ้นต่อในการขายคืน: ไม่กำหนด	ยอดคงเหลือหุ้นต่อ: ไม่กำหนด	Recovering Peroid	1 เดือน					
มูลค่าหุ้นต่อในการซื้อขายครั้งแรก: 1 บาท	มูลค่าหุ้นต่อในการขายคืน: ไม่กำหนด	ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน: T+2 คือ 2 วันทำการ	หลักทรัพย์ที่สามารถขายคืน	FX Hedging	-					
มูลค่าหุ้นต่อในการซื้อขายครั้งถัดไป: 1 บาท	(ข้อสงวนสิทธิเปลี่ยนแปลงระยะเวลารับเงินค่าขายคืนจริงซึ่งอาจเร็วขึ้นหรือช้าลงกวนได้ด้วยสาเหตุใดๆ ก็ได้ ทั้งนี้ ไม่เกิน 5 วันทำการนับจากวันทำการขายคืน)	ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน: T+2 คือ 2 วันทำการ	หลักทรัพย์ที่สามารถขายคืน	อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน	0.35 เท่า					
				อายุเฉลี่ยของตราสารหนี้	9 ปี 1 เดือน 20 วัน					
				Yield to Maturity	2.06% ต่อปี					
การจัดสรรการลงทุนในผู้ออกตราสาร 5 อันดับแรก										
ผู้ออกตราสาร		Credit rating	% NAV							
รัฐบาลประเทศไทย		AAA	92.32							
ธนาคารแห่งประเทศไทย		AAA	6.41							
บมจ.ธนาคารกสิกรไทย		AA+(tha)	1.00							
บมจ.โกรงแรมเซ็นทรัลพลาซา		A-	0.25							
บมจ.เมตตาเวช อินฟอร์ เซอร์วิส		AAA(tha)	0.15							
การจัดสรรการลงทุนตามอันดับความน่าเชื่อถือ (%)										
ในประเทศ		National	International							
GOV/AAA/AAA(tha)		98.89								
A/A(tha)		0.25								
ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV รวม VAT)										
ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง								
การจัดการ	2.68	ยกเว้นไม่เรียกเก็บ								
รวมค่าใช้จ่าย	3.21	0.10								
หมายเหตุ: - บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์ หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ										
ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้อ่อนนวย (% ของมูลค่าซื้อขาย รวม VAT)										
ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง								
การขาย	3.21	ยกเว้นไม่เรียกเก็บ								
การรับซื้อคืน	3.21	ยกเว้นไม่เรียกเก็บ								
การซื้อเปลี่ยนหุ้นนำ返ษา	3.21	ยกเว้นไม่เรียกเก็บ								
การซื้อเปลี่ยนหุ้นนำ返ษาออก	3.21	ยกเว้นไม่เรียกเก็บ								
การโอนหุ้นนำ返ษา	10 บาท ต่อ 1,000 หน่วย	10 บาท ต่อ 1,000 หน่วย								
หมายเหตุ: - บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์ หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ										
- ค่าธรรมเนียมการซื้อเปลี่ยนหุ้นนำ返ษาอุทธรณ์ ไม่เกิน 3.21% อย่างไรก็ตาม ในช่วงแรกบริษัทจัดการยังไม่เปิดให้สับเปลี่ยนออกบันธิษัทจัดการอื่น										
สัดส่วนประเทศทรัพย์สินที่ลงทุน		ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก								
ประเภททรัพย์สิน	% NAV	ชื่อทรัพย์สิน	Credit rating	% NAV						
พันธบัตรรัฐบาล / ธนาคารแห่งประเทศไทย / รัฐวิสาหกิจ	92.95	พันธบัตรรัฐบาลเพื่อความยั่งยืนสำหรับบริหารหนี้ที่ดูดีที่สุดในปีงบประมาณ พ.ศ. 2563 ครั้งที่ 1	AAA	33.74						
ตัวเงินคลัง	5.78	พันธบัตรรัฐบาลเพื่อความยั่งยืนสำหรับบริหารหนี้ที่ดูดีที่สุดในปีงบประมาณ พ.ศ. 2565 ครั้งที่ 1	AAA	32.32						
เงินฝาก	1.00	พันธบัตรรัฐบาลเพื่อความยั่งยืนสำหรับปรับปรุงโครงสร้างหนี้ (พ.ร.ก. จัดการโภคภัย COVID-19) ในปีงบประมาณ พ.ศ. 2565 ครั้งที่ 5	AAA	19.84						
ตราสารหนี้ภาครัฐฯ	0.40	พันธบัตรรัฐบาล ส่งเสริมความยั่งยืนในปีงบประมาณ พ.ศ. 2568 ครั้งที่ 1	AAA	5.78						
อื่นๆ	-0.14	ตัวเงินคลังงวดที่ (DM) 2/181/68	AAA	2.72						
		พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย	AAA							

คำศัพด์ไทย

Maximum Drawdown เปอร์เซ็นต์ผลขาดทุนสูงสุดของกองทุนรวมในระยะเวลา 5 ปีขั้นหลัง (หรือตั้งแต่จัดตั้งกองทุนกรณีที่เข้าไม่ครบ 5 ปี) โดยหัวใจการคำนวณ NAV ต่อหน่วยปรับตัวลดลง ค่า Maximum Drawdown เป็นข้อมูลที่ช่วยให้ทราบถึงความเสี่ยงที่อาจมีต่อการลงทุนในกองทุนรวม

Recovering Period ระยะเวลาการฟื้นฟู เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาดังต่อไปนี้

FX Hedging เปอร์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

อัตราหักภาษีที่ต้องเสียเมื่อขายหุ้นที่ได้รับประโยชน์จากการลงทุนในหุ้นของบริษัทที่มีผลประโยชน์ทางการเงิน คือ Portfolio Turnover ความถี่ของการซื้อขายหุ้นที่ต้องเสียภาษีนี้ในช่วงเวลาหนึ่ง โดยคำนวณจากปัจจัยที่ต้องคำนึงถึง เช่น จำนวนเงินที่ลงทุน ระยะเวลาที่ลงทุน จำนวนหุ้นที่ซื้อขาย ฯลฯ หุ้นที่ซื้อขายบ่อยจะมีอัตราหักภาษีสูงกว่าหุ้นที่ซื้อขายบ่อยน้อย แต่ก็ต้องคำนึงถึงผลกระทบต่อผลประโยชน์ทางการเงินที่อาจเกิดขึ้น

Sharpe Ratio อัตราส่วนระหว่างผลตอบแทนส่วนต่างของกองทุนรวมปีริบบ์เทียบกับความเสี่ยงจากการลงทุน โดยคำนวณจากผลต่างระหว่างอัตราผลตอบแทนที่ปราศจากความเสี่ยง (risk-free rate) ปีริบบ์เทียบกับค่าเบี่ยงเบนมาตรฐาน (standard deviation) ของกองทุนรวม ค่า Sharpe Ratio สะท้อนถึงอัตราผลตอบแทนที่กองทุนรวมควรได้รับเพิ่มขึ้นเพื่อชดเชยกับความเสี่ยงที่กองทุนรวมรับมา โดยกองทุนรวมที่มีค่า Sharpe Ratio สูงกว่าจะเป็นกองทุนรวมที่มีประสิทธิภาพในการบริหารจัดการลงทุนที่ดีกว่า เมื่อเทียบกับกองทุนอื่นๆ

Alpha ผลตอบแทนต่างกันของกองทุนรวมเมื่อเทียบกับดัชนีชี้วัด (benchmark) โดยค่า Alpha ที่สูง หมายถึง กองทุนรวมสามารถสร้างผลตอบแทนได้สูงกว่าดัชนีชี้วัด ซึ่งเป็นผลจากประสิทธิภาพแข็งแกร่งของการลงทุนรวมในการอัปเดตเลือกหุ้นใหม่จังหวะเข้าลงทุนในหุ้นลึกทั้งปัจจุบัน

Beta ระดับและทิศทางการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของหุ้นก็จะเปลี่ยนไปพร้อมกับการลงทุนในหุ้นต่างประเทศ พอร์ตการลงทุนที่มีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนหุ้นต่างๆ หุ้นก็จะเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของหุ้นต่างประเทศ เช่นหุ้นของตลาด Beta มากกว่า 1 แสดงว่า หลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนจะเพิ่มขึ้นตามหุ้นของตลาด Beta มากกว่า 1 หุ้นก็จะเพิ่มขึ้นตามหุ้นของตลาด Beta มากกว่า 1 แสดงว่า หลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนจะลดลงตามหุ้นของตลาด Beta มากกว่า 1 หุ้นก็จะลดลงตามหุ้นของตลาด Beta

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

Yield to Maturity อัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในตราสารหนี้โดยอิงจากจำนวนคงค้างอยู่ที่จะได้รับในอนาคตลดลงตามอัตราและเงินเดือนที่จะได้รับคืนนำมาคิดคณิตเป็นมูลค่าปัจจุบัน โดยใช้วัดอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมตราสารหนี้ คำนวณจากค่าเหลือสิ่งที่เหลืออยู่ในหักของ Yield to Maturity ของตราสารหนี้แต่ละตัวที่กองทุนรวมมีการลงทุน และเนื่องจาก Yield to Maturity มีหน่วยมาตราฐานเป็นเปอร์เซ็นต์ต่อปี จึงสามารถนำไปใช้เปรียบเทียบอัตราผลตอบแทนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีนิยามเดียวกันของตราสารหนี้กับกำหนดอายุและมีลักษณะการลงทุนที่ใกล้เคียงกันได้

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด

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

ท้าย: ชั้น 7-8 อาคาร 1 ไทยพาณิชย์ ใจรัก พลาซ่า เลขที่ 18 ถนนรัชดาภิเษก

ข้อมูลนโยบายการลงทุนของกองทุนเพื่อความยั่งยืน

1. วัตถุประสงค์การลงทุนที่เกี่ยวข้องกับความยั่งยืน

กองทุนจะลงทุนในหุ้นที่มีไว้ซึ่งตราสารเพื่อนำรักษาสิ่งแวดล้อม (green bond) ตราสารเพื่อความยั่งยืน (sustainability bond) หรือตราสารส่งเสริมความยั่งยืน (sustainability - linked bond) ที่มีการเปิดเผยข้อมูลตามที่สำนักงานคณะกรรมการกำกับและส่งเสริมการประกอบธุรกิจ (ก.ส.ด.) กำหนด หรือพันธบัตรหรือหุ้นกู้เพื่อนำรักษาสิ่งแวดล้อม (green bond) พันธบัตรหรือหุ้นกู้เพื่อความยั่งยืน (sustainability bond) หรือพันธบัตรหรือหุ้นส่งเสริมความยั่งยืน (sustainability - linked bond) ซึ่งหันกระบวนการคัดเลือกหลักทรัพย์แบบ Screening โดยมี net exposure ในทรัพย์สินดังกล่าวโดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุนรวม

2. เป้าหมายที่กองทุนต้องการบรรลุ

กองทุนจะระหนักถึงบทบาทในฐานะนักลงทุนสถาบันในการสนับสนุนภารกิจและภาคเอกชนที่มีวัตถุประสงค์การใช้เงินที่ได้จากการระดมทุน (use of proceeds) เพื่อสนับสนุนการบริหารจัดการด้านสิ่งแวดล้อม หรือด้านความยั่งยืน (Environmental, Social and Governance: ESG) โดยมีเป้าหมายในการผลักดันการพัฒนาด้านความยั่งยืนของตลาดทุนไทย รวมถึงส่งเสริมประเทศไทยในการเปลี่ยนผ่านไปสู่ความยั่งยืน (ESG Transition) หรือการบรรลุเป้าหมายการพัฒนาที่ยั่งยืน (Sustainable Development Goals: SDGs) ขององค์การสหประชาชาติ

3. ครอบคลุมกองทุน (Investment Universe)

กองทุนมีนโยบายการลงทุนซึ่งจะส่งผลให้มี net exposure ในทรัพย์สินดังด่อไปนี้ โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุนรวม

(1) ตราสารเพื่อนำรักษาสิ่งแวดล้อม (green bond) ตราสารเพื่อความยั่งยืน (sustainability bond) หรือตราสารส่งเสริมความยั่งยืน (sustainability - linked bond) ที่ออกตามประกาศคณะกรรมการกำกับดูแลตลาดทุนว่าด้วยการขออนุญาตและการอนุญาตให้เสนอขายตราสารหนี้ที่ออกใหม่ต่อประชาชนเป็นการทั่วไป ประกาศคณะกรรมการกำกับดูแลตลาดทุนว่าด้วยการขออนุญาตและการอนุญาตให้เสนอขายตราสารหนี้ที่ออกใหม่ต่อนักลงทุนในวงจำกัด และการเสนอขายหุ้นกู้แปลงสภาพต่อนักลงทุนที่มีลักษณะเฉพาะ หรือประกาศคณะกรรมการกำกับดูแลตลาดทุนว่าด้วยข้อกำหนดที่เกี่ยวกับการออกและเสนอขายศุลกากร และการเปิดเผยข้อมูล แล้วแต่กรณี ซึ่งมีการเปิดเผยข้อมูลในแบบแสดงรายการข้อมูลการเสนอขายตราสารหรือเอกสารที่นำเสนอต่อผู้ลงทุนในการเสนอขายตราสารดังกล่าวในคราวเดียวกัน

(1.1) กรณีเป็นตราสารเพื่อนำรักษาสิ่งแวดล้อมหรือตราสารเพื่อความยั่งยืน ต้องมีการเปิดเผยวัตถุประสงค์การใช้เงินที่ได้จากการระดมทุน (use of proceeds) ว่าเป็นไปเพื่อโครงการที่เกี่ยวข้องกับการอนุรักษ์สิ่งแวดล้อมหรือเพื่อโครงการที่เกี่ยวข้องกับความยั่งยืนของประเทศไทย แล้วแต่กรณี

(1.2) กรณีเป็นตราสารส่งเสริมความยั่งยืนด้องมีการเปิดเผยข้อมูลที่เกี่ยวกับการกำกับดูแลที่สำคัญด้านความยั่งยืนเพื่อส่งเสริมความยั่งยืนของผู้ออกตราสารดังกล่าวในประเทศไทย

(2) พันธบัตรรัฐบาล พันธบัตรที่กระทรวงการคลังก้าวประกันดันเงินและดอกเบี้ย หรือหุ้นกู้ที่กระทรวงการคลังก้าวประกันดันเงินและดอกเบี้ยแต่ไม่รวมถึงหุ้นกู้แปลงสภาพ ซึ่งเป็นพันธบัตรหรือหุ้นกู้เพื่อนำรักษาสิ่งแวดล้อม (green bond) พันธบัตรหรือหุ้นกู้เพื่อความยั่งยืน (sustainability bond) หรือพันธบัตรหรือหุ้นส่งเสริมความยั่งยืน (sustainability - linked bond)

อย่างไรก็ตี การลงทุนในทรัพย์สินอื่นใดนอกเหนือจากการลงทุน (Investment Universe) ข้างต้น จะเป็นไปในลักษณะที่ไม่ทำให้กองทุนมี net exposure ในกระบวนการลงทุนดังกล่าว โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน

4. การอ้างอิงดัชนีที่วัดที่เกี่ยวกับความยั่งยืน (investment benchmark)

ดัชนี Government Bond ESG Index ซึ่งเป็นกลุ่มดัชนีตราสารหนี้ ESG ที่ออกโดยธราษฎร์ฯ

โดยผู้ให้หน่วยลงทุนสามารถดูรายละเอียดดัชนีได้ที่ <https://www.thaibma.or.th/EN/Market/Index/ESGIndex.asp>