



กองทุนเปิดเค Target Net Zero หุ่นไทย ชนิดไทยเพื่อความยั่งยืน

K-TNZ-ThaiESG

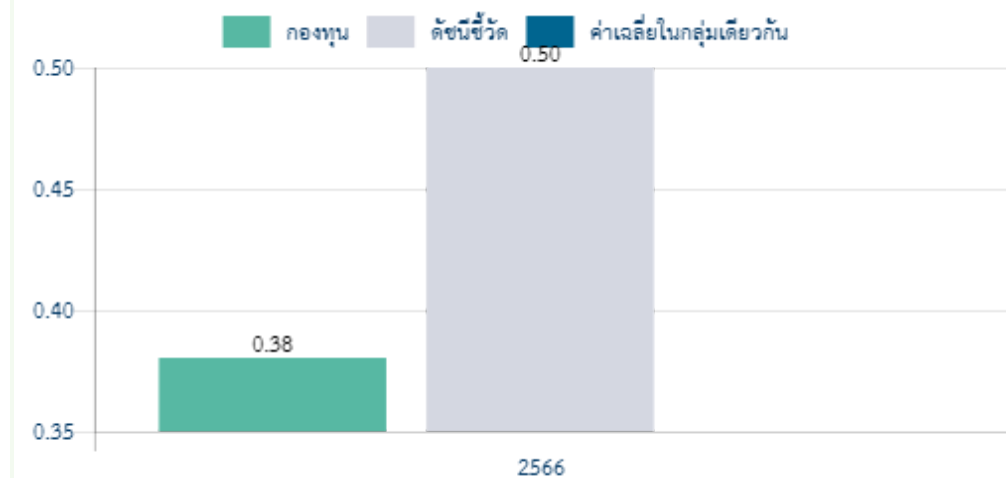
ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมตราสารทุน / กองทุนรวมดัชนี / กองทุนรวมไทยเพื่อความยั่งยืน / กองทุนรวมเพื่อความยั่งยืน (SRI Fund)
- กลุ่ม Equity General

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- กองทุนมีวัตถุประสงค์ในการช่วยส่งเสริมการลดผลกระทบจากการเปลี่ยนแปลงของสภาพภูมิอากาศ และมีการบริหารจัดการพอร์ตการลงทุนโดยมีเป้าหมายให้ปริมาณการปล่อยก๊าซเรือนกระจกโดยเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักรวมและอุณหภูมิของพอร์ตการลงทุนรวมต่ำกว่าดัชนีชี้วัด และสนับสนุนให้ภาคธุรกิจมีส่วนในการขับเคลื่อนประเทศไทยให้สามารถบรรลุเป้าหมายตามข้อตกลงปารีสที่มุ่งลดการปล่อยก๊าซเรือนกระจกเป็นศูนย์ (Net Zero) ภายในปี พ.ศ. 2608
- กองทุนจะมุ่งสร้างผลตอบแทนก่อนหักค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายให้ใกล้เคียงกับผลตอบแทนของดัชนี SET100 TRI โดยจะลงทุนในหุ้นของบริษัทที่เป็นองค์ประกอบของดัชนี SET100 TRI และเป็นบริษัทที่มีการเปิดเผยข้อมูลเกี่ยวกับการปล่อยก๊าซเรือนกระจก แผนการจัดการ และตั้งเป้าหมายเพื่อให้บรรลุเป้าหมายในการลดปริมาณการปล่อยก๊าซเรือนกระจกของประเทศไทย รวมทั้งจัดให้มีการทวนสอบการจำกัดคาร์บอนฟุตพริ้นท์โดยผู้ทวนสอบที่สำนักงาน ก.ล.ต. ยอมรับ และหรือเป็นบริษัทที่ได้รับการคัดเลือกว่ามีความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อมหรือด้านความยั่งยืน โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV
- กองทุนจะใช้กลยุทธ์แบบคัดกรองเชิงบวก โดยมี Lombard Odier Asset Management (Switzerland) SA เป็นที่ปรึกษาการลงทุน และใช้วิธีการ Implied Temperature Rise (ITR) ในการสร้างพอร์ตการลงทุน
- กองทุนอาจลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเพื่อการเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน
- มุ่งหวังให้ผลประกอบการเคลื่อนไหวตามดัชนีชี้วัด (passive management/index tracking)

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (% ต่อปี)



ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด (%)

	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี *
กองทุน	-2.85	2.05	N/A	N/A
ดัชนีชี้วัด	-2.46	2.28	N/A	N/A
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	-1.86	2.12	N/A	N/A
ความผันผวนกองทุน	11.90	11.89	N/A	N/A
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	12.15	12.17	N/A	N/A
	3 ปี *	5 ปี *	10 ปี *	ตั้งแต่จัดตั้ง *
กองทุน	N/A	N/A	N/A	-2.47
ดัชนีชี้วัด	N/A	N/A	N/A	-1.97
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	N/A	N/A	N/A	N/A
ความผันผวนกองทุน	N/A	N/A	N/A	11.59
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	N/A	N/A	N/A	11.83

หมายเหตุ : * % ต่อปี

ระดับความเสี่ยง

ต่ำ 1 2 3 4 5 6 7 8 สูง

ความเสี่ยงสูง

ลงทุนในตราสารทุนเป็นหลัก โดยเฉลี่ยในรอบปีไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน	22 ธ.ค. 66
วันเริ่มต้น class	22 ธ.ค. 66
นโยบายการจ่ายเงินปันผล	ไม่จ่าย
อายุกองทุน	ไม่กำหนด

ผู้จัดการกองทุนรวม

น.ส. เพชรรัตน์ โพธิ์วัฒนะเสถียร (ตั้งแต่ 22 ธ.ค. 66)
น.ส. วรินทร์ ผ่องใส (ตั้งแต่ 22 ธ.ค. 66)

ดัชนีชี้วัด :

1. ดัชนีผลตอบแทนรวม SET 100 (SET100 TRI) (100.00%)

คำเตือน:

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวม มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต : ได้รับการรับรองจาก CAC

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

ผู้ลงทุนสามารถศึกษา
เครื่องมือบริหารความเสี่ยง
ด้านสภาพคล่องได้ใน
หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



www.kasikornasset.com

การซื้อขายหน่วยลงทุน

วันทำการซื้อ : ทุกวันทำการ

เวลาทำการ : 08:30 น. - 15:30 น.

การซื้อขายครั้งแรกขั้นต่ำ : 500 บาท

การซื้อขายครั้งถัดไปขั้นต่ำ : 500 บาท

หมายเหตุ :

การขายคืนหน่วยลงทุน

วันทำการขายคืน : ทุกวันทำการ

เวลาทำการ : 08:30 น. - 15:30 น.

การขายคืนขั้นต่ำ : ไม่กำหนด

ยอดคงเหลือขั้นต่ำ : ไม่กำหนด

ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน : T+2

(ประกาศ NAV T+1 คืนเงิน T+2 เวลา 10.00 น.เป็นต้นไป)

ข้อมูลเชิงสถิติ

Maximum Drawdown	-6.68 %
Recovering Period	N/A
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน	0.01 เท่า
Sharpe Ratio	N/A
Alpha	N/A
Beta	N/A
Tracking Error	N/A

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	1.0700	0.2675
รวมค่าใช้จ่าย	2.8890	0.4976

หมายเหตุ : ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะ หรือภาษีอื่นใดแล้ว

• บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริง เพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการ

บริหารจัดการ

ค่าธรรมเนียมที่ปรึกษาการลงทุน : ไม่เกิน 0.5350% (เก็บจริง 0.1712%)

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การขาย	1.00	ยกเว้น
การรับซื้อคืน	1.00	ยกเว้น
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า	3.00	ยกเว้น
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก	3.00	ยกเว้น
การโอนหน่วย	ตามที่เก็บจริง	ไม่เรียกเก็บ

หมายเหตุ : ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะ หรือภาษีอื่นใดแล้ว

• บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริง เพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการ

บริหารจัดการ

• ค่าปรับกรณีขายคืนก่อนระยะเวลาถือครองที่กำหนด : กรณีถือครองต่ำกว่า 1 ปี ไม่เกิน 1.50% ของมูลค่าซื้อขาย (ปัจจุบัน ยกเว้น)

• ค่าธรรมเนียมการสับเปลี่ยนเข้า (Switching In) : อัตราเท่ากับค่าธรรมเนียมการรับซื้อคืนหน่วยลงทุนของกองทุนต้นทาง หรือค่าธรรมเนียมการขายหน่วยลงทุนของกองทุนปลายทางแล้วแต่อัตราใดจะสูงกว่า

• ค่าธรรมเนียมการสับเปลี่ยนออก (Switching Out) :

- สับเปลี่ยนไป Thai ESG ภายใน บลจ.กสิกรไทย : ยกเว้น

- สับเปลี่ยนไป Thai ESG บลจ.อื่น : 1.00% ของมูลค่าหน่วยลงทุนของวันทำการล่าสุดก่อนวันทำการสับเปลี่ยนหน่วยลงทุน

- สับเปลี่ยนไปกองทุนอื่นภายใต้ บลจ. กสิกรไทย : อัตราเท่ากับค่าธรรมเนียมการรับซื้อคืนหน่วยลงทุนของกองทุนต้นทาง หรือค่าธรรมเนียมการขายหน่วยลงทุนของกองทุนปลายทางแล้วแต่อัตราใดจะสูงกว่า

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน

ประเภททรัพย์สิน	% NAV	ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก	
		ทรัพย์สิน	% NAV
ตราสารทุน	98.57	หุ้น บมจ.ปตท.	7.50
เงินฝาก	1.32	หุ้น บมจ.ท่าอากาศยานไทย	7.15
อื่นๆ	0.10	หุ้น บมจ.เดลินิวส์ อิเลคโทรนิคส์(ประเทศไทย)	6.69
		หุ้น บมจ.ปตท.สำรวจและผลิตปิโตรเลียม	4.73
		หุ้น บมจ.แอดวานซ์ อินโฟร์ เซอร์วิส	4.51

การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม

อุตสาหกรรม	% NAV
พลังงานและสาธารณูปโภค	22.53
ธนาคาร	11.88
ขนส่งและโลจิสติกส์	9.34
เทคโนโลยีสารสนเทศและการสื่อสาร	8.52
พาณิชย์	8.43

คำอธิบาย

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

Recovering Period ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาตั้งแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลานานเท่าใด

FX Hedging เปรอ์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตกองทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลานึง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์กับผลรวมของมูลค่าการขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 1 ปีหารด้วยมูลค่า NAV ของกองทุนรวมเฉลี่ยในรอบระยะเวลาเดียวกัน กองทุนรวมที่มีค่าอัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุนสูงบ่งชี้ถึงการซื้อขายหลักทรัพย์บ่อยครั้งของผู้จัดการกองทุนและทำให้มีต้นทุนการซื้อขายหลักทรัพย์ที่สูง จึงต้องพิจารณาเปรียบเทียบกับผลการดำเนินงานของกองทุนรวมเพื่อประเมินความคุ้มค่าของการซื้อขายหลักทรัพย์ดังกล่าว

Sharpe Ratio อัตราส่วนระหว่างผลตอบแทนส่วนเพิ่มของกองทุนรวมเปรียบเทียบกับความเสี่ยงจากการลงทุน โดยคำนวณจากผลต่างระหว่างอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมกับอัตราผลตอบแทนที่ปราศจากความเสี่ยง (risk-free rate) เปรียบเทียบกับค่าเบี่ยงเบนมาตรฐาน (standard deviation) ของกองทุนรวม ค่า Sharpe Ratio สะท้อนถึงอัตราผลตอบแทนที่กองทุนรวมควรได้รับเพิ่มขึ้นเพื่อชดเชยกับความเสี่ยงที่กองทุนรวมรับมา โดยกองทุนรวมที่มีค่า Sharpe Ratio สูงกว่าจะเป็นกองทุนที่มีประสิทธิภาพในการบริหารจัดการลงทุนที่ดีกว่า เนื่องจากได้รับผลตอบแทนส่วนเพิ่มที่สูงกว่าภายใต้ระดับความเสี่ยงเดียวกัน

Alpha ผลตอบแทนส่วนเกินของกองทุนรวมเมื่อเปรียบเทียบกับดัชนีชี้วัด (benchmark) โดยค่า Alpha ที่สูง หมายถึง กองทุนสามารถสร้างผลตอบแทนได้สูงกว่าดัชนีชี้วัด ซึ่งเป็นผลจากประสิทธิภาพของผู้จัดการกองทุนในการคัดเลือกหรือหาจังหวะเข้าลงทุนในหลักทรัพย์ได้อย่างเหมาะสม

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

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

© สงวนลิขสิทธิ์ 2024 บริษัท มอร์นิ่งสตาร์ รีเสิร์ช (ประเทศไทย) จำกัด ข้อมูลนี้ (1) เป็นกรรมสิทธิ์ของบริษัท มอร์นิ่งสตาร์ รีเสิร์ช (ประเทศไทย) จำกัด และ/หรือ ผู้ให้บริการข้อมูล (2) ขอสงวนสิทธิ์ในการลอกเลียน หรือเผยแพร่ (3) ขอสงวนสิทธิ์ที่จะไม่รับผิดชอบต่อความถูกต้อง ครบถ้วน และความเสียหายต่างๆ ที่เกิดขึ้นทุกกรณีจากการนำข้อมูลไปใช้อ้างอิง ผลการดำเนินงานในอดีตมิได้เป็นสิ่งยืนยันผลการดำเนินงานในอนาคต

หนังสือชี้ชวนส่วนสรุปข้อมูลสำคัญ



คู่มือการลงทุน Thai ESG



บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กสิกรไทย จำกัด

ที่อยู่ : 400/22 อาคารธนาคารกสิกรไทย ชั้น 6 และ 12 ถนนพหลโยธิน

แขวงสามเสนใน เขตพญาไท กรุงเทพฯ 10400

โทรศัพท์ : 0 - 2673 - 3888

website : www.kasikornasset.com

email : ka.customer@kasikornasset.com

ข้อมูลเพิ่มเติมของ กองทุนเปิดเค Target Net Zero หุ้นไทย ชนิดไทยเพื่อความยั่งยืน (K-TNZ-ThaiESG)

นโยบายการลงทุน

กองทุนจะมุ่งสร้างผลตอบแทนก่อนหักค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายให้ใกล้เคียงกับผลตอบแทนของดัชนีผลตอบแทนรวม SET 100 (SET100 TRI) โดยจะลงทุนในหุ้นของบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยที่เป็นองค์ประกอบของดัชนี SET100 TRI และเป็นบริษัทที่มีลักษณะดังนี้

- (1) บริษัทที่มีการเปิดเผยข้อมูลเกี่ยวกับการปล่อยก๊าซเรือนกระจก แผนการจัดการ และตั้งเป้าหมายเพื่อให้บรรลุเป้าหมายในการลดปริมาณการปล่อยก๊าซเรือนกระจกของประเทศไทย รวมทั้งจัดให้มีการทวนสอบการจัดทำคาร์บอนฟุตพริ้นท์โดยผู้ทวนสอบที่สำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ต. ยอมรับ และหรือ
- (2) บริษัทที่ได้รับการคัดเลือกจากตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย หรือองค์กรหรือสถาบันอื่นที่สำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ต. ยอมรับว่ามีความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน (Environment, Social and Governance: ESG) รวมทั้งอาจลงทุนในหุ้นของบริษัทที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์เอ็มเอไอ ที่มีลักษณะตามข้อ (1) และหรือข้อ (2) โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน

ทั้งนี้ กองทุนอาจมีการลงทุนในหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินอื่นใดที่นอกเหนือจากหุ้นของบริษัทดังกล่าวข้างต้นได้ โดยจะต้องไม่ทำให้กองทุนมี net exposure ในหุ้นของบริษัทดังกล่าวข้างต้น โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีน้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน

อย่างไรก็ตาม เนื่องจากกองทุนมีวัตถุประสงค์เพื่อส่งเสริมความยั่งยืนด้านสิ่งแวดล้อมที่เน้นด้านสภาพภูมิอากาศ และมีเป้าหมายให้พอร์ตการลงทุนมีปริมาณการปล่อยก๊าซเรือนกระจกโดยเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักนรวม และอุณหภูมิของพอร์ตการลงทุนรวม (Portfolio Temperature Alignment) ต่ำกว่าดัชนีชี้วัด (ดัชนี SET100 TRI) ซึ่งส่งผลต่อหลักเกณฑ์ในการคัดเลือกหลักทรัพย์ จึงอาจจะทำให้มีการลงทุนไม่ครบทุกหลักทรัพย์ที่เป็นองค์ประกอบของดัชนี SET100 TRI ได้

บริษัทจัดการมีการแต่งตั้งให้ Lombard Odier Asset Management (Switzerland) SA (“Lombard Odier”) เป็นที่ปรึกษาการลงทุน เพื่อให้ข้อมูลและคำแนะนำที่เกี่ยวข้องกับการลงทุนเพื่อความยั่งยืน รวมถึงกองทุนจะนำโมเดลพอร์ตการลงทุน (Model Portfolio) ที่ได้จากวิธีการ Implied Temperature Rise (ITR) ที่คิดค้นและพัฒนาโดย Lombard Odier มาใช้ในกระบวนการวิเคราะห์และบริหารจัดการพอร์ตการลงทุน โดยที่ปรึกษาการลงทุนจะไม่มีอำนาจในการตัดสินใจลงทุนแทนบริษัทจัดการแต่อย่างใด ทั้งนี้ บริษัทจัดการขอสงวนสิทธิในการแต่งตั้ง เปลี่ยนแปลง หรือยกเลิกที่ปรึกษาการลงทุนได้ โดยบริษัทจัดการจะแจ้งให้ทราบผ่านทางเว็บไซต์ของบริษัทจัดการ

สำหรับการลงทุนส่วนที่เหลือ กองทุนอาจพิจารณาลงทุนในหุ้นนอกเหนือจากที่กล่าวข้างต้น ตราสารกึ่งนี้ กึ่งหุ้น ตราสารหนี้ เงินฝากหรือตราสารเทียบเท่าเงินฝาก หน่วย CIS หน่วย infra หน่วย property หรือหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินอื่นที่ประกาศกำหนดให้ลงทุนได้

วัตถุประสงค์การลงทุนที่เกี่ยวกับความยั่งยืน:

กองทุนมีวัตถุประสงค์ในการช่วยส่งเสริมการลดผลกระทบจากการเปลี่ยนแปลงของสภาพภูมิอากาศผ่านการลงทุนในหุ้นของบริษัทที่เป็นองค์ประกอบของดัชนี SET100 TRI และมีการบริหารจัดการพอร์ตการลงทุนเพื่อให้ปริมาณการปล่อยก๊าซเรือนกระจกโดยเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักรวม และอุณหภูมิของพอร์ตการลงทุนรวม (Portfolio Temperature Alignment) ต่ำกว่าดัชนีชี้วัด (ดัชนี SET100 TRI) และสนับสนุนให้ภาคธุรกิจมีส่วนในการขับเคลื่อนประเทศไทยให้สามารถบรรลุเป้าหมายตามข้อตกลงปารีส (Paris Agreement) ที่มุ่งลดการปล่อยก๊าซเรือนกระจกเป็นศูนย์ (Net Zero) ภายในปี พ.ศ. 2608 (ค.ศ. 2065)

เป้าหมายด้านความยั่งยืนที่ต้องการบรรลุ:

เพื่อสนับสนุนให้ภาคธุรกิจให้ความสำคัญกับการลดการปล่อยก๊าซเรือนกระจกมากขึ้นและมีส่วนในการขับเคลื่อนประเทศไทยให้สามารถบรรลุเป้าหมายการลดการปล่อยก๊าซเรือนกระจกเป็นศูนย์ (Net Zero) ภายในปี พ.ศ. 2608 (ค.ศ. 2065) อันจะเป็นส่วนสำคัญในการแก้ปัญหาการเพิ่มขึ้นของอุณหภูมิโลกและลดผลกระทบจากการเปลี่ยนแปลงสภาพภูมิอากาศ (Climate Change) ซึ่งสอดคล้องกับแนวทางการลงทุนแบบยั่งยืน (Sustainable Investment) และเป้าหมายการพัฒนาที่ยั่งยืน (SDGs) ขององค์การสหประชาชาติ

กรอบการลงทุน:

1. กองทุนจะลงทุนในหุ้นของบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยที่เป็นองค์ประกอบของดัชนี SET100 TRI และเป็นบริษัทที่มีลักษณะดังนี้

(1) บริษัทที่มีการเปิดเผยข้อมูลเกี่ยวกับการปล่อยก๊าซเรือนกระจก แผนการจัดการ และตั้งเป้าหมายเพื่อให้บรรลุเป้าหมายในการลดปริมาณการปล่อยก๊าซเรือนกระจกของประเทศไทย รวมทั้งจัดให้มีการทวนสอบการจัดทำคาร์บอนฟุตพริ้นท์โดยผู้ทวนสอบที่สำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ต. ยอมรับ และหรือ

(2) บริษัทที่ได้รับการคัดเลือกจากตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย หรือองค์กรหรือสถาบันอื่นที่สำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ต. ยอมรับว่ามีความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน (Environment, Social and Governance: ESG) รวมทั้งอาจลงทุนในหุ้นของบริษัทที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์เอ็มเอไอ ที่มีลักษณะตามข้อ (1) และหรือข้อ (2) โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน

2. ภายใต้กรอบการลงทุนตามข้อ 1. ทีมผู้จัดการกองทุนจะทำการวิเคราะห์หลักทรัพย์และสร้างพอร์ตการลงทุนเพื่อให้ปริมาณการปล่อยก๊าซเรือนกระจกโดยเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักรวม และอุณหภูมิของพอร์ตการลงทุนรวม (Portfolio Temperature Alignment) ต่ำกว่าดัชนี SET100 TRI

ความเสี่ยงที่เกี่ยวข้องกับการลงทุนอย่างยั่งยืน:

- ความเสี่ยงจากการพึ่งพาข้อมูลด้าน ESG จากแหล่งข้อมูลภายนอก เพื่อใช้ในการวิเคราะห์และคัดเลือกหลักทรัพย์อาจมีข้อมูลที่ไม่สมบูรณ์ หรือไม่ถูกต้อง ทั้งนี้ บริษัทจัดการจะค้นหาข้อมูลเพิ่มเติมจากแหล่งข้อมูลต่างๆ รวมถึง รายงานประจำปี และรายงานความยั่งยืนของบริษัท เพื่อให้ข้อมูลที่นำมาใช้ในการวิเคราะห์ที่มีความถูกต้องมากขึ้น
- ความเสี่ยงจากการลงทุนในหลักทรัพย์ที่อาจไม่เป็นไปตามกรอบการลงทุนด้านความยั่งยืนที่กองทุนกำหนด ตัวอย่างเช่น การลงทุนในตราสารทางการเงินประเภทต่างๆ ที่ผู้ออกหลักทรัพย์ไม่มีอำนาจควบคุม หรือกรณีคู่ค้าของผู้ออกหลักทรัพย์ (ผู้ขายสินค้า ผู้รับจ้าง และหรือผู้ให้บริการ) อาจมีการปฏิบัติไม่เป็นไปตามกรอบการลงทุนด้านความยั่งยืนที่นอกเหนือไปจากการรับรู้ของบริษัทจัดการ

- ความเสี่ยงด้านสภาพคล่อง อาจเกิดจากการที่กองทุนไม่สามารถซื้อหรือขายหลักทรัพย์บางตัวได้ในราคาหรือช่วงเวลาที่เหมาะสม ด้วยเงื่อนไขด้านความยั่งยืนที่กองทุนกำหนด
- ความเสี่ยงด้าน ESG ซึ่งมีผลต่อความสามารถในการสร้างผลกำไร การแข่งขัน ภาพลักษณ์ ชื่อเสียง และความอยู่รอดขององค์กร ตัวอย่างของความเสี่ยงแต่ละด้าน ดังนี้
 - ความเสี่ยงด้านสิ่งแวดล้อม เช่น ผลกระทบจากการเปลี่ยนแปลงสภาพภูมิอากาศ (Climate Change) ที่มีผลต่อการดำเนินธุรกิจ ผลกระทบจากการขาดแคลนน้ำ (Water Scarcity) ที่มีต่อกระบวนการผลิตหรือบริการ การเก็บภาษีภาคอุตสาหกรรม หรือ ธุรกิจที่ปล่อยก๊าซคาร์บอนไดออกไซด์ (Carbon Tax) ทำให้มีค่าใช้จ่ายเพิ่มขึ้น มลพิษทางอากาศจากการก่อสร้างหรือจากโรงงานต่างๆที่อาจส่งผลกระทบต่อชุมชนโดยรอบ เป็นต้น
 - ความเสี่ยงด้านสังคม เช่น การเปลี่ยนแปลงโครงสร้างประชากร การเปลี่ยนแปลงของพฤติกรรมการใช้ชีวิตของคนในสังคม เป็นต้น
 - ความเสี่ยงด้านบรรษัทภิบาล เช่น กรณีที่องค์กรไม่เปิดเผยข้อมูลที่มีนัยสำคัญ ซึ่งอาจส่งผลกระทบต่อผู้มีส่วนได้เสีย ความเสี่ยงจากการเข้าไปลงทุนในบริษัทที่มีปัญหาด้านคอร์รัปชัน ความบกพร่องในมาตรการกำกับดูแลภายในองค์กร การใช้ข้อมูลภายในที่ไม่เหมาะสม เป็นต้น

ความเสี่ยงจากการลงทุนแบบกระจุกตัว เนื่องจากกองทุนจะเน้นลงทุนในหุ้นของบริษัทที่เป็นองค์ประกอบของดัชนี SET100 TRI และ บริษัทดังกล่าวมีลักษณะตามกรอบการลงทุน ทำให้พอร์ตการลงทุนอาจมีการกระจุกตัวในบางอุตสาหกรรมหรือบางบริษัท ส่งผลให้ผลการดำเนินงานของกองทุนอาจมีความผันผวนในระยะสั้น

การอ้างอิงดัชนีชีวิตที่สอดคล้องกับความยั่งยืน:

ดัชนีชีวิตของกองทุน คือ ดัชนีผลตอบแทนรวม SET100 (SET100 TRI) ในสัดส่วนร้อยละ 100 โดยบริษัทจัดการเลือกดัชนีดังกล่าวเป็นดัชนีชีวิต เนื่องจากกองทุนมีวัตถุประสงค์ในการช่วยลดผลกระทบจากการเปลี่ยนแปลงของสภาพภูมิอากาศผ่านการลงทุนในหลักทรัพย์ที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เพื่อสนับสนุนให้ภาคธุรกิจให้ความสำคัญกับการลดการปล่อยก๊าซเรือนกระจกมากขึ้น โดยกระบวนการจัดพอร์ตการลงทุนมีเป้าหมายให้ปริมาณการปล่อยก๊าซเรือนกระจกโดยเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักรวม และอุณหภูมิของพอร์ตการลงทุนรวม (Portfolio Temperature Alignment) ต่ำกว่าดัชนีชีวิต ดัชนีชีวิตจึงควรประกอบด้วยหลักทรัพย์ที่เป็นผู้นำและตัวแทนของภาคธุรกิจที่หลากหลายอุตสาหกรรม เพื่อช่วยขับเคลื่อนประเทศไทยให้สามารถบรรลุเป้าหมายตามข้อตกลงปารีส (Paris Agreement) ที่มุ่งลดการปล่อยก๊าซเรือนกระจกเป็นศูนย์ (Net Zero) ภายในปี พ.ศ. 2608 (ค.ศ. 2065) ดัชนี SET100 TRI จึงเป็นดัชนีที่เหมาะสมภายใต้กรอบการลงทุน สอดคล้องกับวัตถุประสงค์และเป้าหมายด้านความยั่งยืนของกองทุน อีกทั้งบริษัทที่เป็นองค์ประกอบของดัชนี SET100 TRI เป็นบริษัทที่มีสภาพคล่องตามหลักเกณฑ์ที่ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยกำหนด และมีการเปิดเผยข้อมูลเพื่อนำไปใช้ในการวิเคราะห์ได้อย่างเพียงพอ

รายละเอียดดัชนี SET100 TRI:

ดัชนี SET100 TRI เป็นดัชนีราคาหุ้นที่ใช้แสดงระดับและความเคลื่อนไหวของราคาหุ้นสามัญ 100 ตัวที่มีมูลค่าตามราคาตลาด (Market Capitalization) สูง การซื้อขายมีสภาพคล่องสูงอย่างสม่ำเสมอ และมีสัดส่วนผู้ถือหุ้นรายย่อยผ่านเกณฑ์ที่ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยกำหนด

หัวข้อ	รายละเอียด
ประเภทดัชนี	Composite Index
เกณฑ์การคำนวณ	- คำนวณแบบถ่วงน้ำหนักด้วยมูลค่าหลักทรัพย์ตามราคาตลาด (Market Capitalization Weight) - ไม่นำหลักทรัพย์ที่ถูกขึ้นเครื่องหมาย SP เกิน 20 วันมารวมในการคำนวณ - คำนวณโดยใช้หุ้นสามัญจดทะเบียนที่ผ่านการคัดเลือก 100 อันดับแรก
การปรับฐานการคำนวณ	- เมื่อมีการเปลี่ยนแปลงมูลค่าของหลักทรัพย์ที่ใช้ในการคำนวณ เนื่องจากการเปลี่ยนแปลงจำนวนหุ้นของหลักทรัพย์ที่เป็นผลมาจากเหตุการณ์ต่างๆ - เมื่อมีการใช้หลักทรัพย์รายการใหม่ๆ ครึ่งจะต้องมีการปรับฐานคำนวณเพื่อให้ค่าดัชนีมีความต่อเนื่องอยู่เสมอ โดยการปรับฐานดัชนีจะดำเนินการในทำนองเดียวกันกับกรณีที่มีหลักทรัพย์ถูกเพิกถอนและมีหลักทรัพย์เข้าใหม่ตามแต่กรณี
ค่าดัชนีเริ่มต้น	1,000 จุด
วันที่เริ่มเผยแพร่ดัชนี SET100 TRI	3 พฤษภาคม 2548
วันฐานของดัชนี SET100 TRI	29 เมษายน 2548
การพิจารณาปรับรายการหลักทรัพย์	- รอบทบทวนเดือนมิถุนายน สำหรับข้อมูลที่ใช้ในการคำนวณช่วงระหว่างเดือนกรกฎาคม – ธันวาคมปีเดียวกัน - รอบทบทวนเดือนธันวาคม สำหรับข้อมูลที่ใช้ในการคำนวณช่วงระหว่างเดือนมกราคม – มิถุนายนปีถัดไป
ช่องทางการเข้าถึงข้อมูลดัชนี และตรวจสอบองค์ประกอบของดัชนี	https://www.set.or.th/th/market/index/set100/overview

เงื่อนไขการลงทุนใน K-TNZ-ThaiESG:

การลงทุนในหน่วยลงทุนชนิดไทยเพื่อความยั่งยืนให้ได้รับสิทธิประโยชน์ด้านภาษี ผู้ถือหน่วยลงทุนมีหน้าที่ต้องปฏิบัติตามหลักเกณฑ์วิธีการ และเงื่อนไขที่กำหนดในกฎหมายภาษีอากร หากไม่ปฏิบัติตาม ผู้ถือหน่วยลงทุนจะต้องคืนสิทธิประโยชน์ทางภาษีตามหลักเกณฑ์ที่กำหนด