



กองทุนเปิด ทิสโก้ หุ้น 70 ไทยเพื่อความยั่งยืนแบบพิเศษ TISCO Equity 70 Thailand ESG Extra Fund

ชนิดเงินลงทุนพิเศษ
TThai70ESGX-S

ประเภทกองทุนรวม/กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมผสม
- กองทุนรวมเพื่อความยั่งยืน, กองทุนรวมไทยเพื่อความยั่งยืนแบบพิเศษ
- กลุ่ม Aggressive Allocation

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- ลงทุนใน (1) หุ้นที่มีความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อมหรือด้านความยั่งยืน และ/หรือหุ้นที่มีการเปิดเผยข้อมูลแผนการจัดการ และการตั้งเป้าหมายเพื่อให้บรรลุเป้าหมายในการลดปริมาณการปล่อยก๊าซเรือนกระจก และ/หรือหุ้นที่มีธรรมาภิบาล (2) พันธบัตรรัฐบาล และ/หรือตราสารหนี้ภาคเอกชน เพื่ออนุรักษ์สิ่งแวดล้อม เพื่อความยั่งยืน หรือเพื่อส่งเสริมความยั่งยืน โดยมี Net Exposure เฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV (รายละเอียดนโยบายด้านความยั่งยืนเพิ่มเติมในหน้า 3)
- ลงทุนในหุ้น ตามข้อ (1) โดยมี Net Exposure เฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่า 65% และไม่เกิน 70% ของ NAV
- กองทุนอาจลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า เพื่อเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน
- มุ่งหวังให้ผลประกอบการสูงกว่าดัชนีชี้วัด (Active Management)

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (% ต่อปี)

ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด (%), (% ต่อปี*)

	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี*
กองทุน	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.
ดัชนีชี้วัด	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.
ความผันผวนกองทุน	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.
	3 ปี*	5 ปี*	10 ปี*	ตั้งแต่จัดตั้ง*
กองทุน	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.
ดัชนีชี้วัด	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.
ความผันผวนกองทุน	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.

ระดับความเสี่ยง

ต่ำ	1	2	3	4	5	6	7	8	สูง
-----	---	---	---	---	---	---	---	---	-----

เสี่ยงปานกลาง ค่อนข้างสูง

ลงทุนในตราสารทุน ตราสารหนี้ โดยมีสัดส่วนการลงทุนในตราสารทุนน้อยกว่า 80% ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน	9 พ.ค. 68
วันเริ่มต้น class	9 พ.ค. 68
นโยบายการจ่ายเงินปันผล	ไม่จ่าย
อายุกองทุน	ไม่กำหนด

ผู้จัดการกองทุนรวม

นายนิพนธ์ ไกรลาศโฬาร (ตั้งแต่ 9 พ.ค. 68)
นายรณธร จารุกุลวนิช (ตั้งแต่ 9 พ.ค. 68)

ดัชนีชี้วัด

ดัชนีชี้วัดมีวัตถุประสงค์เพื่อใช้ในการเปรียบเทียบกับผลการดำเนินงานของกองทุน (Performance Objective) ได้แก่

- 1) ดัชนีผลตอบแทนรวม SETESG สัดส่วน 70%
- 2) ผลตอบแทนรวมสุทธิของดัชนีพันธบัตรรัฐบาล ESG ของสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย สัดส่วน 10%
- 3) ผลตอบแทนรวมสุทธิของดัชนีพันธบัตรรัฐบาล Mark-to-Market ที่มีอายุคงเหลือตั้งแต่ 1 ถึง 3 ปี ของสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย สัดส่วน 10%
- 4) ผลตอบแทนรวมสุทธิของดัชนีพันธบัตรรัฐบาล Mark-to-Market ที่มีอายุไม่เกิน 1 ปี ของสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย สัดส่วน 10%

คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวม มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต : ได้รับการรับรอง CAC

“ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือ
บริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่อง
ได้ที่หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม”

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



www.tiscoasset.com

ประกาศความเป็นส่วนตัว
(Privacy Notice)



การซื้อขายหน่วยลงทุน

วันทำการซื้อ : ทุกวันทำการ

เวลาทำการ : 8.30 น. - 15.00 น.

การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ : 1,000 บาท

การซื้อครั้งถัดไปขั้นต่ำ : 1,000 บาท

การขายคืนหน่วยลงทุน

วันทำการขายคืน : ทกวันทำการ (ผ่านบลจ. เท่านั้น)

เวลาทำการ : 8.30 น. - 15.00 น.

การขายคืนขั้นต่ำ : ไม่กำหนด

ยอดคงเหลือขั้นต่ำ : ไม่กำหนด

ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน : T+3

(ไม่เกิน T+5, T คือ วันรับซื้อคืน)

หมายเหตุ : บริษัทจัดการของสงวนสิทธิในการเปลี่ยนแปลงมูลค่าขั้นต่ำของการซื้อครั้งถัดไป ซึ่งจะคำนึงถึงประโยชน์ของผู้ถือหุ้นวงลงทุนเป็นสำคัญ โดยบริษัทจัดการจะประกาศการเปลี่ยนแปลงและแจ้งให้ผู้ถือหุ้นวงลงทุนทราบล่วงหน้าอย่างชัดเจนผ่านเว็บไซต์ของบริษัทจัดการ ภายในระยะเวลาที่ผู้ถือหุ้นวงลงทุนสามารถใช้ประโยชน์จากข้อมูลในการตัดสินใจลงทุนได้

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	3.0000	1.2840
รวมค่าใช้จ่าย	5.0000	1.5339

หมายเหตุ : บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ และรวมค่าใช้จ่ายเป็นข้อมูลของรอบปีบัญชีล่าสุดหรือประมาณการเบื้องต้น (กรณียังไม่ครบรอบปีบัญชี)

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหุ้นหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การขาย	2.50	ปัจจุบันไม่เรียกเก็บ
การรับซื้อคืน	2.50	ปัจจุบันไม่เรียกเก็บ
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า	2.50	ปัจจุบันไม่เรียกเก็บ
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก	2.50	ขั้นต่ำ 200 บาท
การโอนหน่วย	ไม่มี	ไม่มี

หมายเหตุ : บริษัทจัดการอาจเรียกเก็บค่าธรรมเนียมการขายและค่าธรรมเนียมการรับประกันซื้อคืนกับผู้ลงทุนแต่ละกลุ่มไม่เท่ากัน ทั้งนี้ผู้ลงทุนสามารถรายละเอียดเพิ่มเติมได้ที่หนังสือชี้ชวนส่วนข้อมูลกองทุนรวม

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน

ประเภททรัพย์สิน	% NAV

ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก

ชื่อทรัพย์สิน	% NAV

ข้อมูลเชิงสถิติ

- Maximum Drawdown
- Recovering Period
- อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน
- Sharpe Ratio
- Alpha
- Beta

นโยบายการลงทุนเพิ่มเติม

1. วัตถุประสงค์การลงทุนที่เกี่ยวข้องกับความยั่งยืน

กองทุนมีนโยบายกระจายการลงทุนในทรัพย์สินที่ออกโดยผู้ออกซึ่งเป็นภาครัฐไทยหรือกิจการที่จัดตั้งขึ้นตามกฎหมายไทย ดังต่อไปนี้ โดยมีฐานะการลงทุนสุทธิ (Net Exposure) ในทรัพย์สินที่ลงทุนดังกล่าว โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่า 80% ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิกองทุน

1. หุ้นที่เป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET) และ/หรือตลาดหลักทรัพย์เอ็มเอไอ (mai) ที่มีลักษณะดังนี้

(1) หุ้นของบริษัทจดทะเบียนที่ได้รับการคัดเลือกจากตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย ว่ามีความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อม (Environment: E) หรือด้านความยั่งยืน ได้แก่ สิ่งแวดล้อม สังคม และธรรมาภิบาล (Environmental, Social and Governance: ESG) และ/หรือ

(2) หุ้นของบริษัทจดทะเบียนที่มีการเปิดเผยข้อมูลเกี่ยวกับการปล่อยก๊าซเรือนกระจก แผนการจัดการ และการตั้งเป้าหมายเพื่อให้บรรลุเป้าหมายในการลดปริมาณการปล่อยก๊าซเรือนกระจกของประเทศไทย รวมทั้งจัดให้มีการทวนสอบการจัดทำคาร์บอนฟุตพริ้นท์โดยผู้ทวนสอบที่สำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ต. ยอมรับ และ/หรือ

(3) หุ้นของบริษัทจดทะเบียนที่มีธรรมาภิบาล (Governance) ที่มีลักษณะดังนี้

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

(3.2) มีการเปิดเผยเป้าหมายและแผนในเรื่องดังนี้ และรายงานความคืบหน้าการปฏิบัติตามเป้าหมายหรือแผนผ่านช่องทางของ SET ซึ่งจัดไว้สำหรับการเปิดเผยข้อมูลดังกล่าวโดยเฉพาะ

(3.2.1) การมีเป้าหมายและแผนธุรกิจที่เกี่ยวข้องกับการเพิ่มมูลค่าของกิจการ (Corporate Value Up Plan)

(3.2.2) การมีเป้าหมายและแผนการยกระดับการดำเนินงานในเรื่องใดเรื่องหนึ่ง ดังนี้ โดยต้องตั้งเป้าหมาย

เพื่อดำเนินการให้เป็นไปตามแผนการยกระดับดังกล่าวให้แล้วเสร็จภายใน 2 ปีนับแต่วันที่เปิดเผยเป้าหมายและแผนการยกระดับ

(3.2.2.1) แผนดำเนินการที่ชัดเจนเพื่อเข้ารับการประเมินจากผู้ประเมินผลการดำเนินงานด้านความยั่งยืนตามมาตรฐานสากลตามที่ประกาศการลงทุนของกองทุนกำหนด

(3.2.2.2) เป้าหมายและแผนดำเนินการเพื่อลดปริมาณการปล่อยก๊าซเรือนกระจกของประเทศไทยตามข้อ (2)

(3.3) มีการเพิ่มประสิทธิภาพการสื่อสารกับผู้ลงทุน ตามที่ SET กำหนด

2. ลงทุนในตราสารอย่างใดอย่างหนึ่ง หรือหลายอย่าง ดังนี้

(1) ตราสารเพื่ออนุรักษ์สิ่งแวดล้อม (Green Bond) ตราสารเพื่อความยั่งยืน (Sustainability Bond) หรือตราสารส่งเสริมความยั่งยืน (Sustainability - linked Bond) ที่ออกตามประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุนว่าด้วยการขออนุญาตและการอนุญาตให้เสนอขายตราสารหนี้ที่ออกใหม่ต่อประชาชนเป็นการทั่วไป ประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุนว่าด้วยการขออนุญาตและการอนุญาตให้เสนอขายตราสารหนี้ที่ออกใหม่ต่อบุคคลในวงจำกัด และการเสนอขายหุ้นกู้แปลงสภาพต่อบุคคลที่มีลักษณะเฉพาะ หรือประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุนว่าด้วยการกำหนดข้อกำหนดเกี่ยวกับการออกและเสนอขายศุภก และการเปิดเผยข้อมูล แล้วแต่กรณี ซึ่งมีการเปิดเผยข้อมูลในแบบแสดงรายการข้อมูลการเสนอขายตราสารหรือเอกสารที่นำเสนอต่อผู้ลงทุนในการเสนอขายตราสารดังกล่าวในเรื่องดังนี้

(1.1) กรณีเป็นตราสารเพื่ออนุรักษ์สิ่งแวดล้อมหรือตราสารเพื่อความยั่งยืน ต้องมีการเปิดเผยวัตถุประสงค์การใช้เงินที่ได้จากการระดมทุน (Use of Proceeds) ว่าเป็นไปเพื่อโครงการที่เกี่ยวข้องกับการอนุรักษ์สิ่งแวดล้อมหรือเพื่อโครงการที่เกี่ยวข้องกับความยั่งยืนของประเทศไทย แล้วแต่กรณี

(1.2) กรณีเป็นตราสารส่งเสริมความยั่งยืนต้องมีการเปิดเผยข้อมูลเกี่ยวกับการกำหนดตัวชี้วัดและเป้าหมายด้านความยั่งยืนเพื่อส่งเสริมความยั่งยืนของผู้ออกตราสารดังกล่าวในประเทศไทย

(2) พันธบัตรรัฐบาล พันธบัตรที่กระทรวงการคลังค้ำประกันต้นเงินและดอกเบี้ย หรือหุ้นกู้ที่กระทรวงการคลังค้ำประกันต้นเงินและดอกเบี้ยแต่ไม่รวมถึงหุ้นกู้แปลงสภาพ ซึ่งเป็นพันธบัตรหรือหุ้นกู้เพื่ออนุรักษ์สิ่งแวดล้อม (Green Bond) พันธบัตรหรือหุ้นกู้เพื่อความยั่งยืน (Sustainability Bond) หรือพันธบัตรหรือหุ้นกู้ส่งเสริมความยั่งยืน (Sustainability - linked Bond)

ทั้งนี้ กองทุนจะลงทุนในหุ้นที่เป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET) และ/หรือตลาดหลักทรัพย์เอ็มเอไอ (mai) ตามข้อ 1. โดยมีฐานะการลงทุนสุทธิ (Net Exposure) เฉลี่ยในรอบปีบัญชี ซึ่งไม่น้อยกว่า 65% และไม่เกิน 70% ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิกองทุน

2. เป้าหมายที่กองทุนต้องการบรรลุ

กองทุนจะเน้นลงทุนในบริษัทจดทะเบียนฯ ที่มีความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน (Environment, Social and Governance: ESG) และ/หรือหุ้นที่มีการเปิดเผยข้อมูล แผนการจัดการ และการตั้งเป้าหมายเพื่อให้บรรลุเป้าหมายในการลดปริมาณการปล่อยก๊าซเรือนกระจก และ/หรือหุ้นที่มีธรรมาภิบาล และ/หรือตราสารหนี้ภาครัฐ และ/หรือตราสารหนี้ภาคเอกชนที่มีวัตถุประสงค์การใช้เงินที่ได้จากการระดมทุน (Use of Proceeds) ในโครงการที่เกี่ยวข้องกับการอนุรักษ์สิ่งแวดล้อมหรือเพื่อโครงการที่เกี่ยวข้องกับความยั่งยืนของประเทศไทยหรือเพื่อส่งเสริมความยั่งยืนของผู้ออกในประเทศไทย เพื่อสร้างผลตอบแทนที่ยั่งยืนให้กับผู้ถือหน่วยลงทุน รวมทั้งเป็นแรงขับเคลื่อนให้กิจการหรือโครงการที่มุ่งเน้นการดำเนินงานที่คำนึงถึงปัจจัยด้าน ESG มากขึ้น ส่งผลให้เกิดระบบนิเวศที่ยั่งยืนต่อระบบเศรษฐกิจไทย และเป็นกลไกหนึ่งที่ช่วยสนับสนุนบริษัทจดทะเบียนฯ และประเทศไทยบรรลุเป้าหมายการพัฒนาที่ยั่งยืน (Sustainable Development Goals : SDGs) ขององค์การสหประชาชาติ ทั้งนี้ เป้าหมายการพัฒนาที่ยั่งยืน (SDGs) ขององค์การสหประชาชาติ สามารถศึกษาข้อมูลเพิ่มเติมได้ที่ <https://sdgs.un.org/goals>

นโยบายการลงทุนเพิ่มเติม

3. กรอบการลงทุน (Investment Universe) ในส่วนของหลักทรัพย์หรือตราสารเพื่อความยั่งยืน

กองทุนจะกระจายการลงทุนในทรัพย์สินดังต่อไปนี้

- (1) หุ้นของบริษัทจดทะเบียนใน SET และ/หรือ mai ดังนี้ 1) หุ้นของบริษัทจดทะเบียนที่มีความโดดเด่นในการบริหารจัดการด้าน E หรือ ESG และ/หรือ 2) หุ้นของบริษัทจดทะเบียนที่มีการเปิดเผยข้อมูลเกี่ยวกับการปล่อยก๊าซเรือนกระจก แผนการจัดการ และการตั้งเป้าหมายเพื่อให้บรรลุเป้าหมายในการลดปริมาณการปล่อยก๊าซเรือนกระจกของประเทศไทย รวมทั้งจัดให้มีการทวนสอบการจัดทำคาร์บอนฟุตพริ้นท์โดยผู้ทวนสอบที่สำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ต. ยอมรับ และ/หรือ 3) หุ้นของบริษัทจดทะเบียนที่มีธรรมาภิบาล (Governance) ที่มีลักษณะตามหัวข้อ “วัตถุประสงค์การลงทุนที่เกี่ยวกับความยั่งยืน” 1. (3)
- (2) ตราสารเพื่ออนุรักษ์สิ่งแวดล้อม (Green Bond) ตราสารเพื่อความยั่งยืน (Sustainability Bond) หรือตราสารส่งเสริมความยั่งยืน (Sustainability - linked Bond) ที่ผู้ออกตราสารมีวัตถุประสงค์การใช้เงินที่ได้จากการระดมทุน (Use of Proceeds) ในโครงการที่เกี่ยวข้องกับการอนุรักษ์สิ่งแวดล้อมหรือเพื่อโครงการที่เกี่ยวข้องกับความยั่งยืนของประเทศไทยหรือเพื่อส่งเสริมความยั่งยืนของผู้ออกตราสารในประเทศไทย ทั้งนี้ ตราสารดังกล่าวจะต้องได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือที่ตัวตราสารหรือที่ผู้ออกตราสารในอันดับที่สามารถลงทุนได้ (Investment Grade)
- (3) พันธบัตรรัฐบาล พันธบัตรที่กระทรวงการคลังค้ำประกันต้นเงินและดอกเบี้ย หรือหุ้นกู้ที่กระทรวงการคลังค้ำประกันต้นเงินและดอกเบี้ยแต่ไม่รวมถึงหุ้นกู้แปลงสภาพ ซึ่งเป็นพันธบัตรหรือหุ้นกู้เพื่ออนุรักษ์สิ่งแวดล้อม (Green Bond) พันธบัตรหรือหุ้นกู้เพื่อความยั่งยืน (Sustainability Bond) หรือพันธบัตรหรือหุ้นกู้ส่งเสริมความยั่งยืน (Sustainability - linked Bond)

4. การอ้างอิงดัชนีชี้วัดที่เกี่ยวกับความยั่งยืน (Investment Benchmark)

- (1) ดัชนีผลตอบแทนรวม SETESG (SETESG TRI) สัดส่วน 70%
- (2) ผลตอบแทนรวมสุทธิของดัชนีพันธบัตรรัฐบาล ESG ของสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย สัดส่วน 10%
- (3) ผลตอบแทนรวมสุทธิของดัชนีพันธบัตรรัฐบาล Mark-to-Market ที่มีอายุคงเหลือตั้งแต่ 1 ถึง 3 ปี ของสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย สัดส่วน 10%
- (4) ผลตอบแทนรวมสุทธิของดัชนีพันธบัตรรัฐบาล Mark-to-Market ที่มีอายุไม่เกิน 1 ปี ของสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย สัดส่วน 10%

โดยบริษัทจัดการเลือกดัชนีดังกล่าวเป็นดัชนีชี้วัด เนื่องจาก

- 1) ดัชนีผลตอบแทนรวม SETESG (SETESG TRI) เป็นดัชนีที่สะท้อนการเคลื่อนไหวราคาของกลุ่มหลักทรัพย์ของบริษัทที่มีการดำเนินธุรกิจอย่างยั่งยืน ซึ่งมีขนาดและสภาพคล่องผ่านตามเกณฑ์ที่ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยกำหนด โดยดัชนี SETESG มีแนวทางการคัดเลือกหุ้นเพื่อเป็นองค์ประกอบของดัชนี ดังนี้
 - เป็นบริษัทที่อยู่ในผลประเมินหุ้นยั่งยืน SET ESG Ratings ที่ประกาศล่าสุด ก่อนรอบการทบทวนรายชื่อหลักทรัพย์ในดัชนี
 - เป็นหลักทรัพย์ที่มีมูลค่าหลักทรัพย์ตามราคาตลาด (Market Capitalization) ไม่น้อยกว่า 5,000 ล้านบาท และผ่านสภาพคล่องที่กำหนด
 - ไม่รวมหลักทรัพย์ที่ถูกขึ้นเครื่องหมาย SP
 - 2) ดัชนีพันธบัตรรัฐบาล ESG ของสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย ซึ่งสะท้อนถึงราคาของตราสารหนี้ ESG ที่ออกโดยรัฐบาลเป็นองค์ประกอบ ดังนั้น จึงเป็นดัชนีที่เหมาะสมภายใต้กรอบการลงทุน สอดคล้องกับวัตถุประสงค์และเป้าหมายด้านความยั่งยืนของกองทุน
- นอกจากนี้ กองทุนใช้ดัชนีพันธบัตรรัฐบาล Mark-to-Market ที่มีอายุคงเหลือตั้งแต่ 1 ถึง 3 ปี และดัชนีพันธบัตรรัฐบาล Mark-to-Market ที่มีอายุไม่เกิน 1 ปี ของสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย เป็นดัชนีชี้วัด เพื่อสะท้อนการลงทุนในตราสารหนี้อื่นที่นอกเหนือจากตราสารเพื่อการอนุรักษ์สิ่งแวดล้อมหรือความยั่งยืน โดยดัชนีดังกล่าวเป็นดัชนีที่สะท้อนการเคลื่อนไหวของพันธบัตรรัฐบาลทั้งในด้านราคาและผลตอบแทนที่รวมดอกเบี้ยจ่ายเข้ามาด้วย ทั้งนี้ มูลค่าของพันธบัตรรัฐบาลแต่ละรุ่นจะคำนวณมาจากราคาตลาดหรือราคามูลค่ายุติธรรม ณ สิ้นวัน (End-of-Day Mark-To-Market) ซึ่งสามารถสะท้อนราคาตลาดได้ดียิ่งขึ้น ช่วยให้การเปรียบเทียบผลการดำเนินงานของกองทุนมีความสอดคล้องและเหมาะสมมากขึ้น
- ทั้งนี้ บริษัทจัดการขอสงวนสิทธิ์ที่จะเปลี่ยนแปลงตัวชี้วัดของกองทุนตามข้างต้น ที่จัดทำโดยตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เมื่อตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยมีการจัดทำดัชนีผลตอบแทนรวม (TRI) ที่นำสัดส่วนผู้ถือหลักทรัพย์รายย่อยของแต่ละหลักทรัพย์ (Free Float) มาถ่วงน้ำหนักในการคำนวณดัชนี (ดัชนี Free Float TRI) เพื่อให้เป็นไปตามหลักเกณฑ์ที่คณะกรรมการกำกับตลาดทุนประกาศกำหนด

คำอธิบาย

Maximum Drawdown เพอร์เซ็นต์ผลขาดทุนสูงสุดของกองทุนรวมในระยะเวลา 5 ปีย้อนหลัง (หรือตั้งแต่จัดตั้งกองทุนกรณีที่ยังไม่ครบ 5 ปี) โดยวัดจากระดับ NAV ต่อหน่วยที่จุดสูงสุดไปจนถึงจุดต่ำสุดในช่วงที่ NAV ต่อหน่วยปรับตัวลดลง ค่า Maximum Drawdown เป็นข้อมูลที่ช่วยให้ทราบถึงความเสี่ยงที่อาจจะขาดทุนจากการลงทุนในกองทุนรวม

Recovering Period ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาดังแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลานานเท่าใด

FX Hedging เพอร์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตกองทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลานึง 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 สูงกว่าจะเป็นกองทุนที่มีประสิทธิภาพในการบริหารจัดการลงทุนที่ดีกว่า เนื่องจากได้รับผลตอบแทนส่วนเพิ่มที่สูงกว่าภายใต้ระดับความเสี่ยงเดียวกัน

Alpha ผลตอบแทนส่วนเกินของกองทุนรวมเมื่อเปรียบเทียบกับดัชนีชี้วัด (benchmark) โดยค่า Alpha ที่สูง หมายถึง กองทุนสามารถสร้างผลตอบแทนได้สูงกว่าดัชนีชี้วัด ซึ่งเป็นผลจากประสิทธิภาพของผู้จัดการกองทุนในการคัดเลือกหรือหาจังหวะเข้าลงทุนในหลักทรัพย์ได้อย่างเหมาะสม

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

Tracking Error อัตราผลตอบแทนของกองทุนมีประสิทธิภาพในการเลียนแบบดัชนีชี้วัด โดยหาก tracking error ต่ำ หมายถึงกองทุนรวมมีประสิทธิภาพในการสร้างผลตอบแทนให้ใกล้เคียงกับดัชนีชี้วัด กองทุนรวมที่มีค่า tracking error สูง จะมีอัตราผลตอบแทนโดยเฉลี่ยห่างจากดัชนีชี้วัดมากขึ้น

Yield to Maturity อัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในตราสารหนี้โดยถือจนครบกำหนดอายุ ซึ่งคำนวณจากดอกเบี้ยที่จะได้รับในอนาคตตลอดอายุตราสารและเงินต้นที่จะได้รับคืนนำมาคิดลดเป็นมูลค่าปัจจุบัน โดยใช้วัดอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมตราสารหนี้ คำนวณจากค่าเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักของ Yield to Maturity ของตราสารหนี้แต่ละตัวที่กองทุนมีการลงทุน และเนื่องจาก Yield to Maturity มีหน่วยมาตรฐานเป็นเปอร์เซ็นต์ต่อปี จึงสามารถนำไปใช้เปรียบเทียบกับอัตราผลตอบแทนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีนโยบายถือครองตราสารหนี้จนครบกำหนดอายุและมีลักษณะการลงทุนที่ใกล้เคียงกันได้

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ทีเอสโก้ จำกัด

โทรศัพท์ 02 633 6000 www.tiscoasset.com

48/16-17 อาคารทีเอสโก้ทาวเวอร์ ชั้น 9 ถนนสาทรเหนือ แขวงสีลม เขตบางรัก กรุงเทพฯ 10500