



## กองทุนเปิดกรุงศรีเอ็นแอสซ์เซิร์ทไทยเพื่อความยั่งยืน-ไทยเพื่อความยั่งยืนสะสมมูลค่า

หน่วยลงทุนชนิดไทยเพื่อความยั่งยืนสะสมมูลค่า

KFTHAIESGA

### ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมตราสารทุน / กองทุนรวมเพื่อความยั่งยืน (SRI Fund) / กองทุนรวมไทยเพื่อความยั่งยืน / กองทุนรวมที่มีนโยบายเปิดให้มีการลงทุนในกองทุนรวมอื่นภายใต้ บลจ. เดียวกัน (Cross Investing Fund)
- กองทุนรวมที่ลงทุนแบบมีความเสี่ยงทั้งในและต่างประเทศ
- กลุ่ม Equity General

### นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- ลงทุนในหุ้นที่เป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย และ/หรือตลาดหลักทรัพย์ เอ็ม เอ ไอ ที่ได้รับการคัดเลือกจากตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยหรือองค์กรหรือสถาบันอื่นที่สำนักงาน ก.ล.ต. ยอมรับว่ามีความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน (Environmental, Social and Governance: ESG) และ/หรือมีการเปิดเผยข้อมูลเกี่ยวกับการปล่อยก๊าซเรือนกระจก แผนการจัดการ และการตั้งเป้าหมายเพื่อให้บรรลุเป้าหมายในการลดปริมาณการปล่อยก๊าซเรือนกระจกของประเทศไทย โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน ทั้งนี้สามารถวัดดูประสิทธิภาพการลงทุนและกรอบการลงทุนเกี่ยวกับ ESG ได้ที่ “ข้อมูลอื่น ๆ”
- ส่วนที่เหลืออาจพิจารณาลงทุนในหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินอื่นตามที่สำนักงาน ก.ล.ต. ประกาศกำหนดให้ลงทุนได้ รวมถึงอาจลงทุนในโทเคนดิจิทัลเพื่อการลงทุน (investment token) ที่ออกตามพระราชกำหนดว่าด้วยการประกอบธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัล ที่เป็น green-project token และ/หรือ sustainability-project token และ/หรือ sustainability-linked token ซึ่งมีการเปิดเผยข้อมูลในแบบแสดงรายการข้อมูลการเสนอขายโทเคนดิจิทัลตามที่สำนักงาน ก.ล.ต. กำหนด
- กองทุนอาจลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมภายใต้การจัดการของบริษัทจัดการไม่เกินร้อยละ 20 ของ NAV
- กองทุนอาจเข้าทำสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) เพื่อเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน (Efficient Portfolio Management) ซึ่งรวมถึงการป้องกันความเสี่ยง (Hedging) จากการลงทุน
- กองทุนไทยมุ่งหวังให้ผลประกอบการสูงกว่าดัชนีชี้วัด (Active management)

### ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (%) ต่อปี

- ยังไม่มีข้อมูล -

### ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปีกumul (%) ต่อปี

- ยังไม่มีข้อมูล -

ระดับความเสี่ยง

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

เสี่ยงสูง

ลงทุนในตราสารทุนเป็นหลักโดยเฉลี่ยในรอบปี  
ไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV

### ข้อมูลกองทุนรวม

|                         |                 |
|-------------------------|-----------------|
| วันจดทะเบียนกองทุน:     | 20 ธันวาคม 2566 |
| วันเริ่มต้น class:      | 20 ธันวาคม 2566 |
| นโยบายการจ่ายเงินปันผล: | ไม่จ่าย         |
| อายุกองทุน:             | ไม่กำหนด        |

### ผู้จัดการกองทุนรวม

|                        |                               |
|------------------------|-------------------------------|
| นายกวิฬ เจริญเสาวภาคย์ | ตั้งแต่วันที่ 20 ธันวาคม 2566 |
| นาย ชลิต โชคทิพย์พัฒนา | ตั้งแต่วันที่ 20 ธันวาคม 2566 |

### ดัชนีชี้วัด :

ดัชนีผลตอบแทนรวม SET ESG (SET ESG TRI) สัดส่วน 100.00%

(เป็นดัชนีที่สะท้อนการลงทุนในหลักทรัพย์ของบริษัทที่มีการดำเนินธุรกิจอย่างยั่งยืน  
คำนึงถึงปัจจัยทางด้าน ESG โดยสามารถศึกษาข้อมูลได้ที่

<https://www.set.or.th/th/market/index/setesg/profile>)

บริษัทจัดการใช้ดัชนีชี้วัดดังกล่าวเพื่อเปรียบเทียบผลการดำเนินงานของกองทุน

### คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวมมิได้เป็นที่ยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต: ได้รับการรับรองจาก CAC

“ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือ  
บริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่องได้  
ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม”

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



[www.krungsriasset.com](http://www.krungsriasset.com)

| การซื้อขายหน่วยลงทุน      |                                                                                                                                                                                                                | การขายคืนหน่วยลงทุน |                                                               |
|---------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------|---------------------------------------------------------------|
| วันทำการซื้อ:             | ช่วง IPO: ระหว่างวันที่ 8-18 ธันวาคม 2566 ภายในเวลา 15.30 น. ของวันสุดท้าย ทั้งนี้ จะรับชำระเป็นเช็คจนถึงวันที่ 18 ธันวาคม 2566 เท่านั้น<br>หลัง IPO: เริ่มตั้งแต่วันที่ 21 ธันวาคม 2566 เป็นต้นไป ทุกวันทำการ | วันทำการขายคืน:     | เริ่มตั้งแต่วันที่ 21 ธันวาคม 2566 เป็นต้นไป ทุกวันทำการ      |
| เวลาทำการ:                | 8.30 – 15.30 น.                                                                                                                                                                                                | เวลาทำการ:          | 8.30 – 15.30 น.                                               |
| การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ:   | 500 บาท                                                                                                                                                                                                        | การขายคืนขั้นต่ำ:   | ไม่กำหนด                                                      |
| การซื้อครั้งถัดไปขั้นต่ำ: | 500 บาท                                                                                                                                                                                                        | ยอดคงเหลือขั้นต่ำ:  | ไม่กำหนด                                                      |
|                           |                                                                                                                                                                                                                | ระยะเวลาการรับเงิน: | ภายใน 5 วันทำการนับถัดจากวันทำการขายคืน                       |
|                           |                                                                                                                                                                                                                | ค่าขายคืน:          | โดยทั่วไปจะได้รับเงิน 3 วันทำการนับถัดจากวันทำการขายคืน (T+3) |

ข้อมูลเชิงสถิติ

|                            |   |
|----------------------------|---|
| Maximum Drawdown           | - |
| Recovering Period          | - |
| Fx Hedging                 | - |
| อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน | - |
| Sharp Ratio                | - |
| Alpha                      | - |
| Beta                       | - |
| Tracking Error             | - |

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)

| ค่าธรรมเนียม  | สูงสุดไม่เกิน | เก็บจริง |
|---------------|---------------|----------|
| การจัดการ     | 2.1400        | 0.6955   |
| รวมค่าใช้จ่าย | 4.6545        | 0.8811   |

หมายเหตุ: หากกองทุนลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมภายใต้การจัดการเดียวกัน (กองทุนปลายทาง) บริษัทจัดการจะไม่เรียกเก็บค่าธรรมเนียมการจัดการซ้ำซ้อนกับกองทุนปลายทาง

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)

| ค่าธรรมเนียม                                          | สูงสุดไม่เกิน | เก็บจริง                              |
|-------------------------------------------------------|---------------|---------------------------------------|
| การขาย                                                | 2.00          | ยังไม่เรียกเก็บ                       |
| การรับซื้อคืน                                         | 2.00          | ยังไม่เรียกเก็บ                       |
| การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า                           | 2.00          | ยังไม่เรียกเก็บ                       |
| การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก                            | 2.00          | ยังไม่เรียกเก็บ                       |
| การโอนหน่วย                                           | ไม่มี         | ไม่มี                                 |
| ค่าปรับกรณีขายคืนและสับเปลี่ยนออกก่อนระยะเวลาที่กำหนด | 0.50          | 0.50 (กรณีถือหน่วยลงทุนน้อยกว่า 3 ปี) |

หมายเหตุ:

- ค่าธรรมเนียมหรือค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม และ/หรือผู้สั่งซื้อหรือผู้ถือหน่วยลงทุนข้างต้นเป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่มหรือภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว
- หากกองทุนลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมภายใต้การจัดการเดียวกัน บริษัทจัดการจะไม่เรียกเก็บค่าธรรมเนียมการขาย และ/หรือรับซื้อคืนหน่วยลงทุนซ้ำซ้อน
- บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ
- บริษัทจัดการจะไม่เรียกเก็บค่าปรับเฉพาะกรณีที่เป็นการสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนระหว่างกองทุนรวมไทยเพื่อความยั่งยืนด้วยกัน ทั้งภายใต้การบริหารของบริษัทจัดการและบริษัทจัดการอื่น

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน

- ยังไม่มีข้อมูล -

ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก

- ยังไม่มีข้อมูล -

การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม

- ยังไม่มีข้อมูล -

## ข้อมูลอื่นๆ

- **วัตถุประสงค์การลงทุนที่เกี่ยวกับความยั่งยืน** : กองทุนจะเน้นลงทุนในหุ้นของบริษัทที่จัดตั้งขึ้นตามกฎหมายไทยที่ได้รับการคัดเลือกว่ามีความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน (Environmental, Social and Governance: ESG) จากองค์กรหรือสถาบันที่มีความน่าเชื่อถือ เช่น ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เป็นต้น และ/หรือหุ้นของบริษัทที่ตั้งเป้าหมายในการลดปริมาณการปล่อยก๊าซเรือนกระจกของประเทศไทย โดยหุ้นที่ กองทุนลงทุนข้างต้นต้องจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย และ/หรือตลาดหลักทรัพย์ เอ็ม เอ ไอ
- **กรอบการลงทุน (Investment Universe)** : กองทุนจะเน้นลงทุนในหุ้นของบริษัทที่จัดตั้งขึ้นตามกฎหมายไทยที่ได้รับการคัดเลือกว่ามีความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน (ESG) จากองค์กรหรือสถาบันที่มีความน่าเชื่อถือที่สำนักงาน ก.ล.ต. ยอมรับ เช่น ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย และ/หรือหุ้นของบริษัทที่มีการเปิดเผยข้อมูลเกี่ยวกับการปล่อยก๊าซเรือนกระจก แผนการจัดการ และการตั้งเป้าหมายเพื่อให้บรรลุเป้าหมายในการลดปริมาณการปล่อยก๊าซเรือนกระจกของประเทศไทย รวมทั้งจัดให้มีการทวนสอบการจัดทำคาร์บอนฟุตพริ้นท์โดยผู้ทวนสอบที่สำนักงาน ก.ล.ต. ยอมรับ โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่า 80% ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน ทั้งนี้ สำหรับส่วนที่นอกเหนือจากการลงทุนในสัดส่วนโดยเฉลี่ยรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่า 80% ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุนตามข้างต้น ทีมผู้จัดการกองทุนอาจพิจารณาลงทุนในหลักทรัพย์ที่นอกเหนือจากที่ระบุไว้ตามข้างต้นได้ โดยหลักทรัพย์ดังกล่าวจะต้องมีคุณสมบัติที่สอดคล้องกับแนวทางทวิ เคราะห์หลักทรัพย์ในด้าน ESG ภายในบริษัทจัดการเอง ที่กำหนดแนวทางในการวิเคราะห์ และคัดเลือกหลักทรัพย์ กองทุนอาจกระจายการลงทุนในหลาย ๆ หมวดอุตสาหกรรม (Sector) โดยไม่จำกัดการลงทุนเฉพาะในหมวดใดหมวดหนึ่ง
- บริษัทจัดการจะปฏิบัติตามกฎหมายของกองทุนต่างประเทศที่ลงทุน โดยรายงานการถือครองหน่วยลงทุนตั้งแต่วันที่ 10 ของจำนวนหน่วยลงทุนที่จำหน่ายได้ แล้วทั้งหมดของกองทุนให้กับผู้มีอำนาจหน้าที่ของกองทุนต่างประเทศ และอาจนำเสนอข้อมูลส่วนตัวของผู้ถือหน่วยลงทุนดังกล่าวเช่น สำนักบัตรประจำตัวประชาชน และ/หรือสำเนาหนังสือเดินทาง เป็นต้น และ/หรือขอข้อมูลหรือเอกสารเพิ่มเติมอื่นใดจากผู้ถือหน่วยลงทุนในภายหลังก็ได้ เพื่อให้เป็นไปตามที่กองทุนต่างประเทศร้องขอ หากผู้ถือหน่วยลงทุนรายใดปฏิเสธการให้ข้อมูลหรือเอกสารเพิ่มเติมดังกล่าวหรือมีพฤติกรรมเข้าข่ายและ/หรือมีความผิดตามกฎหมายอันมีผลทำให้บริษัทจัดการไม่สามารถปฏิบัติตามกฎหมายของกองทุนต่างประเทศได้ บริษัทจัดการขอสงวนสิทธิ์ที่จะระงับหรือหยุดให้บริการและดำเนินการคืนเงินลงทุนตามมูลค่าหน่วยลงทุนให้แก่ผู้ถือหน่วยลงทุน โดยถือว่าได้รับความเห็นชอบจากผู้ถือหน่วยลงทุนแล้ว ทั้งนี้ ผู้ถือหน่วยลงทุนจะไม่สามารถนำเรื่องดังกล่าวมาใช้เป็นสิทธิเรียกร้องความเสียหายจากเหตุดังกล่าวจากบริษัทจัดการได้แต่อย่างใด

## คำอธิบาย

**Maximum Drawdown** เปรี่เซ็นต์ผลขาดทุนสูงสุดของกองทุนรวมในระยะเวลา 5 ปีย้อนหลัง (หรือตั้งแต่จัดตั้งกองทุนกรณีที่ยังไม่ครบ 5 ปี) โดยวัดจากระดับ NAV ต่อหน่วยที่จุดสูงสุดไปจนถึงจุดต่ำสุดในช่วงที่ NAV ต่อหน่วยปรับตัวลดลง ค่า Maximum Drawdown เป็นข้อมูลที่จะช่วยให้ทราบถึงความเสี่ยงที่อาจจะขาดทุนจากการลงทุนในกองทุนรวม

**Recovering Period** ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาดังแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลาานเท่าใด

**FX Hedging** เปรี่เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

**อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน** ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตกองทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลาหนึ่ง 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 สูงกว่าจะเป็นกองทุนที่มีประสิทธิภาพในการบริหารจัดการการลงทุนที่ดีกว่า 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

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด

898 อาคารเพลินจิตทาวเวอร์ ชั้น 1-2 โชนอ เอ ชั้น 12 ชั้น 18 โชนบี

ถนนเพลินจิต แขวงลุมพินี เขตปทุมวัน กรุงเทพมหานคร 10330

โทรศัพท์ : 0-2657-5757 โทรสาร 0-2657-5777

Website: www.krungsriasset.com