



กองทุนเปิดเคเคที บาลานซ์ไทยเพื่อความยั่งยืนแบบพิเศษ
KKP BALANCED THAILAND ESG EXTRA FUND

หน่วยลงทุนชนิดเงินลงทุนเดิม (โอนย้ายจาก LTF)
KKP BL THAI ESGX-for LTF

ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

กองทุนรวมผสม กองทุนรวมไทยเพื่อความยั่งยืนแบบพิเศษ กองทุนรวมเพื่อความยั่งยืน (SRI Fund) กองทุนรวมที่มีนโยบายเปิดให้มีการลงทุนในกองทุนรวมอื่นภายใต้ บลจ. เดียวกัน / กองทุนที่ลงทุนแบบมีความเสี่ยงทั้งในและต่างประเทศ
กลุ่มกองทุนรวม : Aggressive Allocation

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- กองทุนเป็นกองทุนรวมผสมที่มีนโยบายการลงทุนในทรัพย์สินกลุ่มความยั่งยืนที่ออกโดยผู้ออกที่เป็นภาครัฐไทยหรือกิจการที่จัดตั้งขึ้นตามกฎหมายไทย ตามที่สำนักงาน ก.ล.ด. กำหนดหรือเห็นชอบให้กองทุนรวมไทยเพื่อความยั่งยืนแบบพิเศษ (Thailand ESG Extra Fund) สามารถลงทุนหรือมี "ไว้ได้" โดยมีการลงทุนและมี net exposure ในทรัพย์สินที่ลงทุนดังกล่าวโดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของ NAV ทั้งนี้ กองทุนจะลงทุนในหุ้น โดยมีการลงทุนและมี net exposure รวมกันโดยเฉลี่ยรอบปีบัญชี ไม่น้อยกว่าร้อยละ 65 ของ NAV โดยเน้นลงทุนในตราสารทุนที่มีนโยบายหรือมีการจ่ายเงินปันผลอย่างสม่ำเสมอ และ/หรือมีแนวโน้มหรือศักยภาพในการจ่ายเงินปันผลในอนาคต รวมถึงจะลงทุนในตราสารหนี้ทั้งตราสารภาครัฐและ/หรือตราสารหนี้ที่ออกโดยธนาคารพาณิชย์และ/หรือตราสารหนี้ที่ออกโดยบริษัทเอกชน
- กองทุนอาจลงทุนหรือมีไว้ซึ่งสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) เพื่อลดความเสี่ยง (Hedging) รวมถึงอาจลงทุนเพื่อเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน (Efficient Portfolio Management) และอาจลงทุนในตราสารสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแปลง (Structured Note) รวมถึงอาจมีการลงทุนใน Leveraged/Inverse ETF เพื่อบริหารพอร์ตการลงทุน
- ในกรณีที่กองทุนพิจารณาการลงทุนในต่างประเทศ สัดส่วนการลงทุนในต่างประเทศจะไม่เกินร้อยละ 20 ของ NAV ของกองทุน โดยกองทุนจะเข้าเป็นคู่สัญญาในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) เพื่อป้องกันความเสี่ยงที่เกี่ยวข้องกับอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราที่อาจเกิดขึ้นได้จากการลงทุนในต่างประเทศ ไม่ต่ำกว่าร้อยละ 90 ของจำนวนเงินลงทุนในต่างประเทศ
- กองทุนอาจลงทุนในกองทุนรวมอื่น หรือกองทุนรวมอสังหาริมทรัพย์ (กอง 1) หรือทรัสต์เพื่อการลงทุนในอสังหาริมทรัพย์ (REITs) หรือกองทุนรวมโครงสร้างพื้นฐาน (infra) ภายใต้ บลจ. เดียวกัน ในสัดส่วนโดยเฉลี่ยรอบปีบัญชีไม่เกินร้อยละ 20 ของ NAV โดยเป็นไปตามหลักเกณฑ์เงื่อนไขที่สำนักงาน ก.ล.ด. กำหนด
- กลยุทธ์การลงทุน: มุ่งหวังให้ผลประโยชน์จากการเคลื่อนไหวสูงกว่าดัชนีชี้วัด (active management)

(กองทุนสามารถลงทุนในทรัพย์สินอื่น ๆ ตามที่ระบุในนโยบายการลงทุนของกองทุน รวมถึงประเภทหลักทรัพย์ในรายละเอียดโครงการและหนังสือชี้ชวนส่วนข้อมูลกองทุน โปรดศึกษารายละเอียดทั้งหมดเพิ่มเติม <https://am.kkpf.com>)

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน ^{1 2 3} (%ต่อปี)



ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปีกลุ่ม ¹ (%)

	Year to Date	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี ⁴
กองทุนรวม	N/A	N/A	N/A	N/A
ตัวชี้วัด	N/A	N/A	N/A	N/A
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	N/A	N/A	N/A	N/A
ความผันผวนของกองทุน	N/A	N/A	N/A	N/A
ความผันผวนของดัชนีชี้วัด	N/A	N/A	N/A	N/A

	3 ปี ⁴	5 ปี ⁴	10 ปี ⁴	ตั้งแต่จัดตั้งกองทุน ⁴
กองทุนรวม	N/A	N/A	N/A	N/A
ตัวชี้วัด	N/A	N/A	N/A	N/A
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	N/A	N/A	N/A	N/A
ความผันผวนของกองทุน	N/A	N/A	N/A	N/A
ความผันผวนของดัชนีชี้วัด	N/A	N/A	N/A	N/A

¹ เอกสารการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวมฉบับนี้ ได้จัดทำขึ้นตามมาตรฐานการวัดและนำเสนอผลการดำเนินงานของกองทุนรวมของสมาคมบริษัทจัดการลงทุน

² หากกองทุนรวมมีผลการดำเนินงานตั้งแต่วันที่จดทะเบียนทรัพย์สินกองทุนรวมหรือวันที่เปิดเสนอขายชนิดหน่วยลงทุนไม่ครบ 1 ปีปฏิทิน จะแสดงผลการดำเนินงานของปีปฏิทินแรกตั้งแต่วันที่กองทุนรวมจดทะเบียนทรัพย์สินกองทุนรวมหรือวันที่เปิดเสนอขายชนิดหน่วยลงทุนจนถึงวันทำการสุดท้ายของปีปฏิทินแรก

³ หากกองทุนรวมมีผลการดำเนินงานในปีที่เลือกกองทุนไม่ครบ 1 ปีปฏิทิน จะแสดงผลการดำเนินงานของปีปฏิทินสุดท้ายตั้งแต่วันที่ทำการสุดท้ายของปีปฏิทินก่อนหน้าจนถึงวันที่เลือกกองทุน

⁴ % ต่อปี

ระดับความเสี่ยง							
ต่ำ	1	2	3	4	5	6	สูง

เสี่ยงปานกลางค่อนข้างสูง

กองทุนรวมผสมที่ลงทุนในตราสารทุนและตราสารหนี้ โดยมีสัดส่วนการลงทุนในตราสารทุนน้อยกว่า 80% ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม

- วันจดทะเบียนกองทุน : ภายใน 3 วันทำการนับแต่วันสิ้นสุด IPO หรือกรณีที่ปิด IPO ก่อนกำหนด
- วันเริ่มต้น class : ภายใน 3 วันทำการนับแต่วันสิ้นสุด IPO หรือกรณีที่ปิด IPO ก่อนกำหนด
- นโยบายการจ่ายเงินปันผล : ไม่จ่าย
- อายุกองทุน : ไม่กำหนด

ผู้จัดการกองทุน

1. นายภูมิพงษ์ ภมรบุตร (ตั้งแต่วันจดทะเบียน)
2. นายอริชัย เจษฎาถาวรวงษ์ (ตั้งแต่วันจดทะเบียน)

ดัชนีชี้วัด

1. SETESG Total Return Index ร้อยละ 70
2. ThaiBMA Government Bond ESG Index Net Total Return ร้อยละ 25
3. ThaiBMA Short-term Government Bond Index Total Return ร้อยละ 5

หมายเหตุ:

ดูรายละเอียดเกี่ยวกับดัชนีชี้วัดเพิ่มเติมได้ที่หัวข้อ "ข้อมูลเพิ่มเติมเกี่ยวกับนโยบายการลงทุนด้านความยั่งยืน"

คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวม มิได้เป็นสัญญาณยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

โปรดศึกษาคำเตือนที่สำคัญอื่นในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม
การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต : ได้รับการรับรอง CAC

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือบริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่องได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

<https://am.kkpf.com>

การซื้อขายหน่วยลงทุน	การขายคืนหน่วยลงทุน	ข้อมูลเชิงสถิติ
วันทำการซื้อขาย: ไม่เปิดให้บริการ	วันทำการขายคืน: ทุกวันทำการ	Maximum Drawdown : N/A
วันทำการสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า	วันทำการสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก:	FX Hedging : N/A
• ระหว่างวันที่ 13 พ.ค. 2568 – 30 มิ.ย. 2568:	- ระหว่างวันที่ 13 พ.ค. 2568 – 30 มิ.ย. 2568: ไม่เปิดให้บริการสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก	Recovering Period : N/A
- ทุกวันทำการสุดท้ายของแต่ละสัปดาห์ ¹	- ตั้งแต่วันที่ 1 ก.ค. 2568 เป็นต้นไป: ทุกวันทำการกองทุน ทั้งนี้ เฉพาะกรณีที่กองทุนรวมปลายทางเป็นกองทุนรวมไทยเพื่อความยั่งยืนแบบพิเศษ และเป็นกองทุนที่รองรับเงินลงทุนเดิมที่โอนย้ายมาจากกองทุนรวมหุ้นระยะยาว (LTF) เท่านั้น	อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน : N/A
ทั้งนี้ เฉพาะกรณีที่สับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้าจากกองทุนรวมหุ้นระยะยาวภายใต้การจัดการของบริษัทจัดการ และชำระค่าสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเป็นหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินอื่นแทนเงิน (In kind) เท่านั้น	เวลาทำการ: เวลา 8.30 – 15.30 น.	
• ตั้งแต่วันที่ 1 ก.ค. 2568 เป็นต้นไป: ทุกวันทำการกองทุน ทั้งนี้ เฉพาะกรณีที่กองทุนรวมต้นทางเป็นกองทุนรวมไทยเพื่อความยั่งยืนแบบพิเศษ และเป็นหน่วยลงทุนประเภทที่รองรับเงินลงทุนเดิมที่โอนย้ายมาจากกองทุนรวมหุ้นระยะยาว (LTF) เท่านั้น	การขายคืนขั้นต่ำ: ไม่กำหนด	
เวลาทำการ: เวลา 8.30 – 15.30 น.	ยอดคงเหลือขั้นต่ำ: ไม่กำหนด	
การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ: ไม่กำหนด	ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน: ภายใน 5 วันทำการ ² (ปัจจุบัน T+2 วันทำการ) ³	
การซื้อครั้งถัดไปขั้นต่ำ: ไม่กำหนด		

* โปรดศึกษารายละเอียดการซื้อขาย/สับเปลี่ยนหน่วยลงทุน ในหนังสือชี้ชวนส่วนข้อมูลกองทุนรวมเพิ่มเติม *

หมายเหตุ:

¹ ในกรณีที่ผู้ถือหน่วยลงทุนไม่ได้ส่งคำสั่งในระหว่างวันและเวลาที่เปิดรับคำสั่ง บริษัทจัดการขอสงวนสิทธิ์ที่จะรับคำสั่งสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนดังกล่าวได้ และดำเนินการสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนให้ในวันทำการสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า (Switching-in Trade Date) ถัดไป

² ภายใน 5 วันทำการนับแต่วันรับซื้อคืนหน่วยลงทุน

³ ปัจจุบัน T+2 เฉพาะบัญชีรับเงินค่าขายคืนหน่วยลงทุนของ KKP Bank, SCB, BBL, KBank, BAY, TTB, KTB, CIMB Thai, LH Bank, UOB, Citibank และนำฝาก/นำส่งเช็ค T+2 สำหรับบัญชีธนาคารอื่นนอกเหนือจากที่ระบุข้างต้น (รายละเอียดอาจมีการเปลี่ยนแปลง)

T = วันทำการซื้อขายหน่วยลงทุน

บริษัทขอเรียนแจ้งว่า ตั้งแต่วันที่ 1 ส.ค. 2568 เป็นต้นไป บริษัทจะไม่ได้ให้บริการขายหน่วยลงทุนผ่านผู้แนะนำการลงทุนของบริษัท ไม่รับคำสั่งซื้อ/คำสั่งสับเปลี่ยนเข้า โดยตรงกับท่านผู้ถือหน่วยลงทุนและผู้สนใจลงทุนที่สำนักงานของบริษัท ในทุกช่องทาง ผู้ลงทุนสามารถดูรายละเอียดเพิ่มเติมได้ที่ <https://am.kkpf.com/th/news/2025033149952>

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม ^{1 2 3 4} (% ต่อปี)		
ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	2.6750	1.0700
รวมค่าใช้จ่าย	4.8150	1.1968

- หมายเหตุ :
- เนื่องจากกองทุนจัดตั้ง/เปิดให้บริการหน่วยลงทุนยังไม่ครบรอบระยะเวลาบัญชีของกองทุน ดังนั้น หัวข้อ “รวมค่าใช้จ่าย” จะแสดงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงจากกองทุน (%ต่อปี) คือ ค่าธรรมเนียมการจัดการ ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ของกองทุน ค่าธรรมเนียมนายทะเบียนหน่วยลงทุน โดยอัตราที่แสดงยังไม่รวมค่าใช้จ่ายอื่นๆ (%ต่อปี) (ค่าใช้จ่ายอื่น (%ต่อปี) จะแสดงในรายงานรอบระยะเวลาบัญชี)
 - ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว
 - ผู้ลงทุนสามารถดูข้อมูลค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวมย้อนหลัง 3 ปี ในหนังสือชี้ชวนส่วนข้อมูลกองทุนได้ที่ <https://am.kkpf.com>
 - บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการ

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย ^{1 2 3 4 5} (% ของมูลค่าหน่วยลงทุน)		
ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การขาย	2.0000	ไม่เปิดให้บริการ
การรับซื้อคืน	2.0000	ปัจจุบันยกเว้น
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า	2.0000	ปัจจุบันยกเว้น
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก	2.0000	ปัจจุบันยกเว้น
การโอนหน่วย	ตามที่นายทะเบียนกำหนด	ปัจจุบันยกเว้น

- หมายเหตุ :
- ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว
 - บริษัทจัดการขอสงวนสิทธิ์ยกเว้น และ/หรือลดหย่อน และ/หรือเรียกเก็บค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วยลงทุนแตกต่างกันตามเงื่อนไขที่บริษัทจัดการกำหนด และบริษัทจัดการจะเปิดเผยข้อมูลดังกล่าวโดยการระบุไว้ในหนังสือชี้ชวนส่วนสรุปข้อมูลสำคัญ และ/หรือประกาศทางเว็บไซต์ของบริษัทจัดการ
 - ในกรณีที่กองทุนลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมภายใต้การจัดการของบริษัทจัดการ กองทุนต้นทาง และกองทุนปลายทางจะไม่เรียกเก็บค่าธรรมเนียมการขาย (front-end fee) และค่าธรรมเนียมรับซื้อคืน (back-end fee) ข้ามซ้อนกัน และรวมถึงกรณีที่กองทุนปลายทางอาจลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมใด ๆ ของบริษัทจัดการอีกทอดหนึ่ง บริษัทจัดการจะไม่เรียกเก็บค่าธรรมเนียมดังกล่าวข้ามซ้อนด้วยเช่นกัน
 - บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ
 - ค่าใช้จ่ายในการซื้อ - ขายหลักทรัพย์ เมื่อสั่งซื้อ/ขาย/สับเปลี่ยนหน่วยลงทุน ไม่เกินร้อยละ 2.00 ของมูลค่าหน่วยลงทุน (ปัจจุบันยกเว้น)

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน		ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก	
ประเภททรัพย์สิน	% NAV	ชื่อทรัพย์สิน	% NAV
	N/A		N/A

ข้อมูลเพิ่มเติมเกี่ยวกับนโยบายการลงทุนด้านความยั่งยืน**▪ วัตถุประสงค์การลงทุนที่เกี่ยวกับความยั่งยืน****- ตราสารทุน**

กองทุนมีวัตถุประสงค์ที่จะสร้างผลตอบแทนที่ดีภายใต้ความเสี่ยงที่ยอมรับได้ ผ่านการลงทุนในตราสารทุนที่มีปัจจัยพื้นฐานที่ดี มีนโยบายหรือมีการจ่ายเงินปันผลอย่างสม่ำเสมอ และ/หรือมีแนวโน้มหรือศักยภาพในการจ่ายเงินปันผลในอนาคต มีความยั่งยืนของธุรกิจในระยะยาว โดยกองทุนได้ผนวก ESG Integration เข้าในกระบวนการลงทุน เพื่อการบริหารความเสี่ยงจากปัจจัยด้าน ESG นอกจากนี้ กองทุนยังมีวัตถุประสงค์เพื่อเป็นทางเลือกในการลงทุนให้กับผู้ลงทุนที่ต้องการกระจายการลงทุนบางส่วนไปลงทุนในหุ้น/ตราสารทุนของบริษัทที่ให้ความสำคัญกับ ESG รวมถึงมีส่วนร่วมในการสนับสนุนบริษัทจดทะเบียนที่มีการนำแนวคิดด้านความยั่งยืนเข้าเป็นส่วนหนึ่งในการบริหารจัดการ เพื่อบริษัทมีความเสี่ยงจากการเปลี่ยนแปลงด้านสังคมและสิ่งแวดล้อม เพิ่มขีดความสามารถในการแข่งขัน และให้ความสำคัญกับผู้มีส่วนได้เสีย

- ตราสารหนี้

กองทุนจะลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งพันธบัตรและ/หรือตราสารหนี้กลุ่มความยั่งยืน ตามที่สำนักงาน ก.ล.ด. กำหนดหรือเห็นชอบให้กองทุนรวมไทยเพื่อความยั่งยืนแบบพิเศษ (Thailand ESG Extra Fund) สามารถลงทุนหรือมีไว้ได้ เช่น พันธบัตรหรือหุ้นกู้เพื่ออนุรักษ์สิ่งแวดล้อม (Green Bond) พันธบัตรหรือหุ้นกู้เพื่อความยั่งยืน (Sustainability Bond) พันธบัตรหรือหุ้นกู้ส่งเสริมความยั่งยืน (Sustainability-linked Bond) ตราสารเพื่ออนุรักษ์สิ่งแวดล้อม (Green Bond) ตราสารเพื่อความยั่งยืน (Sustainability Bond) ตราสารส่งเสริมความยั่งยืน (Sustainability-linked bond) ที่มีการเปิดเผยวัตถุประสงค์การใช้เงินที่ได้จากการระดมทุน (Use of Proceeds) ว่าเป็นไปเพื่อโครงการที่เกี่ยวข้องกับการอนุรักษ์สิ่งแวดล้อมหรือเพื่อโครงการที่เกี่ยวข้องกับความยั่งยืนของประเทศไทย หรือมีการเปิดเผยข้อมูลเกี่ยวกับการกำหนดตัวชี้วัดและเป้าหมายเพื่อส่งเสริมความยั่งยืน แล้วแต่กรณี

▪ เป้าหมายที่กองทุนรวมต้องการบรรลุ**- ตราสารทุน**

กองทุนมีเป้าหมายที่จะเน้นลงทุนในหุ้น/ตราสารทุนของบริษัทจดทะเบียนที่จัดอยู่ในทรัพย์สินกลุ่มความยั่งยืน ตามที่สำนักงาน ก.ล.ด. กำหนด เพื่อสนับสนุนบริษัทที่ทำธุรกิจด้วยความยั่งยืน โดยคำนึงถึงการบริหารความเสี่ยงและเตรียมพร้อมรับความเสี่ยงที่เกิดขึ้นใหม่ (Emerging Risks) พร้อมรับมือกับปัจจัยการเปลี่ยนแปลงด้านสิ่งแวดล้อมและสังคม

โดยกองทุนต้องการเป็นส่วนหนึ่งเพื่อร่วมผลักดันเป้าหมายการพัฒนาที่ยั่งยืนทางเศรษฐกิจที่ต่อเนื่อง ครอบคลุม รวมทั้งการขับเคลื่อนการผลิตและการบริโภคที่ยั่งยืนบนพื้นฐานที่ตระหนักถึงต้นทุนทางสิ่งแวดล้อมและสังคม โดส่งเสริมการใช้ทรัพยากรธรรมชาติอย่างมีประสิทธิภาพ

- ตราสารหนี้

กองทุนมีเป้าหมายที่จะลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งพันธบัตรและ/หรือตราสารหนี้กลุ่มความยั่งยืน ตามที่สำนักงาน ก.ล.ด. กำหนดหรือเห็นชอบให้กองทุนรวมไทยเพื่อความยั่งยืนแบบพิเศษ (Thailand ESG Extra Fund) สามารถลงทุนหรือมีไว้ได้ โดยมีวัตถุประสงค์การใช้เงินที่ได้จากการระดมทุน (Use of Proceeds) ไปใช้ในโครงการที่เกี่ยวข้องกับการอนุรักษ์สิ่งแวดล้อมหรือโครงการที่เกี่ยวข้องกับความยั่งยืนของประเทศไทย หรือมีการกำหนดตัวชี้วัดและเป้าหมายเพื่อส่งเสริมความยั่งยืน แล้วแต่กรณี

▪ กรอบการลงทุน (investment universe)**- ตราสารทุน**

ในการการจัดทำ Investment Universe ผู้จัดการกองทุนและ/หรือนักวิเคราะห์การลงทุนจะคัดเลือกตราสารทุนที่เป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนใน SET โดยอาศัยข้อมูลเชิงปริมาณ (Quantitative Approach) เชิงคุณภาพ (Qualitative Approach) โดยจะพิจารณาผนวกปัจจัยด้าน ESG ในกระบวนการตัดสินใจลงทุน (ESG Integration)

สำหรับการวิเคราะห์เชิงปริมาณ (Quantitative Approach) จะพิจารณาข้อมูลต่าง ๆ อาทิ

• ข้อมูลของหลักทรัพย์ฯ เช่น ขนาดของหลักทรัพย์ฯ (Market Capitalization) สภาพคล่อง (Liquidity) เป็นต้น

• สัดส่วนทางการเงินที่สำคัญ (Financial Ratios) เช่น อัตราส่วนสภาพคล่อง (Leverage Ratio) อัตราส่วนความสามารถในการทำกำไร (Profitability Ratio) เป็นต้น

สำหรับการวิเคราะห์เชิงคุณภาพ (Qualitative Approach)

ผู้จัดการกองทุนและนักวิเคราะห์การลงทุนเน้นการลงทุนในบริษัทที่สามารถเข้าถึงผู้บริหารได้ มีพื้นฐานที่แข็งแกร่ง รวมทั้งผลการดำเนินงานที่มีแนวโน้มเติบโตในระยะยาวได้ดี โดยมีทีมวิเคราะห์การลงทุนภายในของบริษัทเข้าไปศึกษาบริษัทในเชิงลึก นอกจากการวิเคราะห์ภาพเศรษฐกิจ รวมถึงสถานะทางการเงินของบริษัทแล้ว ทีมนักวิเคราะห์การลงทุนยังเข้าพบผู้บริหารบริษัทต่าง ๆ (Company Visit)

- ตราสารหนี้

กองทุนจะเน้นลงทุนในพันธบัตรและ/หรือตราสารหนี้กลุ่มความยั่งยืน ตามที่สำนักงาน ก.ล.ด. กำหนดหรือเห็นชอบให้กองทุนรวมไทยเพื่อความยั่งยืนแบบพิเศษ (Thailand ESG Extra Fund) สามารถลงทุนหรือมีไว้ได้ เช่น พันธบัตรหรือหุ้นกู้เพื่ออนุรักษ์สิ่งแวดล้อม (Green Bond) พันธบัตรหรือหุ้นกู้เพื่อความยั่งยืน (Sustainability Bond) พันธบัตรหรือหุ้นกู้ส่งเสริมความยั่งยืน (Sustainability-linked Bond) ตราสารเพื่ออนุรักษ์สิ่งแวดล้อม (Green bond) ตราสารเพื่อความยั่งยืน (Sustainability Bond) ตราสารส่งเสริมความยั่งยืน (Sustainability-linked bond) ที่ผู้ออกตราสารต้องการระดมทุนเพื่อนำเงินไปใช้ในโครงการที่เกี่ยวข้องกับการอนุรักษ์สิ่งแวดล้อมหรือโครงการที่เกี่ยวข้องกับความยั่งยืน หรือมีการกำหนดตัวชี้วัดและเป้าหมายเพื่อส่งเสริมความยั่งยืน แล้วแต่กรณี

▪ การอ้างอิงดัชนีชี้วัดที่เกี่ยวกับความยั่งยืน (investment benchmark)

1. SETESG Total Return Index ในสัดส่วนร้อยละ 70

2. ThaiBMA Government Bond ESG Index Net Total Return ในสัดส่วนร้อยละ 25

3. ThaiBMA Short-term Government Bond Index Total Return ในสัดส่วนร้อยละ 5

- **ดัชนี SETESG Total Return Index** เป็นดัชนีที่สะท้อนการเคลื่อนไหวราคาของกลุ่มหลักทรัพย์ของบริษัทที่มีการดำเนินธุรกิจอย่างยั่งยืนซึ่งมีขนาด และสภาพคล่องผ่านตามเกณฑ์ที่กำหนด โดย ณ ขณะจัดตั้งกองทุนนี้ SET มีแนวทางในการคัดเลือกหุ้นเพื่อเป็นองค์ประกอบของดัชนี ดังนี้

• เป็นบริษัทที่อยู่ในผลประเมินหุ้นยั่งยืน SET ESG Ratings ที่ประกาศล่าสุด ก่อนรวมการทบทวนรายชื่อหลักทรัพย์ในดัชนี

• เป็นหลักทรัพย์ที่มีมูลค่าหลักทรัพย์ตามราคาตลาด (Market Capitalization) ไม่น้อยกว่า 5,000 ล้านบาท

• มีสัดส่วนผู้ถือหลักทรัพย์รายย่อย (Free-float) ไม่น้อยกว่าร้อยละ 20 ของทุนชำระแล้ว

• จำนวนหุ้นซื้อขายไม่น้อยกว่าร้อยละ 0.5 ของจำนวนหุ้นจดทะเบียนของบริษัท เป็นเวลาไม่ต่ำกว่า 9 ใน 12 เดือน

• ไม่จำกัดจำนวนหลักทรัพย์ในดัชนี

ผู้ลงทุนสามารถศึกษาข้อมูลปัจจุบันเกี่ยวกับการจัดทำ SET ESG Rating ได้ที่ SET <https://setsustainability.com/ESG-ratings> หรือที่ SET จะมีการแก้ไขปรับปรุงเพิ่มเติม

ทั้งนี้ ผู้ลงทุนสามารถศึกษาข้อมูลปัจจุบันเกี่ยวกับดัชนี คุณลักษณะและองค์ประกอบของดัชนี รวมถึงวิธีการจัดทำดัชนี (Index methodologies) ข้างต้นได้ที่ SET <https://www.set.or.th/th/market/index/setesg/profile> หรือที่ SET จะมีการแก้ไขปรับปรุงเพิ่มเติม

บริษัทจัดการจะเปลี่ยนแปลง Benchmark ของกองทุนตามข้างต้นที่จัดทำโดย SET เมื่อ SET มีการจัดทำดัชนี TRI ที่นำสัดส่วนผู้ถือหลักทรัพย์รายย่อยของแต่ละหลักทรัพย์ (free float) มาถ่วงน้ำหนักในการคำนวณดัชนี (ดัชนี free float TRI) เพื่อให้เป็นไปตามหลักเกณฑ์ที่คณะกรรมการกำกับตลาดทุนประกาศกำหนด

- **ดัชนี ThaiBMA Government Bond ESG Index Net Total Return** เป็นดัชนีที่รวมตราสารหนี้ ESG ภาครัฐที่ขึ้นทะเบียนกับ ThaiBMA

ทั้งนี้ ผู้ลงทุนสามารถศึกษาข้อมูลปัจจุบันเกี่ยวกับดัชนี คุณลักษณะและองค์ประกอบของดัชนี รวมถึงวิธีการจัดทำดัชนี (Index Methodologies) ข้างต้นได้ที่ ThaiBMA <https://www.thaibma.or.th/EN/Market/Index/ESGIndex.aspx> หรือที่ ThaiBMA จะมีการแก้ไขปรับปรุงเพิ่มเติม

- **ดัชนี ThaiBMA Short-term Government Index Total Return** เป็นดัชนีที่รวมตราสารหนี้ภาครัฐระยะสั้นที่ขึ้นทะเบียนกับ ThaiBMA ซึ่งสะท้อนการลงทุนในส่วนที่เป็นสภาพคล่องของกองทุน

ทั้งนี้ ผู้ลงทุนสามารถศึกษาข้อมูลปัจจุบันเกี่ยวกับดัชนี คุณลักษณะและองค์ประกอบของดัชนี รวมถึงวิธีการจัดทำดัชนี (Index Methodologies) ข้างต้นได้ที่ ThaiBMA <https://www.thaibma.or.th/EN/Market/Index/ShortTermIndex.aspx> และ https://www.thaibma.or.th/EN/Education/Bond_Tutor/InvestorGuide.aspx หรือที่ ThaiBMA จะมีการแก้ไขปรับปรุงเพิ่มเติม

บริษัทจัดการขอสงวนสิทธิ์ที่จะปรับปรุง/เปลี่ยนแปลงตัวชี้วัดในการเปรียบเทียบตามที่บริษัทจัดการเห็นควรและเหมาะสม ซึ่งอยู่ภายใต้กรอบนโยบายการลงทุนที่กำหนด โดยบริษัทจัดการจะเปิดเผยข้อมูลและแจ้งให้ผู้ลงทุนทราบล่วงหน้าอย่างชัดเจนถึงวันที่มีการปรับปรุง/เปลี่ยนแปลงตัวชี้วัด คำอธิบายเกี่ยวกับตัวชี้วัด และเหตุผลในการปรับปรุง/เปลี่ยนแปลงตัวชี้วัดดังกล่าวผ่านการลงประกาศในเว็บไซต์ของบริษัทจัดการ ภายในเวลาที่ผู้ลงทุนสามารถไปประโยชน์จากข้อมูลในการตัดสินใจลงทุนได้

อย่างไรก็ตาม ในกรณีการปรับปรุง/เปลี่ยนแปลงตัวชี้วัด เพื่อให้เป็นไปตามประกาศ เว็บบอร์ดและข้อกำหนดของสมาคมบริษัทจัดการลงทุน และ/หรือประกาศ ข้อกำหนดของสำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ด. เกี่ยวกับมาตรฐานการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวม และ/หรือการปรับปรุง/เปลี่ยนแปลงตัวชี้วัดในการใช้เปรียบเทียบในกรณีที่ผู้จัดทำดัชนี (Index Provider) ของตัวชี้วัดไม่ได้จัดทำหรือเปิดเผยข้อมูล/อัตราดังกล่าวอีกต่อไป บริษัทจัดการจะแจ้งปรับปรุง/เปลี่ยนแปลงดังกล่าวให้ผู้ถือหุ้นลงทุนทราบล่วงหน้าผ่านการประกาศในเว็บไซต์ของบริษัทจัดการ ภายในเวลาที่ผู้ลงทุนสามารถไปประโยชน์จากข้อมูลการตัดสินใจลงทุนได้

ตารางสรุปเงื่อนไขการรับคำสั่งซื้อ/ขาย/สับเปลี่ยนหน่วยลงทุนของ KKP BL THAI ESGX-for LTF

ช่วงระยะเวลา	คำสั่งซื้อหน่วยลงทุน	คำสั่งขายคืนหน่วยลงทุน	คำสั่งสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า	คำสั่งสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก
ช่วงเสนอขายหน่วยลงทุนครั้งแรก (IPO) (วันที่ 2 – 8 พ.ค. 2568)	X	X	X	X
ระหว่างวันที่ 13 พ.ค. 2568 – 30 มิ.ย. 2568	X	✓	✓ ¹	X
ตั้งแต่วันที่ 1 ก.ค. 2568 เป็นต้นไป	X	✓	✓	✓

¹ บริษัทจัดการกำหนดให้มีวันทำการสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า (Switching-in Trade Date) ของหน่วยลงทุนชนิดนี้สัปดาห์ละ 1 ครั้ง ดังต่อไปนี้ โดยผู้ลงทุนสามารถส่งคำสั่งเข้ามาได้ในช่วงเวลา 8.30 – 15.30 น.

- ทุกวันทำการสุดท้ายของแต่ละสัปดาห์
- วันจันทร์ที่ 30 มิถุนายน 2568

ในกรณีที่ผู้ถือหน่วยลงทุนไม่ได้ส่งคำสั่งสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนในระหว่างวันและเวลาที่บริษัทจัดการเปิดรับคำสั่ง หรือทำรายการนอกเหนือจากวันและเวลาที่บริษัทจัดการกำหนด หรือการทำรายการในวันหยุด บริษัทจัดการของสวนสิทธิที่จะรับคำสั่งสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนดังกล่าวได้ โดยบริษัทจัดการจะดำเนินการสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนให้ในวันทำการสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า (Switching-in Trade Date) ถัดไป

หมายเหตุ : ในการเปลี่ยนแปลงมูลค่าขั้นต่ำของการสั่งซื้อครั้งถัดไป บริษัทจัดการจะคำนึงถึงประโยชน์ของ ผู้ถือหน่วยลงทุนเป็นสำคัญ โดยบริษัทจัดการจะประกาศการเปลี่ยนแปลงและแจ้งให้ผู้ถือหน่วยลงทุนทราบล่วงหน้าอย่างชัดเจนถึงวันที่มีการเปลี่ยนแปลงมูลค่าขั้นต่ำของการสั่งซื้อ ครั้งถัดไป ค่าอธิบายเกี่ยวกับการเปลี่ยนแปลงและเหตุผลในการเปลี่ยนแปลงข้อมูลดังกล่าว ผ่านเว็บไซต์ของบริษัทจัดการ ภายในระยะเวลาที่ผู้ถือหน่วยลงทุนสามารถใช้ประโยชน์จากข้อมูลในการตัดสินใจลงทุนได้

คำอธิบาย

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

Recovering Period ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาดังแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลานานเท่าใด

FX Hedging เปรียบเทียบผลการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

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 สูงกว่าจะเป็นกองทุนที่มีประสิทธิภาพในการบริหารจัดการลงทุนที่ดีกว่า เนื่องจากได้รับผลตอบแทนส่วนเพิ่มที่สูงกว่าภายใต้ระดับความเสี่ยงเดียวกัน

Alpha ผลตอบแทนส่วนเกินของกองทุนรวมเมื่อเปรียบเทียบกับดัชนีชี้วัด (benchmark) โดยค่า Alpha ที่สูง หมายถึง กองทุนสามารถสร้างผลตอบแทนได้สูงกว่าดัชนีชี้วัด ซึ่งเป็นผลจากประสิทธิภาพของผู้จัดการกองทุนในการคัดเลือกหรือหาจังหวะเข้าลงทุนในหลักทรัพย์ได้อย่างเหมาะสม

Beta ระดับและทิศทางการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุน โดยเปรียบเทียบกับอัตราการเปลี่ยนแปลงของตลาด Beta น้อยกว่า 1 แสดงว่าหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนน้อยกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด Beta มากกว่า 1 แสดงว่าหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนมากกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด

Tracking Error อัตราผลตอบแทนของกองทุนที่มีประสิทธิภาพในการเลียนแบบดัชนีชี้วัด 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 จึงสามารถนำไปใช้เปรียบเทียบอัตราผลตอบแทนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีนโยบายถือครองตราสารหนี้จนครบกำหนดอายุและมีลักษณะการลงทุนที่ใกล้เคียงกันได้

คำเตือน/ข้อแนะนำ

- กองทุนเป็นกองทุนรวมผสมที่มีนโยบายการลงทุนในทรัพย์สินกลุ่มความยั่งยืนที่ออกโดยผู้ออกที่เป็นภาครัฐไทยหรือกิจการที่จัดตั้งขึ้นตามกฎหมายไทย ตามที่สำนักงาน ก.ล.ด. กำหนดหรือเห็นชอบให้กองทุนรวมไทยเพื่อความยั่งยืนแบบพิเศษ (Thailand ESG Extra Fund) สามารถลงทุนหรือมีไว้ได้ โดยมีการลงทุนและมี net exposure ในทรัพย์สินที่ลงทุนดังกล่าวโดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน ทั้งนี้ กองทุนจะลงทุนในหุ้น โดยมีการลงทุนและมี net exposure รวมกันโดยเฉลี่ยรอบปีบัญชี ไม่น้อยกว่าร้อยละ 65 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน โดยเน้นลงทุนในตราสารทุนที่มีนโยบายหรือมีการจ่ายเงินปันผลอย่างสม่ำเสมอ และ/หรือมีแนวโน้มหรือศักยภาพในการจ่ายเงินปันผลในอนาคต รวมถึงจะลงทุนในตราสารหนี้ทั้งตราสารภาครัฐและ/หรือตราสารหนี้ที่ออกโดยธนาคารพาณิชย์และ/หรือตราสารหนี้ที่ออกโดยบริษัทเอกชน
- กองทุนมีนโยบายเน้นลงทุนในทรัพย์สินกลุ่มความยั่งยืน ดังนั้น กองทุนจึงมีความเสี่ยงที่อาจแตกต่างเพิ่มเติมจากการลงทุนในตราสารทุนทั่วไป เช่น ความเสี่ยงจากการลงทุนอย่างยั่งยืน ความเสี่ยงจากการลงทุนแบบกระจุกตัวในทรัพย์สินที่เกี่ยวกับความยั่งยืน ความเสี่ยงจากการเปลี่ยนแปลงอันดับ SET ESG Ratings ในส่วนของการลงทุนในหุ้น และความเสี่ยงจากการพึ่งพาข้อมูลจากแหล่งข้อมูลภายนอก ความเสี่ยงด้านสภาพคล่องที่ทำให้ไม่สามารถซื้อหรือขายหลักทรัพย์บางตัวได้ในราคาหรือช่วงเวลาที่เหมาะสม ด้วยเงื่อนไขด้านความยั่งยืนที่กองทุนกำหนด เป็นต้น
- กองทุนมีนโยบายการลงทุนในตราสารทุนของบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย ซึ่งโดยหลักการลงทุน หุ้นเป็นทรัพย์สินที่มีความเสี่ยงสูง ดังนั้น ปัจจัยที่มีผลกระทบต่อเงินลงทุนของผู้ลงทุน อาจมาจากความผันผวนของราคาหลักทรัพย์ รวมถึงภาวะเศรษฐกิจมหภาคและจุลภาคทั้งภายในและต่างประเทศ ซึ่งส่งผลให้มูลค่าหน่วยลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงเพิ่มขึ้นหรือลดลงได้ และอาจทำให้ผู้ลงทุนขาดทุนได้
- กองทุนนี้อาจพิจารณาลงทุนในตราสารหนี้เอกชนและ/หรือเงินฝากที่เกี่ยวข้องกับธนาคาร/สถาบันการเงินเอกชน ดังนั้น จึงอาจมีความเสี่ยงเกี่ยวกับการผิดนัดชำระหนี้ ทำให้ผู้ลงทุนขาดทุนหรือได้รับเงินลงทุนคืนต่ำกว่าเงินลงทุนเริ่มแรกได้ รวมถึงอาจส่งผลให้ผู้ลงทุนไม่ได้รับคืนเงินตามระยะเวลาที่กำหนดด้วย
- กองทุนมีการบริหารเชิงรุก จึงมีความเสี่ยงจากการลงทุนแบบมุ่งหวังให้ผลประกอบการสูงกว่าดัชนีชี้วัด (Active management risk) ความเสี่ยงจากกระบวนการคัดเลือกหลักทรัพย์ การตัดสินใจลงทุน การวิเคราะห์หลักทรัพย์ หรือกลยุทธ์การลงทุนของผู้จัดการกองทุนที่อาจทำให้ผลตอบแทนของกองทุนไม่เป็นไปอย่างที่คาดหวัง หรือไม่สามารถสร้างผลตอบแทนที่สูงกว่าดัชนีชี้วัดได้ หรืออาจทำให้ผู้ลงทุนขาดทุนได้
- กองทุนนี้เหมาะกับนักลงทุนที่ต้องการกระจายการลงทุนไปลงทุนในกองทุนรวมผสมที่มีนโยบายลงทุนในตราสารทุนและตราสารหนี้กลุ่มความยั่งยืน เพื่อโอกาสการลงทุนในระยะยาว มีความเข้าใจและสามารถรับความผันผวนจากการลงทุนได้ และต้องการลงทุนเพื่อให้ได้รับสิทธิประโยชน์ทางภาษีโดยผู้ลงทุนต้องศึกษาและปฏิบัติตามเงื่อนไข วิธีการและข้อจำกัดในการลงทุนตามที่กำหนดไว้ในกฎหมายภาษีอากร ประมวลรัษฎากร และ/หรือหลักเกณฑ์ที่เกี่ยวข้อง
- กองทุนอาจลงทุนหรือมีไว้ซึ่งสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) เพื่อลดความเสี่ยง (Hedging) และ/หรือ สัญญาซื้อขายล่วงหน้า เพื่อเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน (Efficient Portfolio Management) และ/หรือตราสารที่มีสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแฝง (Structured Note) โดยสัญญาซื้อขายล่วงหน้า และ/หรือ ตราสารที่มีสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแฝงข้างต้น อาจมีสินค้า ตัวแปร หรือหลักทรัพย์อ้างอิง (Underlying) เป็นตราสารทุน ตราสารภาครัฐ ตราสารหนี้ เงินฝากหรือตราสารเทียบเท่าเงินฝาก ตัวสัญญาใช้เงิน บัตรเงินฝาก หน่วยลงทุนของกองทุน ดัชนีที่มีองค์ประกอบเป็นตราสารทุนหรือตราสารหนี้ อัตราดอกเบี้ย อัตราแลกเปลี่ยน เครดิต (กรณีเครดิต เฉพาะเพื่อการลดความเสี่ยง) ดัชนีเงินเฟ้อ ทองคำ น้ำมันดิบ ดัชนีกลุ่มสินค้าโภคภัณฑ์ และ/หรือดัชนีที่มีองค์ประกอบเป็นสินค้าหรือตัวแปรตามที่ระบุข้างต้นหรือมีองค์ประกอบเป็นดัชนีตามที่ระบุข้างต้น ทั้งนี้ การทำสัญญาซื้อขายล่วงหน้า และการลงทุนในตราสารที่มีสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแฝงข้างต้นอาจมีต้นทุน และมีความเสี่ยงที่เกี่ยวข้องต่าง ๆ เช่น ความเสี่ยงจากการที่คู่สัญญาผิดนัดชำระหนี้ หรือไม่สามารถส่งมอบ (Delivery failure) หรือไม่สามารถปฏิบัติตามข้อตกลงได้ ความเสี่ยงด้านสภาพคล่องในการซื้อหรือขายหรือไม่สามารถปิดสถานะได้ (Close-out Position) รวมถึงอาจมีความเสี่ยงจากการที่ราคาของ Underlying มีราคาเคลื่อนไหวในทิศทางตรงกันข้ามกับที่คาดการณ์ไว้ ทำให้กองทุนรับรู้ผลขาดทุน เป็นต้น โดยบริษัทจัดการจะกำหนดกลยุทธ์ในการบริหารจัดการความเสี่ยงที่เกิดขึ้นจากการลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า และตราสารที่มีสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแฝง ตลอดจนจัดให้มีระบบที่เหมาะสมในการบริหารความเสี่ยงของสัญญาซื้อขายล่วงหน้า และตราสารที่มีสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแฝง เช่น บริษัทจัดการจะวิเคราะห์และติดตามสถานะหรืออันดับความน่าเชื่อถือของบริษัทที่เป็นคู่สัญญาซื้อขายล่วงหน้าและตราสารที่มีสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแฝง อย่างระมัดระวังและสม่ำเสมอ และหากมีการปรับตัวในทางลบอย่างมีนัยสำคัญ บริษัทจัดการจะพิจารณาปรับเปลี่ยนแผนการลงทุนให้เหมาะสมกับสภาวะการณ์ เพื่อลดความเสี่ยงจากการที่คู่สัญญาไม่สามารถทำตามข้อสัญญาตามที่ตกลงกันไว้ รวมถึงบริษัทจัดการจะติดตามสถานการณ์การเปลี่ยนแปลงทางด้านราคา และการเคลื่อนไหวของ Underlying หรือปัจจัยที่อาจส่งผลกระทบต่อราคาและการเคลื่อนไหวของ Underlying อย่างใกล้ชิด โดยจะเป็นไปตามหลักเกณฑ์และประกาศที่คณะกรรมการ ก.ล.ด. คณะกรรมการกำกับตลาดทุน สำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ด. และ/หรือหน่วยงานที่เกี่ยวข้องกำหนด
- ในกรณีที่กองทุนรวมลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเพื่อลดความเสี่ยงโดยสินค้าหรือตัวแปรของสัญญาซื้อขายล่วงหน้า นั้น ไม่ใช่สิ่งเดียวกับทรัพย์สินที่ต้องการลดความเสี่ยง บริษัทจัดการจะใช้ข้อมูลในอดีตในการคำนวณ
- ค่าสัมบูรณ์ของค่าสัมประสิทธิ์สหสัมพันธ์ (Absolute Correlation Coefficient) กองทุนรวมจึงมีความเสี่ยง หากสินค้าหรือตัวแปรที่สัญญาซื้อขายล่วงหน้าอ้างอิง (Underlying) และทรัพย์สินที่ต้องการลดความเสี่ยงเคลื่อนไหวในทิศทางที่ไม่เป็นไปตามข้อมูลในอดีต ซึ่งอาจส่งผลให้การเข้าทำสัญญาซื้อขายล่วงหน้าไม่สามารถลดความเสี่ยงได้อย่างเต็มประสิทธิภาพ

คำเตือน/ข้อแนะนำ

- ในกรณีที่กองทุนพิจารณาลงทุนในต่างประเทศ สัดส่วนการลงทุนในต่างประเทศจะไม่เกินร้อยละ 20 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน โดยกองทุนจะเข้าเป็นคู่สัญญาในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) เพื่อป้องกันความเสี่ยงที่เกี่ยวข้องกับอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราที่อาจเกิดขึ้นได้จากการลงทุนในต่างประเทศ ไม่ต่ำกว่าร้อยละ 90 ของจำนวนเงินลงทุนในต่างประเทศ
- กองทุนอาจลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมซึ่งอยู่ภายใต้การบริหารของบริษัทจัดการได้ (Cross Investing Fund) ตามอัตราส่วนที่บริษัทจัดการกำหนด ดังนั้น บริษัทจัดการจะจัดให้มีระบบงานที่ป้องกันธุรกรรมที่อาจก่อให้เกิดความขัดแย้งทางผลประโยชน์อันอาจเกิดจากนโยบายการลงทุนที่เปิดให้มีการลงทุนในกองทุนรวมภายใต้การบริหารจัดการของบริษัทจัดการเดียวกัน เพื่อให้เกิดประโยชน์สูงสุดแก่ผู้ถือหน่วยลงทุนของทั้งกองทุนรวมต้นทางและกองทุนรวมปลายทาง ทั้งนี้ ผู้ถือหน่วยสามารถสอบถามข้อมูลได้ที่ <https://am.kkpgf.com>
- ผู้ลงทุนมีหน้าที่ศึกษากฎหมายภาษีอากรที่เกี่ยวข้องกับการลงทุนในกองทุนรวมไทยเพื่อความยั่งยืนแบบพิเศษ และที่แก้ไขเปลี่ยนแปลง (ถ้ามี) เพื่อความเข้าใจในการลงทุนและเงื่อนไขการลงทุนที่ถูกต้องเพื่อใช้ประกอบในการตัดสินใจลงทุนหรือการซื้อและหรือขายคืนและหรือโอนย้ายหน่วยลงทุนกองทุนรวมไทยเพื่อความยั่งยืนแบบพิเศษเพื่อให้เป็นไปอย่างถูกต้องตามที่กฎหมายที่เกี่ยวข้องกำหนด หากการลงทุนและหรือการซื้อขายและหรือโอนย้ายหน่วยลงทุนขัดต่อกฎหมายภาษีอากรที่เกี่ยวข้อง ผู้ลงทุนอาจต้องชำระคืนภาษีและหรือมีเบี้ยปรับ และหรือเงินเพิ่มหรือค่าธรรมเนียมหรือค่าใช้จ่ายอื่น ทั้งนี้บริษัทจัดการไม่มีภาระผูกพันในการชดเชยค่าภาษีที่ผู้ลงทุนถูกเรียกเก็บ เบี้ยปรับ เงินเพิ่มค่าธรรมเนียม ดอกเบี้ย และหรือค่าใช้จ่ายอื่นที่เกิดขึ้นกับผู้ลงทุน
- ผู้ลงทุนต้องลงทุนในกองทุนรวมไทยเพื่อความยั่งยืนแบบพิเศษอย่างต่อเนื่องระยะยาวตามที่กฎหมายที่เกี่ยวข้องและประมวลรัษฎากรกำหนด ซึ่งผู้ลงทุนจะมีภาระผูกพันที่จะต้องปฏิบัติตามเงื่อนไขและวิธีการที่กำหนดไว้ในกฎหมายภาษีอากร ผู้ลงทุนในกองทุนรวมไทยเพื่อความยั่งยืนแบบพิเศษ จะไม่ได้รับสิทธิประโยชน์ทางภาษีหากไม่ปฏิบัติตามเงื่อนไขการลงทุนและจะต้องคืนสิทธิประโยชน์ทางภาษีที่เคยได้รับภายในกำหนดเวลาที่กฎหมายที่เกี่ยวข้องกำหนด มิฉะนั้นจะต้องชำระเงินเพิ่มและหรือเบี้ยปรับตามประมวลรัษฎากร
- สิทธิประโยชน์ทางภาษีที่ผู้ถือหน่วยลงทุนกองทุนรวมไทยเพื่อความยั่งยืนแบบพิเศษ นี้พึงได้รับจะสิ้นสุดลงเมื่อผู้ถือหน่วยลงทุนไม่ปฏิบัติตามเงื่อนไขการลงทุน โดยผู้ถือหน่วยลงทุนจะต้องชำระคืนสิทธิประโยชน์ทางภาษีที่เคยได้รับภายในกำหนดเวลา และหากการชำระคืนสิทธิประโยชน์ทางภาษีดังกล่าวไม่เป็นไปตามที่กำหนด ผู้ถือหน่วยลงทุนจะต้องชำระเงินเพิ่มและ/หรือเบี้ยปรับตามประมวลรัษฎากรด้วย ทั้งนี้ สิทธิประโยชน์ทางภาษีที่ผู้ถือหน่วยลงทุนจะได้รับและภาระภาษีที่อาจเกิดขึ้นเมื่อไม่ปฏิบัติตามเงื่อนไขการลงทุน จะเป็นไปตามที่กรมสรรพากรกำหนด
- ผู้ลงทุนไม่สามารถนำหน่วยลงทุนกองทุนรวมไทยเพื่อความยั่งยืนแบบพิเศษ ไปจำหน่าย โอน จำนำ หรือนำไปเป็นประกันได้
- ผู้ลงทุนมีหน้าที่ในการบันทึก จัดเก็บ และตรวจสอบรายละเอียดการลงทุนและเอกสารอื่นที่เกี่ยวข้องกับการลงทุนในกองทุนรวมไทยเพื่อความยั่งยืนแบบพิเศษ ของผู้ลงทุนเพื่อให้เป็นไปตามที่กฎหมายที่เกี่ยวข้องกำหนด
- บริษัทจัดการขอสงวนสิทธิที่จะดำเนินการจัดการกองทุนรวมต่อไปหรือหยุดเสนอขาย หรือปิดรับคำสั่งซื้อ/สับเปลี่ยนเข้า เป็นการชั่วคราวหรือถาวร หากสิทธิประโยชน์ทางภาษีของการลงทุนหมดสิ้นไปหรือเปลี่ยนแปลงไป และ/หรือเงื่อนไขการลงทุนในหน่วยลงทุนเพื่อให้ได้สิทธิประโยชน์ทางภาษีหมดสิ้นไปหรือเปลี่ยนแปลงไป และ/หรือกรณีอื่นใดเพื่อประโยชน์โดยรวมของผู้ถือหน่วยลงทุน โดยบริษัทจัดการจะแจ้งให้ทราบล่วงหน้าไม่น้อยกว่า 3 วันก่อนการเปลี่ยนแปลงข้างต้นผ่านทางเว็บไซต์ของบริษัทจัดการ เว้นแต่กรณีที่เกิดจากปัจจัยที่ควบคุมไม่ได้ และ/หรือกรณีจำเป็นและสมควรและ/หรือเหตุสุดวิสัย บริษัทจัดการจะแจ้งการเปลี่ยนแปลงดังกล่าวโดยไม่ชักช้า ทั้งนี้ ในกรณีที่บริษัทจัดการดำเนินการจัดการกองทุนรวมต่อไปเมื่อสิทธิประโยชน์ทางภาษีของการลงทุนหมดสิ้นลง ผู้ถือหน่วยลงทุนจะไม่สามารถได้รับสิทธิประโยชน์ทางภาษีอีกต่อไป เว้นแต่เป็นตามเงื่อนไขที่กรมสรรพากร หรือกฎหมายอื่นใดที่เกี่ยวข้อง หรือประกาศสำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ด. หรือประกาศอื่นใดที่เกี่ยวข้องประกาศกำหนด และ/หรือประกาศที่มีการแก้ไขเพิ่มเติมในอนาคต
- การลงทุนมีความเสี่ยง ผู้ลงทุนควรศึกษาข้อมูลกองทุนและข้อมูลเกี่ยวกับสิทธิประโยชน์ทางภาษีที่ระบุไว้ในคู่มือการลงทุนในกองทุนรวมไทยเพื่อความยั่งยืนก่อนการตัดสินใจลงทุน รวมทั้งสอบถามและขอรับคู่มือการลงทุนในกองทุนรวมไทยเพื่อความยั่งยืนแบบพิเศษได้ทั้งบริษัทจัดการ หรือ ผู้สนับสนุนการขายหรือรับซื้อคืนหน่วยลงทุนอื่นที่ได้รับการแต่งตั้ง

เครื่องมือบริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่อง

ผู้ลงทุนสามารถศึกษารายละเอียด หลักเกณฑ์ และเงื่อนไขการใช้งานของแต่ละเครื่องมือบริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่องได้ในรายละเอียดโครงการ และหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม ที่ <https://am.kkpfpg.com>

กลุ่มเครื่องมือที่ส่งผ่านภาระค่าใช้จ่ายให้ผู้ลงทุน

1. ค่าธรรมเนียมการรักษาสภาพคล่อง (Liquidity Fee)

เครื่องมือที่สะท้อนต้นทุนของกองทุนที่เกิดขึ้นในภาวะที่ตลาดมีความผันผวนสูงหรือมีการขายคืนหน่วยลงทุนหรือมีการสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออกของกองทุนนั้น ๆ สูงเกินกว่าปกติ โดยจะเรียกเก็บค่าธรรมเนียมเฉพาะ “ผู้ขาย” หรือผู้สับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออกในจำนวนที่เกินกว่าปริมาณและ/หรือ ก่อนระยะเวลาที่กำหนด และเป็นการเรียกเก็บเข้ากองทุน

2. การปรับมูลค่าทรัพย์สินสุทธิด้วยสูตรการคำนวณที่สะท้อนต้นทุนในการซื้อขายทรัพย์สินของกองทุนรวม (Swing Pricing)

เครื่องมือใช้ปรับมูลค่าหน่วยลงทุน เพื่อให้สะท้อนต้นทุนการซื้อขายของกองทุนในภาวะที่ตลาดมีความผันผวน โดยเพิ่มตัวแปร (Swing Factor) ที่ช่วยสะท้อนต้นทุนค่าใช้จ่ายและใช้ตัวแปรนั้นช่วยในการปรับมูลค่าหน่วยลงทุน นอกจากนี้ กองทุนอาจเลือกใช้ Swing Pricing เฉพาะช่วงเวลาที่มีการซื้อขายสุทธิเกินกว่าที่กำหนดไว้ (Partial swing pricing) หรือสามารถใช้ทุกวันในช่วงที่ตลาดมีความผันผวน (Full swing pricing) ขึ้นอยู่กับการกำหนดเงื่อนไขในการใช้เครื่องมือตามลักษณะสินทรัพย์หรือต้นทุนที่เกิดขึ้นกับกองทุนรวมนั้น ๆ

3. การเพิ่มค่าธรรมเนียมการซื้อขายหน่วยลงทุนที่สะท้อนต้นทุนในการซื้อขายทรัพย์สินของกองทุนรวม (Anti-Dilution Levies - ADLs)

เครื่องมือที่ทำให้การซื้อขายหน่วยลงทุนสะท้อนต้นทุนที่เกี่ยวข้องจากการปรับพอร์ตของกองทุน ในภาวะตลาดผันผวนสูงผิดปกติหรือสภาพคล่องผิดปกติ หรือเกิดเหตุการณ์อื่นที่อาจจะกระทบต่อต้นทุนและค่าใช้จ่ายของกองทุนรวม โดยกองทุนจะกำหนดมูลค่าซื้อขายสุทธิเป็นเกณฑ์ของเครื่องมือ ถ้ามีการซื้อขายหรือสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเกินกว่าระดับที่กำหนด กองทุนจะมีการเรียกเก็บค่าธรรมเนียมเพิ่มเติมเข้ากองทุน และการคิดค่าธรรมเนียมอาจเกิดขึ้นได้ทั้งจากผู้ซื้อ/สับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า หรือจาก ผู้ขาย/สับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออกก็ได้ ซึ่งขึ้นอยู่กับปริมาณธุรกรรมที่เกิดขึ้นตามเงื่อนไขที่ บลจ. กำหนด

กลุ่มเครื่องมือที่จำกัดคำสั่งรับซื้อคืนหน่วยลงทุน

4. ระยะเวลาที่ต้องแจ้งล่วงหน้าก่อนการขายคืนหน่วยลงทุน (Notice Period)

เครื่องมือที่จะกำหนดระยะเวลาในการส่งคำสั่งเพื่อทำการขายคืนหรือสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออกไว้ล่วงหน้าหากผู้ถือหน่วยทำการที่เกินกว่าปริมาณที่กำหนด เพื่อให้กองทุนมีเวลาในการเตรียมขายสินทรัพย์เพื่อมาชำระค่าขายคืนหน่วยลงทุน

5. เพดานการขายคืนหน่วยลงทุน (Redemption Gate)

เป็นเครื่องมือที่กำหนดเพดานมูลค่าที่จะให้ผู้ถือหน่วยลงทุนขายคืนหน่วยลงทุนหรือสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออกได้ในแต่ละกองทุน เมื่อเกิดสถานการณ์ไม่ปกติ หรือประเมินว่าสถานการณ์อาจจะไม่ปกติ โดย บลจ. จะใช้วิธีการชำระคืนตามสัดส่วน หรือที่เรียกว่า Pro rata สำหรับคำสั่งขายคืนหน่วยลงทุนหรือสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออกที่เหลือ จะทำการขายคืนให้ในวันทำการถัดไป หากวันทำการถัดไป บลจ. ยังคงใช้เครื่องมือนี้ บลจ. จะชำระคืนตามวิธี Pro rata โดยไม่มีการจัดลำดับก่อนหลัง แต่หากวันทำการถัดไปกองทุนมีสภาพคล่องเพียงพอ ทำให้ บลจ. ไม่ต้องใช้เครื่องมือนี้ บลจ. จะชำระคืนตามรายการขายคืนหน่วยลงทุนหรือสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออกที่ได้รับไว้ทั้งหมด

6. การดำเนินการในกรณีที่ผู้ออกตราสารหนี้หรือลูกหนี้ตามสิทธิเรียกร้องผิดนัดชำระหนี้ หรือตราสารที่ลงทุนประสบปัญหาขาดสภาพคล่องหรือไม่สามารถจำหน่ายได้ด้วยราคาที่สมเหตุสมผล (Side Pocket)

เครื่องมือที่ทำให้กองทุนรวมสามารถแยกสินทรัพย์ที่มีปัญหาด้านสภาพคล่อง ออกจากทรัพย์สินโดยรวมของกองทุน โดยในวันที่ บลจ. ดำเนินการแยกทรัพย์สินดังกล่าว บลจ. จะทำทะเบียนผู้ถือหน่วยลงทุน ณ วันทำการนั้น เพื่อใช้เป็นข้อมูลสำหรับการคืนเงินที่ บลจ. อาจได้รับจากทรัพย์สินที่ติดปัญหาด้านสภาพคล่องข้างต้นในอนาคต

7. การไม่ขายหรือไม่รับซื้อคืนหน่วยลงทุนตามคำสั่งที่รับไว้หรือจะหยุดรับคำสั่งซื้อหรือคำสั่งขายคืนหน่วยลงทุน (Suspension of dealings)

การระงับการซื้อขายหน่วยลงทุนเป็นการชั่วคราวเพื่อลดผลกระทบต่อการบริหารสภาพคล่องของกองทุน และโดยเฉพาะเพื่อป้องกันไม่ให้เกิดปัญหารุนแรงมากขึ้นจนถึงขั้นปิดกอง จัดเป็นเครื่องมือที่มีผลกระทบสูง การใช้เครื่องมือถูกควบคุมดูแลจากสำนักงาน ก.ล.ด. เงื่อนไขของการนำมาใช้จะต้องคำนึงถึงประโยชน์โดยรวมของผู้ถือหน่วยลงทุน