

ตารางเปรียบเทียบแก้ไขเพิ่มเติมโครงการจัดการ
กองทุนเปิดอีเอสทีสปริง ESG Mixed 30/70 (ES-ESG3070)

หัวข้อ	รายละเอียดเดิม	รายละเอียดใหม่
ข้อ 2. ประเภท กองทุน	ผู้ประเมินผลการดำเนินงานด้านความยั่งยืนตามมาตรฐานสากล - ไม่มี	ผู้ประเมินผลการดำเนินงานด้านความยั่งยืนตามมาตรฐานสากล - มี ชื่อผู้ประเมินผลการดำเนินงานด้านความยั่งยืนตามมาตรฐานสากล - MORNINGSTAR SUSTAINALYTICS
	รายละเอียดเพิ่มเติมเกี่ยวกับนโยบายการลงทุนและลักษณะพิเศษ : 1. นโยบายการลงทุน ส่วนที่ 1 : กองทุนมีนโยบายกระจายการลงทุน 1.1 หุ้นที่เป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET) บนกระดานหลัก หรือกระดานเอ็มเอไอ (mai) ที่ได้รับการคัดเลือกจาก SET ว่าเป็นความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน (Environmental Social and Governance: ESG) ในสัดส่วนที่เท่าหรือใกล้เคียงกับน้ำหนักที่เป็นส่วนประกอบของดัชนีผลตอบแทนรวม SETESG Index (SETESG TRI) และใช้การลงทุนแบบ Optimization โดยผู้จัดการกองทุนจะบริหารพอร์ตและสภาพคล่องในการลงทุนให้มีประสิทธิภาพ โดยอาจไม่จำเป็นต้องลงทุนในหุ้นทุกตัวที่เป็นองค์ประกอบของดัชนี เช่น ไม่ลงทุนในหุ้นที่สภาพคล่องและ/หรือต้นทุนซื้อขายไม่สอดคล้องกับขนาดของกองทุน เป็นต้น	รายละเอียดเพิ่มเติมเกี่ยวกับนโยบายการลงทุนและลักษณะพิเศษ : 1. นโยบายการลงทุน ส่วนที่ 1 : กองทุนมีนโยบายกระจายการลงทุน 1.1 หุ้นที่เป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET) บนกระดานหลัก หรือกระดานเอ็มเอไอ (mai) ที่ได้รับการประเมินจาก Morningstar Sustainalytics (“ผู้ประเมิน”) ว่าเป็นความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน (Environmental Social and Governance: ESG) ในสัดส่วนที่เท่าหรือใกล้เคียงกับน้ำหนักที่เป็นส่วนประกอบของดัชนี Morningstar Thailand ex REIT Sustainability 10pct Cap TR THB และใช้การลงทุนแบบ Optimization โดยผู้จัดการกองทุนจะบริหารพอร์ตและสภาพคล่องในการลงทุนให้มีประสิทธิภาพ โดยอาจไม่จำเป็นต้องลงทุนในหุ้นทุกตัวที่เป็นองค์ประกอบของดัชนี เช่น ไม่ลงทุนในหุ้นที่สภาพคล่องและ/หรือต้นทุนซื้อขายไม่สอดคล้องกับขนาดของกองทุน เป็นต้น

หัวข้อ	รายละเอียดเดิม	รายละเอียดใหม่
	<p>และปรับน้ำหนักของหุ้นที่ลงทุนบางตัว ให้สูงกว่าหรือต่ำกว่าน้ำหนักในดัชนีเพื่อทดแทนหุ้นที่ไม่ได้ลงทุนและให้กองทุนมีผลตอบแทนใกล้เคียงกับดัชนีที่สุด</p> <p>1.2 ตราสารอย่างใดอย่างหนึ่ง หรือหลายอย่าง ดังนี้</p> <p>1.2.1 พันธบัตรรัฐบาล พันธบัตรที่กระทรวงการคลังค้ำประกันต้นเงิน</p> <p>.....</p> <p>.....</p> <p>1.1 วัตถุประสงค์การลงทุนที่เกี่ยวข้องกับความยั่งยืน</p> <p>กองทุนมีวัตถุประสงค์ในการช่วยส่งเสริมการลงทุน เพื่อสร้างผลตอบแทนที่ยั่งยืนในระยะยาวควบคู่ไปกับการช่วยสร้างผลกระทบเชิงบวกและลดผลกระทบเชิงลบต่อสังคมและสิ่งแวดล้อม ผ่านการลงทุนใน</p> <p>- หุ้นที่เป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET) บนกระดานหลัก หรือกระดานเอ็มเอไอ (mai) ที่ได้รับการคัดเลือกจาก SET ว่ามีความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน (Environmental Social and Governance: ESG) ในสัดส่วนที่เท่าหรือใกล้เคียงกับน้ำหนักที่เป็นส่วนประกอบของดัชนีผลตอบแทนรวม SETESG Index (SETESG TRI) ซึ่งเป็นดัชนีที่ได้รับการคัดเลือกจากตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET) ว่ามีความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน (Environmental Social and Governance: ESG) และ/หรือ</p>	<p>และปรับน้ำหนักของหุ้นที่ลงทุนบางตัว ให้สูงกว่าหรือต่ำกว่าน้ำหนักในดัชนีเพื่อทดแทนหุ้นที่ไม่ได้ลงทุนและให้กองทุนมีผลตอบแทนใกล้เคียงกับดัชนีที่สุด</p> <p>1.2 ตราสารอย่างใดอย่างหนึ่ง หรือหลายอย่าง ดังนี้</p> <p>1.2.1 พันธบัตรรัฐบาล พันธบัตรที่กระทรวงการคลังค้ำประกันต้นเงิน</p> <p>.....</p> <p>.....</p> <p>1.1.วัตถุประสงค์การลงทุนที่เกี่ยวข้องกับความยั่งยืน :</p> <p>กองทุนมีวัตถุประสงค์ในการช่วยส่งเสริมการลงทุน เพื่อสร้างผลตอบแทนที่ยั่งยืนในระยะยาวควบคู่ไปกับการช่วยสร้างผลกระทบเชิงบวกและลดผลกระทบเชิงลบต่อสังคมและสิ่งแวดล้อม ผ่านการลงทุนใน</p> <p>- หุ้นที่เป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET) บนกระดานหลัก หรือกระดานเอ็มเอไอ (mai) ที่ได้รับการประเมินจาก Morningstar Sustainalytics (“ผู้ประเมิน”) ว่ามีความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน (Environmental Social and Governance: ESG) ในสัดส่วนที่เท่าหรือใกล้เคียงกับน้ำหนักที่เป็นส่วนประกอบของดัชนี Morningstar Thailand ex REIT Sustainability 10pct Cap TR THB ซึ่งเป็นดัชนีที่ได้รับการประเมินจากผู้ประเมิน ว่ามีความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน (Environmental Social and Governance: ESG)</p>

หัวข้อ	รายละเอียดเดิม	รายละเอียดใหม่
	<p>- ตราสารอย่างใดอย่างหนึ่ง หรือหลายอย่าง ดังนี้</p> <p>.....</p> <p>.....</p>	<p>กองทุนจะพิจารณาลงทุนในหลักทรัพย์ที่เป็นองค์ประกอบของดัชนี Morningstar Thailand ex REIT Sustainability 10pct Cap TR THB ซึ่งจัดทำโดย Morningstar, Inc. ภายใต้ธุรกิจ Morningstar Indexes ซึ่งใช้ข้อมูลการประเมินความเสี่ยงด้านความยั่งยืน (ESG Risk Ratings) ของผู้ประเมิน ไม่เกินระดับความเสี่ยงสูง (High) ทั้งนี้ หลักทรัพย์ที่ได้รับ ESG Risk Ratings ระดับความเสี่ยงรุนแรง (Severe)) จะไม่ถูกนำมาเป็นองค์ประกอบของดัชนี นอกจากนี้หลักทรัพย์ที่อยู่ในระดับความเสี่ยงรุนแรง (Severe) จะไม่ถือว่าเป็นหลักทรัพย์ที่มีความโดดเด่นด้าน ESG เนื่องจากเป็นหลักทรัพย์ของบริษัทที่มีความเสี่ยงด้านสิ่งแวดล้อม สังคม และธรรมาภิบาล (ESG) ที่ยังไม่ได้รับการบริหารจัดการอย่างเพียงพอในระดับสูงสุด ซึ่งอาจส่งผลกระทบต่อมูลค่ากิจการและความสามารถในการดำเนินธุรกิจในระยะยาว การไม่ลงทุนในหลักทรัพย์ดังกล่าวจึงเป็นส่วนหนึ่งของแนวทางการบูรณาการปัจจัยด้าน ESG ในกระบวนการลงทุน เพื่อช่วยลดความเสี่ยงด้าน ESG โดยรวมของพอร์ตการลงทุน สนับสนุนการบริหารความเสี่ยงในระยะยาว และเสริมสร้างคุณลักษณะด้านความยั่งยืนของกองทุนให้สอดคล้องกับวัตถุประสงค์การลงทุนอย่างยั่งยืนของกองทุน และ/หรือ</p> <p>- ตราสารอย่างใดอย่างหนึ่ง หรือหลายอย่าง ดังนี้</p> <p>.....</p> <p>.....</p>

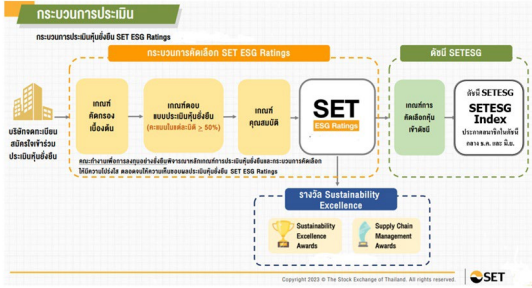
หัวข้อ	รายละเอียดเดิม	รายละเอียดใหม่
	<p>1.2 เป้าหมายที่กองทุนรวมต้องการบรรลุ: เพื่อสร้างผลตอบแทนอย่างยั่งยืนให้กับผู้ลงทุน รวมถึงเป็นแรงขับเคลื่อนให้มีกิจกรรมที่มุ่งเน้นการดำเนินงานที่คำนึงถึงปัจจัยด้าน ESG มากขึ้น เพื่อส่งเสริมให้เกิดระบบนิเวศที่ยั่งยืนต่อระบบเศรษฐกิจไทย ซึ่งเป็นกลไกสนับสนุนให้เศรษฐกิจไทยสามารถเติบโตได้อย่างยั่งยืน รวมถึงส่งเสริมประเทศไทยในการเปลี่ยนผ่านไปสู่ความยั่งยืนในระดับสากล โดยการสนับสนุนการลงทุนใน</p> <ul style="list-style-type: none"> - ตราสารทุนของบริษัทที่ได้รับการคัดเลือกจากตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET) ว่ามีการประกอบกิจการที่มีความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือ ด้านความยั่งยืน (Environmental, Social and Governance หรือ ESG) และ/หรือ - ตราสารภาครัฐไทยหรือกิจการที่จัดตั้งขึ้นตามกฎหมายไทย เพื่อการอนุรักษ์สิ่งแวดล้อม หรือ <p>.....</p> <p>.....</p> <p>1.3 กรอบการลงทุน (Investment Universe) 1.3.1 ประเภทหรือลักษณะของหลักทรัพย์หรือทรัพย์สิน</p> <p>.....</p> <p>.....</p>	<p>1.2 เป้าหมายที่กองทุนรวมต้องการบรรลุ: เพื่อสร้างผลตอบแทนอย่างยั่งยืนให้กับผู้ลงทุน รวมถึงเป็นแรงขับเคลื่อนให้มีกิจกรรมที่มุ่งเน้นการดำเนินงานที่คำนึงถึงปัจจัยด้าน ESG มากขึ้น เพื่อส่งเสริมให้เกิดระบบนิเวศที่ยั่งยืนต่อระบบเศรษฐกิจไทย ซึ่งเป็นกลไกสนับสนุนให้เศรษฐกิจไทยสามารถเติบโตได้อย่างยั่งยืน รวมถึงส่งเสริมประเทศไทยในการเปลี่ยนผ่านไปสู่ความยั่งยืนในระดับสากล โดยการสนับสนุนการลงทุนใน</p> <ul style="list-style-type: none"> - ตราสารทุนของบริษัทที่ได้รับการประเมินจาก Morningstar Sustainalytics ว่ามีการประกอบกิจการที่มีความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือ ด้านความยั่งยืน (Environmental, Social and Governance หรือ ESG) และ/หรือ - ตราสารภาครัฐไทยหรือกิจการที่จัดตั้งขึ้นตามกฎหมายไทย เพื่อการอนุรักษ์สิ่งแวดล้อม หรือ <p>.....</p> <p>.....</p> <p>1.3 กรอบการลงทุน (Investment Universe) 1.3.1 ประเภทหรือลักษณะของหลักทรัพย์หรือทรัพย์สิน</p> <p>.....</p> <p>.....</p>

หัวข้อ	รายละเอียดเดิม	รายละเอียดใหม่
	<p>- การลงทุนในตราสารทุน ได้แก่ หุ้นที่เป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET) บนกระดานหลัก หรือกระดานเอ็มเอไอ (mai) ที่ได้รับการคัดเลือกจาก SET ว่ามีความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน (Environmental Social and Governance: ESG)</p> <p>.....</p> <p>.....</p> <p>2. กลยุทธ์การลงทุนเพื่อการบรรลุวัตถุประสงค์ด้านความยั่งยืน</p> <p>⌋ Screening</p> <p>กองทุนใช้กลยุทธ์การลงทุนแบบการคัดกรอง (Screening) สำหรับตราสารทุน โดยตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET) พิจารณาคูณสมบัติของบริษัทจดทะเบียนที่มีสิทธิเข้าร่วมการประเมินความยั่งยืนตามเกณฑ์คัดกรองเบื้องต้น แบบ Negative Screening ในขณะที่ตราสารหนี้ กองทุนจะใช้กลยุทธ์การลงทุนแบบ Positive Screening โดยคำนึงถึงปัจจัยด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน (Environmental, Social and Governance หรือ ESG) ประกอบกับการประเมินด้านปริมาณและด้านคุณภาพของผู้ออกหลักทรัพย์</p>	<p>- การลงทุนในตราสารทุน ได้แก่ หุ้นที่เป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET) บนกระดานหลัก หรือกระดานเอ็มเอไอ (mai) ที่ได้รับการประเมินจาก Morningstar Sustainalytics ว่ามีความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน (Environmental Social and Governance: ESG)</p> <p>.....</p> <p>.....</p> <p>2. กลยุทธ์การลงทุนเพื่อการบรรลุวัตถุประสงค์ด้านความยั่งยืน</p> <p>⌋ Screening</p> <p>กองทุนใช้กลยุทธ์การลงทุนแบบการคัดกรอง (Screening) สำหรับตราสารทุนโดยผู้จัดทำดัชนีพิจารณาคูณสมบัติของบริษัทจดทะเบียนที่มีสิทธิเข้าร่วมการประเมินความยั่งยืนตามเกณฑ์คัดกรองเบื้องต้น แบบ Negative Screening ในขณะที่ตราสารหนี้ กองทุนจะใช้กลยุทธ์การลงทุนแบบ Positive Screening โดยคำนึงถึงปัจจัยด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน (Environmental, Social and Governance หรือ ESG) ประกอบกับการประเมินด้านปริมาณและด้านคุณภาพของผู้ออกหลักทรัพย์</p>

หัวข้อ	รายละเอียดเดิม	รายละเอียดใหม่
	<p>2.1 หลักเกณฑ์ในการคัดเลือกหลักทรัพย์</p> <ul style="list-style-type: none"> - การลงทุนในตราสารทุน: กองทุนจะใช้กลยุทธ์บริหารกองทุนเชิงรับ (Passive management strategy) เพื่อสร้างผลตอบแทนจากการลงทุนให้ใกล้เคียงกับผลตอบแทนของดัชนีผลตอบแทนรวม SETESG Index (SETESG TRI) โดยตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET) พิจารณาคุณสมบัติของบริษัทจดทะเบียนที่มีสิทธิ์เข้าร่วมการประเมินความยั่งยืนตามเกณฑ์คัดกรองเบื้องต้น แบบ Negative Screening ดังต่อไปนี้ - <u>ไม่เป็นบริษัทที่จดทะเบียนในปีที่มีการประเมินความยั่งยืน ยกเว้นบริษัทจดทะเบียนที่มีการปรับโครงสร้างการถือหุ้นโดยตั้งบริษัทซึ่งประกอบธุรกิจโดยการถือหุ้น (Holding Company) และไม่มีการเปลี่ยนแปลงโครงสร้างทางธุรกิจอย่างมีนัยสำคัญ</u> - <u>ไม่เป็นบริษัทที่เข้าจดทะเบียนกับตลาดหลักทรัพย์ฯ โดยอ้อม (Backdoor Listing) ในปีที่มีการประเมินความยั่งยืน</u> - <u>ไม่เป็นบริษัทที่เข้าข่ายอาจถูกเพิกถอนหลักทรัพย์ หรือไม่เป็นบริษัทที่อยู่ระหว่างการฟื้นฟูกิจการ</u> - <u>ไม่เป็นบริษัทที่อยู่ระหว่างการขอเพิกถอนหลักทรัพย์โดยสมัครใจ</u> - <u>ไม่เป็นบริษัทที่มีการกระจายการถือหุ้น โดยมีจำนวนผู้ถือหุ้นรายย่อยน้อยกว่า 150 ราย หรือถือหุ้นรวมกันต่ำกว่า 15% ของทุนชำระแล้ว</u> - <u>ไม่เป็นบริษัทที่ผู้สอบบัญชีไม่แสดงความเห็นต่อการเงินหรือเห็นว่างบการเงินไม่ถูกต้องในปีที่มีการประเมินความยั่งยืนและปีก่อนหน้า</u> - <u>ไม่เป็นบริษัทที่ถูกหยุดพักการซื้อขายหลักทรัพย์เนื่องจากนำเสนองบการเงินล่าช้ากว่าที่กำหนดในปีที่มีการประเมินความยั่งยืนและปีก่อนหน้า</u> 	<p>2.1 หลักเกณฑ์ในการคัดเลือกหลักทรัพย์</p> <ul style="list-style-type: none"> - การลงทุนในตราสารทุน: กองทุนจะใช้กลยุทธ์บริหารกองทุนเชิงรับ (Passive management strategy) เพื่อสร้างผลตอบแทนจากการลงทุนให้ใกล้เคียงกับผลตอบแทนของดัชนี Morningstar Thailand ex REIT Sustainability 10pct Cap TR THB โดยผู้จัดทำดัชนีพิจารณาคุณสมบัติของบริษัทจดทะเบียนที่มีสิทธิ์เข้าร่วมการประเมินความยั่งยืนตามเกณฑ์คัดกรองเบื้องต้น แบบ Negative Screening ดังต่อไปนี้ <u>ดัชนี Morningstar Thailand ex REIT Sustainability 10pct Cap TR THB ประกอบด้วยหุ้นไทยที่ผ่านการประเมินและคัดกรองด้านสิ่งแวดล้อม สังคม และธรรมาภิบาล (Environmental, Social and Governance: ESG) ตามหลักเกณฑ์ที่ผู้จัดทำดัชนีกำหนด โดยไม่รวมหลักทรัพย์ที่จัดประเภทเป็นกองทรัสต์เพื่อการลงทุนในอสังหาริมทรัพย์ (REITs) และใช้ข้อมูลการประเมินด้านความยั่งยืนจาก Morningstar Sustainalytics</u> ทั้งนี้ หลักทรัพย์ที่ได้รับการคัดเลือกเป็นองค์ประกอบของดัชนีต้องผ่านหลักเกณฑ์การคัดกรองดังต่อไปนี้ - <u>ไม่อยู่ในกลุ่มความเสี่ยงด้าน ESG ระดับรุนแรง (Severe ESG Risk Category)</u> - <u>มีระดับข้อโต้แย้งด้าน ESG ไม่เกินระดับ 3 จากระดับ 1 ถึง 5 (Controversy Rating ≤ 3)</u> - <u>ไม่เป็นหลักทรัพย์ของกิจการที่มีสถานะไม่ปฏิบัติตามหลัก United Nations Global Compact (UNGC Non-Compliant) และ</u>

หัวข้อ	รายละเอียดเดิม	รายละเอียดใหม่
	<p>- การลงทุนในตราสารหนี้: กองทุนจะคัดเลือกตราสารโดยใช้กลยุทธ์การลงทุนแบบการคัดกรองเชิงบวก (Positive Screening) โดยคำนึงถึงปัจจัยดังต่อไปนี้</p> <p>.....</p> <p>.....</p> <p>2.2 กระบวนการวิเคราะห์และคัดเลือกหลักทรัพย์</p> <p>2.2.1 กลยุทธ์การลงทุนที่ใช้</p> <p>บริษัทจัดการมีกระบวนการวิเคราะห์และคัดเลือกหลักทรัพย์ที่มีการดำเนินการและ/หรือมีความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน (Environmental Social and Governance: ESG) เพื่อสร้างผลตอบแทนที่ยั่งยืนในระยะยาวควบคู่ไปกับการช่วยสร้างผลกระทบเชิงบวกและลดผลกระทบเชิงลบต่อสังคมและสิ่งแวดล้อม ดังนี้</p>	<p>- ผ่านเกณฑ์การคัดกรองการมีส่วนเกี่ยวข้องในกิจกรรมทางธุรกิจ (Business Involvement Screening) ตามที่ผู้จัดทำดัชนีกำหนด</p> <p><u>เกณฑ์ดังกล่าวมีวัตถุประสงค์เพื่อคัดออกหลักทรัพย์ที่มีความเสี่ยงด้าน ESG ซึ่งกิจการยังไม่ได้บริหารจัดการในระดับรุนแรง มีข้อโต้แย้งด้าน ESG สูงกว่าเกณฑ์ที่กำหนด ไม่ปฏิบัติตามหลัก UNGC หรือมีส่วนเกี่ยวข้องในกิจกรรมทางธุรกิจที่ไม่เป็นไปตามหลักเกณฑ์ของผู้จัดทำดัชนี</u></p> <p>- การลงทุนในตราสารหนี้ : กองทุนจะคัดเลือกตราสารโดยใช้กลยุทธ์การลงทุนแบบการคัดกรองเชิงบวก (Positive Screening) โดยคำนึงถึงปัจจัยดังต่อไปนี้</p> <p>.....</p> <p>.....</p> <p>2.2 กระบวนการวิเคราะห์และคัดเลือกหลักทรัพย์</p> <p>2.2.1 กลยุทธ์การลงทุนที่ใช้</p> <p>บริษัทจัดการมีกระบวนการวิเคราะห์และคัดเลือกหลักทรัพย์ที่มีการดำเนินการและ/หรือมีความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน (Environmental Social and Governance: ESG) เพื่อสร้างผลตอบแทนที่ยั่งยืนในระยะยาวควบคู่ไปกับการช่วยสร้างผลกระทบเชิงบวกและลดผลกระทบเชิงลบต่อสังคมและสิ่งแวดล้อม ดังนี้</p>

หัวข้อ	รายละเอียดเดิม	รายละเอียดใหม่
	<p>- ส่วนตราสารทุน: บริษัทจัดการมีกระบวนการวิเคราะห์และคัดเลือกหลักทรัพย์ตามหุ้นที่เป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET) บนกระดานหลัก หรือ กระดานเอ็มเอไอ (mai) ที่ได้รับการคัดเลือกจาก SET ว่ามีความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อม(Environment) หรือด้านความยั่งยืน (Environmental Social and Governance: ESG) ในสัดส่วนที่เท่าหรือใกล้เคียงกับน้ำหนักที่เป็นส่วนประกอบของดัชนีผลตอบแทนรวม SETESG Index (SETESG TRI) โดยจัดโครงสร้างของพอร์ตการลงทุนให้เหมือนหรือใกล้เคียงกับโครงสร้างของ SETESG TRI ให้มากที่สุด โดยวิเคราะห์การคัดเลือกและสัดส่วนการลงทุนในหลักทรัพย์ตามปัจจัยการซื้อ/ขายใน SET เช่น สภาพคล่อง ปริมาณการซื้อขายใน SET จำนวนหุ้นที่ถือโดยผู้ถือหุ้นรายย่อย มูลค่าการลงทุนขั้นต่ำ ผลกระทบต่อราคาหลักทรัพย์เปรียบเทียบกับปริมาณการซื้อขายของกองทุน เป็นต้น ทั้งนี้ เนื่องจากกองทุนเป็นกองทุนเปิดที่มีเงินเข้าและออกจากกองทุนได้ตลอดเวลา บริษัทจัดการจะมีการใช้โปรแกรมบริหารจัดการกองทุนเพื่อช่วยให้ผู้จัดการกองทุนสามารถปรับน้ำหนักการลงทุนในหลักทรัพย์ และคัดเลือกหลักทรัพย์ที่จะซื้อหรือขายให้สอดคล้องกับดัชนีผลตอบแทนรวม SETESG Index (SETESG TRI) และอาจทำให้ไม่จำเป็นต้องซื้อหรือขายหลักทรัพย์ทุกหลักทรัพย์ที่อยู่ในดัชนีผลตอบแทนรวม SETESG Index (SETESG TRI) เมื่อทำการปรับพอร์ตลงทุน ทั้งนี้ผู้จัดการกองทุนจะปรับพอร์ตการลงทุน หรือ rebalancing ตามรอบประกาศการเปลี่ยนแปลงของหลักทรัพย์ และน้ำหนักที่เป็นองค์ประกอบของดัชนีเพื่อลดความแตกต่างของผลตอบแทนของดัชนีและของกองทุน (Tracking error)</p>	<p>- ส่วนตราสารทุน : บริษัทจัดการมีกระบวนการวิเคราะห์และคัดเลือกหลักทรัพย์ตามหุ้นที่เป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET) บนกระดานหลัก หรือ กระดานเอ็มเอไอ (mai) ที่ได้รับการประเมินจาก Morningstar Sustainalytics ว่ามีความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน (Environmental Social and Governance: ESG) ในสัดส่วนที่เท่าหรือใกล้เคียงกับน้ำหนักที่เป็นส่วนประกอบของดัชนี Morningstar Thailand ex REIT Sustainability 10pct Cap TR THB โดยจัดโครงสร้างของพอร์ตการลงทุนให้เหมือนหรือใกล้เคียงกับโครงสร้างของดัชนีดังกล่าวให้มากที่สุด โดยวิเคราะห์การคัดเลือกและสัดส่วนการลงทุนในหลักทรัพย์ตามปัจจัยการซื้อ/ขายใน SET เช่น สภาพคล่อง ปริมาณการซื้อขายใน SET จำนวนหุ้นที่ถือโดยผู้ถือหุ้นรายย่อย มูลค่าการลงทุนขั้นต่ำ ผลกระทบต่อราคาหลักทรัพย์เปรียบเทียบกับปริมาณการซื้อขายของกองทุน เป็นต้น ทั้งนี้ เนื่องจากกองทุนเป็นกองทุนเปิดที่มีเงินเข้าและออกจากกองทุนได้ตลอดเวลา บริษัทจัดการจะมีการใช้โปรแกรมบริหารจัดการกองทุนเพื่อช่วยให้ผู้จัดการกองทุนสามารถปรับน้ำหนักการลงทุนในหลักทรัพย์และคัดเลือกหลักทรัพย์ที่จะซื้อหรือขายให้สอดคล้องกับดัชนี Morningstar Thailand ex REIT Sustainability 10pct Cap TR THB และอาจทำให้ไม่จำเป็นต้องซื้อหรือขายหลักทรัพย์ทุกหลักทรัพย์ที่อยู่ในดัชนี Morningstar Thailand ex REIT Sustainability 10pct Cap TR THB เมื่อทำการปรับพอร์ตลงทุน ทั้งนี้ผู้จัดการกองทุนจะปรับพอร์ตการลงทุน หรือ rebalancing ตามรอบประกาศการเปลี่ยนแปลงของหลักทรัพย์ และน้ำหนักที่เป็นองค์ประกอบของดัชนีเพื่อลดความแตกต่างของผลตอบแทนของดัชนีและของกองทุน (Tracking error)</p>

หัวข้อ	รายละเอียดเดิม	รายละเอียดใหม่
	<p><u>ดัชนีผลตอบแทนรวม SETESG Index (SETESG TRI) ประกอบด้วยบริษัทจดทะเบียนที่ได้รับการประเมิน SET ESG Ratings ตามกระบวนการที่จัดทำโดยตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (ตลาดหลักทรัพย์ฯ) ตามรูปประกอบนี้</u></p>  <p><u>แบบประเมินความยั่งยืนจากคำถามในมิติ ด้านสิ่งแวดล้อม สังคม และธรรมาภิบาล (Environmental, Social and Governance: ESG)</u></p> <ul style="list-style-type: none"> <u>• แบ่งเป็นมิติบรรษัทภิบาลและเศรษฐกิจ สิ่งแวดล้อม และสังคม</u> <u>• ข้อคำถาม ประกอบด้วย</u> <ul style="list-style-type: none"> <u>- General Questions สำหรับทุกบริษัทจดทะเบียน</u> <u>- Industry Specific Questions ตามกลุ่มอุตสาหกรรม เพื่อพัฒนาการดำเนินงานอย่างยั่งยืนได้ตรงตามลักษณะของธุรกิจได้อย่างชัดเจนตัวอย่างลักษณะคำถาม</u> <u>• ครอบคลุมกลุ่มผู้มีส่วนได้เสียของธุรกิจ เช่น คู่ค้า ลูกค้า พนักงาน สังคม/ชุมชน เป็นต้น</u> <u>• ESG ในกระบวนการดำเนินธุรกิจ (ESG in practices) เช่น</u> <ul style="list-style-type: none"> <u>- ความเสี่ยงด้าน ESG ของทั้งบริษัทและคู่ค้า</u> <u>- การจัดการห่วงโซ่อุปทาน</u> 	<p><u>สำหรับการคัดเลือกหลักทรัพย์เป็นองค์ประกอบของดัชนี Morningstar Thailand ex REIT Sustainability 10pct Cap TR THB โดยผู้จัดทำดัชนีใช้ข้อมูลและปัจจัยด้านความยั่งยืนตามหลักเกณฑ์ดังต่อไปนี้</u></p> <p>1. การพิจารณาข้อมูล ESG Risk Rating</p> <p><u>Morningstar Sustainalytics ประเมินและจัดทำ ESG Risk Ratings เพื่อวัดระดับความเสี่ยงที่มูลค่ากิจการ (Enterprise Value) อาจได้รับผลกระทบจากปัจจัยด้านสิ่งแวดล้อม สังคม และธรรมาภิบาล โดยมุ่งประเมินความเสี่ยงด้าน ESG ที่กิจการยังไม่ได้บริหารจัดการ (Unmanaged ESG Risk) จากมุมมองความมีนัยสำคัญทางการเงิน (Financial Materiality) และพิจารณาประเด็น ESG ที่มีนัยสำคัญต่อกิจการ (Material ESG Issues: MEIs) ผ่าน 2 มิติหลัก ได้แก่ ระดับการเผชิญความเสี่ยงด้าน ESG (Exposure) และความสามารถของกิจการในการบริหารจัดการความเสี่ยงดังกล่าว (Management) ซึ่งเป็นระดับความเสี่ยงตามระดับผลการประเมินความเสี่ยงด้าน ESG (ESG Risk Category) ซึ่งแบ่งออกเป็น 5 ระดับ ได้แก่</u></p> <ol style="list-style-type: none"> <u>1. ความเสี่ยงต่ำมาก (Negligible)</u> <u>2. ความเสี่ยงต่ำ (Low)</u> <u>3. ความเสี่ยงปานกลาง (Medium)</u> <u>4. ความเสี่ยงสูง (High)</u> <u>5. ความเสี่ยงรุนแรง (Severe)</u> <p><u>โดยคัดออกหลักทรัพย์ที่อยู่ในกลุ่มความเสี่ยงด้าน ESG ระดับรุนแรง (Severe ESG Risk Category)</u></p>

หัวข้อ	รายละเอียดเดิม	รายละเอียดใหม่
	<p>- การดำเนินงานเพื่อลดการใช้ไฟฟ้า/พลังงาน ลดการใช้น้ำ และการจัดการของเสียอย่างมีประสิทธิภาพ</p> <p>• คำนึงถึงผลประโยชน์ต่อสิ่งแวดล้อมหรือสังคม นอกเหนือจากผลตอบแทนทางเศรษฐกิจของธุรกิจ เช่น- การสร้างสรรค์นวัตกรรมทำธุรกิจ</p> <p>- การพัฒนาศักยภาพของพนักงาน</p> <p>- การพัฒนาชุมชน/สังคม ผ่านกระบวนการทำธุรกิจ</p> <p>• ให้ความสำคัญประเด็น ESG ที่เป็นความเสี่ยงสำคัญของธุรกิจ เช่น</p> <p>- Climate Risk ได้แก่ มาตรการหรือนโยบายในการชะลอหรือลดการปล่อยก๊าซเรือนกระจก ซึ่งเป็นที่มาของภาวะโลกร้อน (Climate Change Mitigation) การปรับตัวของบริษัทจดทะเบียน ให้มีความยืดหยุ่นต่อความเสี่ยงด้านการเปลี่ยนแปลงสภาพภูมิอากาศ ซึ่งจะช่วยลดความเสี่ยงด้านความต่อเนื่องในการดำเนินธุรกิจ (Climate Change Adaptation and Resilience)</p> <p>- สิทธิขั้นพื้นฐานในฐานะมนุษย์คนหนึ่งที่มี (Human Rights Risk) ได้แก่ สิทธิในการมีชีวิตและเสรีภาพการแสดงความคิดเห็นและการแสดงออก สิทธิในการทำงานและการศึกษา เป็นต้น</p> <p>หมายเหตุ : เกณฑ์ประเมิน SET ESG Ratings และการคัดเลือกหุ้นเพื่อเป็นองค์ประกอบของดัชนีผลตอบแทนรวม SETESG Index (SETESG TRI) อาจเปลี่ยนแปลงได้ในอนาคต โดยสามารถอ้างอิงได้จากแหล่งข้อมูล SET ESG Ratings: https://setsustainability.com/ESG-ratings</p>	<p>2. การคัดกรองข้อโต้แย้งด้าน ESG</p> <p>คัดเลือกเฉพาะหลักทรัพย์ที่มีระดับข้อโต้แย้งด้าน ESG (Controversy Rating) ไม่เกินระดับ 3 ตามหลักเกณฑ์ที่ผู้จัดทำดัชนีกำหนด โดยการประเมินดังกล่าวพิจารณาข้อโต้แย้งที่เกี่ยวข้องกับปัจจัยด้านสิ่งแวดล้อม สังคม และธรรมาภิบาล เช่น สิทธิมนุษยชน แรงงาน สิ่งแวดล้อม ผลิตภัณฑ์ และธรรมาภิบาล ตามวิธีการประเมินของ Morningstar Sustainalytics ทั้งนี้ ผลการประเมินความเสี่ยงด้าน ESG (ESG Risk Category) แบ่งออกเป็นระดับ 1 ถึงระดับ 5 โดยระดับที่สูงขึ้นสะท้อนถึงข้อโต้แย้งที่มีความรุนแรงหรือผลกระทบสูงขึ้น</p> <p>3. การตรวจสอบการปฏิบัติตามหลัก United Nations Global Compact (UNGC)</p> <p>คัดออกหลักทรัพย์ของกิจการที่มีสถานะไม่ปฏิบัติตามหลัก UNGC (UNGC Non-Compliant) ตามหลักเกณฑ์ที่ผู้จัดทำดัชนีกำหนด โดยครอบคลุมหลักการสากลด้านสิทธิมนุษยชน แรงงาน สิ่งแวดล้อม และการต่อต้านการทุจริต</p> <p>4. การคัดกรองการมีส่วนร่วมเกี่ยวข้องในกิจกรรมทางธุรกิจ (Business Involvement Screening)</p> <p>คัดออกหลักทรัพย์ที่มีส่วนเกี่ยวข้องกับธุรกิจหรือกิจกรรมที่ไม่เป็นไปตามหลักเกณฑ์ด้านความยั่งยืนที่ผู้จัดทำดัชนีกำหนด เช่น ยาสูบ อาวุธต้องห้ามตามหลักสากล และอาวุธขนาดเล็ก เป็นต้น</p>

หัวข้อ	รายละเอียดเดิม	รายละเอียดใหม่
		<p>5. การจัดลำดับและคัดเลือกหลักทรัพย์</p> <p><u>ผู้จัดทำดัชนีจะนำหลักทรัพย์ที่เป็นองค์ประกอบของดัชนีหลัก Morningstar Thailand Index ซึ่งเป็นดัชนีหุ้นไทย มาเป็นกรอบในการคัดเลือก โดยตัดหลักทรัพย์ที่จัดประเภทเป็นกองทรัสต์เพื่อการลงทุนในอสังหาริมทรัพย์ (REITs) ออก เพื่อกำหนดเป็นกรอบหลักทรัพย์ตั้งต้น (Morningstar Thailand ex-REIT) จากนั้นจะนำหลักทรัพย์ที่ผ่านเกณฑ์การคัดกรองตามข้อ 1-4 มาจัดเรียงตามคะแนน ESG Risk Rating จากต่ำไปสูง โดยคะแนนที่ต่ำกว่าสะท้อนความเสี่ยงด้าน ESG ที่กิจการยังไม่ได้บริหารจัดการ (Unmanaged ESG Risk) ที่ต่ำกว่า และคัดเลือกหลักทรัพย์ตามลำดับจนมีมูลค่าหลักทรัพย์ตามราคาตลาดที่ปรับด้วยสัดส่วนการถือครองของผู้ถือหุ้นรายย่อย (Float-adjusted Market Capitalization) รวมกันครอบคลุมจนถึงร้อยละ 50 ของกรอบหลักทรัพย์ตั้งต้นดังกล่าว ทั้งนี้ การคัดเลือกและกำหนดน้ำหนักหลักทรัพย์จะเป็นไปตามหลักเกณฑ์ของผู้จัดทำดัชนี โดยจำกัดน้ำหนักของหลักทรัพย์แต่ละรายไม่เกินร้อยละ 10 เพื่อเป็นองค์ประกอบของดัชนี Morningstar Thailand ex REIT Sustainability 10pct Cap TR THB</u></p> <p><u>ข้อมูลที่ใช้ในการประเมิน ESG Risk Ratings มาจากข้อมูลที่กิจการเปิดเผยต่อสาธารณะ เช่น รายงานประจำปี รายงานความยั่งยืน และเว็บไซต์ของกิจการ ตลอดจนข้อมูลจากหน่วยงานภาครัฐ หน่วยงานกำกับดูแล องค์กรอุตสาหกรรม องค์กรไม่แสวงหากำไร สื่อมวลชน และผู้ให้บริการข้อมูลภายนอก ในกรณีที่ข้อมูลบางรายการไม่มีการเปิดเผยหรือมีไม่เพียงพอ Morningstar Sustainalytics อาจใช้แบบจำลอง ตัวแทนข้อมูล ค่าประมาณ หรือการประเมินเชิงคุณภาพตามหลักเกณฑ์ที่กำหนด ซึ่งอาจส่งผลต่อผลการประเมินของกิจการ</u></p>

หัวข้อ	รายละเอียดเดิม	รายละเอียดใหม่
	<p>- ส่วนของตราสารหนี้ : บริษัทจัดการมีกระบวนการวิเคราะห์และคัดเลือกหลักทรัพย์ โดยใช้ข้อมูลจากแหล่งข้อมูลที่นำเชื่อถือต่างๆ</p> <p>.....</p> <p>.....</p>	<p><u>ทั้งนี้ ผู้จัดทำดัชนีจะทบทวนและคัดเลือกหลักทรัพย์เพื่อเป็นองค์ประกอบของดัชนี (Reconstitution) ทุก 6 เดือน และปรับน้ำหนักหลักทรัพย์ รวมถึงการกำหนดน้ำหนักของหลักทรัพย์แต่ละรายไม่เกินร้อยละ 10 (10% Security Cap) เป็นรายไตรมาส โดยเป็นไปตามหลักเกณฑ์และกำหนดเวลาที่ผู้จัดทำดัชนีกำหนด</u></p> <p><u>หลักเกณฑ์และวิธีการจัดทำดัชนี รวมถึงข้อมูลและวิธีการประเมินด้านความยั่งยืน อาจเปลี่ยนแปลงได้ตามหลักเกณฑ์ของผู้จัดทำดัชนีหรือผู้ให้บริการข้อมูล</u></p> <p><u>ผู้ลงทุนสามารถศึกษาข้อมูลเกี่ยวกับคุณลักษณะ องค์ประกอบ และวิธีการจัดทำดัชนี Morningstar Thailand ex REIT Sustainability 10pct Cap TR THB เพิ่มเติมได้จากเว็บไซต์ของ Morningstar Indexes ที่ https://indexes.morningstar.com และศึกษาข้อมูลด้านความยั่งยืนจาก Morningstar Sustainalytics ได้ที่ www.sustainalytics.com</u></p> <p>- ส่วนของตราสารหนี้ : บริษัทจัดการมีกระบวนการวิเคราะห์และคัดเลือกหลักทรัพย์ โดยใช้ข้อมูลจากแหล่งข้อมูลที่นำเชื่อถือต่างๆ</p> <p>.....</p> <p>.....</p>

หัวข้อ	รายละเอียดเดิม	รายละเอียดใหม่
	<p>2.3 ดัชนีชี้วัด ดัชนีชี้วัดผลการดำเนินงาน (Performance Benchmark) ของกองทุน ได้แก่</p> <p>(1) <u>SETESG Total return Index ร้อยละ 30</u></p> <p>(2) ThaiBMA Government Bond ESG Index Net Total Return ร้อยละ 50</p> <p>(3) ThaiBMA Short-term Government Bond Index Total Return ร้อยละ 20</p> <p>หมายเหตุ :</p> <p>- <u>ดัชนีผลตอบแทนรวม SETESG Index (SETESG TRI) เนื่องจากกองทุนมีวัตถุประสงค์ลงทุนในหุ้นที่เป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET) บนกระดานหลัก หรือกระดานเอ็มเอไอ (mai) ที่ได้รับการคัดเลือกจาก SET ว่ามีความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน (Environmental Social and Governance: ESG) ที่เป็นองค์ประกอบของดัชนีผลตอบแทนรวม SETESG Index (SETESG TRI) ทั้งนี้ ดัชนี SETESG เป็นดัชนีที่มีองค์ประกอบของบริษัทที่มีผลการประเมิน SET ESG Ratings ปีล่าสุดซึ่งจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์และเป็นหลักทรัพย์ที่มีการซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ไม่น้อยกว่า 6 เดือน และมีมูลค่าหลักทรัพย์ตามราคาตลาดไม่น้อยกว่า 5,000 ล้านบาท และมีสัดส่วนผู้ถือหลักทรัพย์รายย่อย (Free-Float) ไม่น้อยกว่าร้อยละ 20 ของทุนจดทะเบียนชำระแล้ว และมีจำนวนหุ้นซื้อขายไม่น้อยกว่าร้อยละ 0.5 ของจำนวนหุ้นจดทะเบียนของบริษัท เป็นเวลาไม่ต่ำกว่า 9 ใน 12 เดือน จึงเป็นดัชนีที่เหมาะสมภายใต้กรอบการลงทุนด้านความยั่งยืน</u></p>	<p>2.3 ดัชนีชี้วัด ดัชนีชี้วัดผลการดำเนินงาน (Performance Benchmark) ของกองทุน ได้แก่</p> <p>(1) <u>ดัชนี Morningstar Thailand ex REIT Sustainability 10pct Cap TR THB ร้อยละ 30</u></p> <p>(2) ThaiBMA Government Bond ESG Index Net Total Return ร้อยละ 50</p> <p>(3) ThaiBMA Short-term Government Bond Index Total Return ร้อยละ 20</p> <p>หมายเหตุ :</p> <p>- <u>ดัชนี Morningstar Thailand ex REIT Sustainability 10pct Cap TR THB เนื่องจากเป็นดัชนีอ้างอิงที่สอดคล้องกับนโยบายการลงทุนและวัตถุประสงค์ด้านความยั่งยืนของกองทุน ซึ่งมุ่งส่งเสริมการลงทุนในกิจการที่มีคุณลักษณะด้านสิ่งแวดล้อม สังคม และธรรมาภิบาล (Environmental, Social and Governance: ESG) ตามหลักเกณฑ์ที่ผู้จัดทำดัชนีกำหนด โดยใช้กลยุทธ์การบริหารกองทุนเชิงรับ (Passive Management Strategy) เพื่อสร้างผลตอบแทนให้ใกล้เคียงกับดัชนีดังกล่าว</u></p> <p><u>ดัชนี Morningstar Thailand ex REIT Sustainability 10pct Cap TR THB จัดทำโดย Morningstar, Inc. ภายใต้ธุรกิจ Morningstar Indexes และใช้ข้อมูลการประเมินด้านความยั่งยืนจาก Morningstar Sustainalytics ซึ่งไม่เกินระดับความเสี่ยงสูง (High) เพื่อคัดเลือกหลักทรัพย์ที่มีคุณลักษณะด้านความยั่งยืน รวมถึงหลักเกณฑ์อื่นตามผู้จัดทำดัชนีกำหนด เพื่อให้ดัชนีสะท้อนคุณลักษณะด้านความยั่งยืนของกิจการที่เป็นองค์ประกอบของดัชนีอย่างเหมาะสม</u></p>

หัวข้อ	รายละเอียดเดิม	รายละเอียดใหม่
	<p>ยื่นของกองทุน อีกทั้งบริษัทที่เป็นองค์ประกอบของดัชนี SETESG เป็น บริษัทที่มีสภาพคล่องตามหลักเกณฑ์ที่ SET กำหนด และมีการเปิดเผยข้อมูลเพื่อนำไปใช้ในการวิเคราะห์ได้อย่างเพียงพอ</p> <p>ผู้ลงทุนสามารถศึกษาคุณลักษณะและองค์ประกอบของดัชนี รวมถึงวิธีการจัดทำดัชนีดังกล่าวได้ที่ https://www.set.or.th/th/market/index/setesg/profile</p> <p>- ดัชนี ThaiBMA Government Bond ESG Index Net Total Return</p> <p>.....</p> <p>.....</p> <p>2.4 ข้อจำกัดด้านการลงทุน :</p> <p>เนื่องจากกรอบการลงทุนของกองทุนจะเน้นการลงทุนใน</p> <p>(1) หุ้นที่เป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET) บนกระดานหลัก หรือกระดานเอ็มเอไอ (mai) ที่ได้รับการคัดเลือกจาก SET ว่าเป็นความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน (Environmental Social and Governance: ESG) ในสัดส่วนที่เท่าหรือใกล้เคียงกับน้ำหนักที่เป็นส่วนประกอบของดัชนีผลตอบแทนรวม SETESG Index (SETESG TRI) เพื่อสร้างผลตอบแทนให้ใกล้เคียงกับดัชนีดังกล่าว</p> <p>.....</p> <p>.....</p>	<p>ผู้ลงทุนสามารถศึกษาข้อมูลเกี่ยวกับคุณลักษณะ องค์ประกอบ และวิธีการจัดทำดัชนี Morningstar Thailand ex REIT Sustainability 10pct Cap TR THB เพิ่มเติมได้จากเว็บไซต์ของ Morningstar Indexes ที่ https://indexes.morningstar.com และศึกษาข้อมูลด้านความยั่งยืนจาก Morningstar Sustainalytics ได้ที่ www.sustainalytics.com</p> <p>- ดัชนี ThaiBMA Government Bond ESG Index Net Total Return</p> <p>.....</p> <p>.....</p> <p>2.4 ข้อจำกัดด้านการลงทุน :</p> <p>เนื่องจากกรอบการลงทุนของกองทุนจะเน้นการลงทุนใน</p> <p>(1) หุ้นที่เป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET) บนกระดานหลักหรือตลาดหลักทรัพย์ เอ็ม เอ ไอ (mai) ที่ได้รับการประเมินจาก Morningstar Sustainalytics ว่าเป็นความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน (Environmental Social and Governance: ESG) ในสัดส่วนที่เท่าหรือใกล้เคียงกับน้ำหนักที่เป็นส่วนประกอบของดัชนี Morningstar Thailand ex REIT Sustainability 10pct Cap TR THB เพื่อสร้างผลตอบแทนให้ใกล้เคียงกับดัชนีดังกล่าว</p> <p>.....</p> <p>.....</p>

หัวข้อ	รายละเอียดเดิม	รายละเอียดใหม่
	<p>3.1 ความเสี่ยงจากปัจจัยด้านความยั่งยืนต่อการลงทุน (Sustainability Risk) สำหรับตราสารทุน</p> <p>กองทุนลงทุนในหลักทรัพย์ที่มีคุณลักษณะด้านความยั่งยืนตามกรอบการลงทุน และหลักเกณฑ์การคัดเลือกที่กองทุนกำหนด ซึ่งอ้างอิงข้อมูลการประเมินด้านความยั่งยืนจากตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย อย่างไรก็ตามเหตุการณ์หรือปัจจัยด้านสิ่งแวดล้อม สังคม หรือธรรมาภิบาล (ESG) ที่เกิดขึ้นกับกิจการที่กองทุนลงทุน อาจส่งผลกระทบต่อฐานะทางการเงิน ความสามารถในการดำเนินธุรกิจ มูลค่าหลักทรัพย์ และผลตอบแทนของกองทุนได้</p> <p>นอกจากนี้ การเปลี่ยนแปลงของข้อมูลด้านความยั่งยืน การประเมินความเสี่ยงด้าน ESG (ESG Risk Rating) หรือการเปลี่ยนแปลงองค์ประกอบและหลักเกณฑ์การคัดเลือกของดัชนีผลตอบแทนรวม SETESG Index (SETESG TRI) อาจส่งผลให้หลักทรัพย์บางรายการถูกปรับน้ำหนัก ถูกคัดออกจากดัชนี หรือส่งผลกระทบต่อผลการดำเนินงานของกองทุนได้</p> <p>.....</p> <p>.....</p>	<p>3.1 ความเสี่ยงจากปัจจัยด้านความยั่งยืนต่อการลงทุน (Sustainability Risk) สำหรับตราสารทุน</p> <p>กองทุนลงทุนในหลักทรัพย์ที่มีคุณลักษณะด้านความยั่งยืนตามกรอบการลงทุนและหลักเกณฑ์การคัดเลือกที่กองทุนกำหนด ซึ่งอ้างอิงข้อมูลการประเมินด้านความยั่งยืนจาก <u>Morningstar Sustainalytics</u> อย่างไรก็ตามเหตุการณ์หรือปัจจัยด้านสิ่งแวดล้อม สังคม หรือธรรมาภิบาล (ESG) ที่เกิดขึ้นกับกิจการที่กองทุนลงทุน อาจส่งผลกระทบต่อฐานะทางการเงิน ความสามารถในการดำเนินธุรกิจ มูลค่าหลักทรัพย์ และผลตอบแทนของกองทุนได้</p> <p>นอกจากนี้ การเปลี่ยนแปลงของข้อมูลด้านความยั่งยืน การประเมินความเสี่ยงด้าน ESG (ESG Risk Rating) หรือการเปลี่ยนแปลงองค์ประกอบและหลักเกณฑ์การคัดเลือกของดัชนี <u>Morningstar Thailand ex REIT Sustainability 10pct Cap TR THB</u> อาจส่งผลให้หลักทรัพย์บางรายการถูกปรับน้ำหนัก ถูกคัดออกจากดัชนี หรือส่งผลกระทบต่อผลการดำเนินงานของกองทุนได้</p> <p>.....</p> <p>.....</p>

หัวข้อ	รายละเอียดเดิม	รายละเอียดใหม่
	<p>3.2 ความเสี่ยงจากการลงทุนต่อปัจจัยด้านความยั่งยืน (Sustainability Impact Risk)</p> <p><u>สำหรับตราสารทุน</u></p> <p>แม้ว่ากองทุนจะบริหารจัดการลงทุนตามการคัดเลือกหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินด้านความยั่งยืนตามหลักเกณฑ์ของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย โดยคำนึงถึงปัจจัยด้านความยั่งยืน แต่กองทุนอาจไม่สามารถบรรลุผลลัพธ์ด้านความยั่งยืนตามที่คาดหวังได้ทั้งหมดหรือบางส่วน โดยอาจเกิดจากปัจจัยต่าง ๆ ดังต่อไปนี้</p> <ul style="list-style-type: none"> - <u>ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยไม่จัดทำหรือเปิดเผยข้อมูลดัชนีผลตอบแทนรวม SETESG Index (SETESG TRI) อีกต่อไป</u> - การลงทุนแบบกระจุกตัวในหลักทรัพย์ที่เกี่ยวข้องกับความยั่งยืน เนื่องจากข้อจำกัดด้านการถือครองหุ้น ทำให้กองทุนไม่สามารถลงทุนในบางหลักทรัพย์ได้ - ไม่สามารถซื้อหรือขายหลักทรัพย์บางตัวได้ในราคาหรือช่วงเวลาที่ต้องการซื้อขายกับองค์ประกอบของดัชนีผลตอบแทนรวม SETESG Index (SETESG TRI) ด้วยเงื่อนไขด้านสภาพคล่องของหุ้น หรือข้อจำกัดด้านการซื้อ/ขายอื่น ๆ - ผู้ออกหลักทรัพย์หรือผู้ออกตราสารอาจไม่สามารถดำเนินการตามเป้าหมายแผนงาน หรือคำมั่นด้านความยั่งยืนที่ได้เปิดเผยไว้ <p>.....</p> <p>.....</p>	<p>3.2 ความเสี่ยงจากการลงทุนต่อปัจจัยด้านความยั่งยืน (Sustainability Impact Risk)</p> <p><u>สำหรับตราสารทุน</u></p> <p>แม้ว่ากองทุนจะบริหารจัดการลงทุนตามการคัดเลือกหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินด้านความยั่งยืนตามผู้จัดทำดัชนีและอ้างอิงข้อมูลการประเมินด้านความยั่งยืนจาก <u>Morningstar Sustainalytics</u> โดยคำนึงถึงปัจจัยด้านความยั่งยืน แต่กองทุนอาจไม่สามารถบรรลุผลลัพธ์ด้านความยั่งยืนตามที่คาดหวังได้ทั้งหมดหรือบางส่วน โดยอาจเกิดจากปัจจัยต่าง ๆ ดังต่อไปนี้</p> <ul style="list-style-type: none"> - <u>ผู้จัดทำดัชนียุติการจัดทำหรือเผยแพร่ดัชนีอ้างอิง หรือ Morningstar Sustainalytics ยุติหรือเปลี่ยนแปลงการให้บริการข้อมูลด้านความยั่งยืน</u> - การลงทุนแบบกระจุกตัวในหลักทรัพย์ที่เกี่ยวข้องกับความยั่งยืน เนื่องจากข้อจำกัดด้านการถือครองหุ้น ทำให้กองทุนไม่สามารถลงทุนในบางหลักทรัพย์ได้ - ไม่สามารถซื้อหรือขายหลักทรัพย์บางตัวได้ในราคาหรือช่วงเวลาที่ต้องการซื้อขายกับองค์ประกอบของดัชนี <u>Morningstar Thailand ex REIT Sustainability 10pct Cap TR THB</u> ด้วยเงื่อนไขด้านสภาพคล่องของหุ้น หรือข้อจำกัดด้านการซื้อ/ขายอื่น ๆ - ผู้ออกหลักทรัพย์หรือผู้ออกตราสารอาจไม่สามารถดำเนินการตามเป้าหมายแผนงาน หรือคำมั่นด้านความยั่งยืนที่ได้เปิดเผยไว้ <p>.....</p> <p>.....</p>