

กองทุนเปิดบีแคป เซ็ท ไทยเพื่อความยั่งยืนแบบพิเศษ (BCAPSETTHAIESGX)

ประเภทกองทุนรวม/ กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมตราสารทุน / กองทุนรวมดัชนี (Index Fund) / กองทุนรวมไทยเพื่อความยั่งยืนแบบพิเศษ / กองทุนรวมเพื่อความยั่งยืน (SRI Fund) / กองทุนรวมที่ลงทุนแบบไม่มีความเสี่ยงต่างประเทศ
- กลุ่มกองทุน : Equity General

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- กองทุนลงทุนในตราสารทุน โดยมีนโยบายลงทุนในหลักทรัพย์ที่เป็นส่วนประกอบของดัชนีอ้างอิง (SET ESG Total Return Index) ซึ่งเป็นหลักทรัพย์ที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย และ/หรือตลาดหลักทรัพย์เอ็ม เอ ไอ ที่มีลักษณะดังนี้ และมี net exposure ในทรัพย์สินที่ลงทุนดังกล่าว โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของ NAV 1.หุ้นของบริษัทที่ได้รับการคัดเลือกจากตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยว่ามีความโดดเด่นด้านความสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน (Environmental, Social and Governance หรือ ESG) และ/หรือ 2.หุ้นของบริษัทที่มีการเปิดเผยข้อมูลเกี่ยวกับการปล่อยก๊าซเรือนกระจก แผนการจัดการ และการตั้งเป้าหมายเพื่อให้บรรลุเป้าหมายในการลดปริมาณก๊าซเรือนกระจกของประเทศไทย และ/หรือ 3.หุ้นของบริษัทที่มีธรรมาภิบาล (Governance) ที่มีลักษณะเป็นไปตามประกาศ โดยกองทุนจะใช้กลยุทธ์การบริหารกองทุนเชิงรับ (Passive Management Strategy) ซึ่งพิจารณาเลือกใช้กลยุทธ์แบบ Optimization เพื่อให้กองทุนสามารถสร้างผลตอบแทนที่ใกล้เคียงกับดัชนี SET ESG Total Return Index
- กองทุนอาจจะลงทุนในธุรกรรมการให้ยืมหลักทรัพย์ (securities lending) หรือธุรกรรมการซื้อโดยมีสัญญาขายคืน (Reverse Repo) หรือลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) เพื่อเพิ่มประสิทธิภาพในการลงทุน (Efficient Portfolio Management)
- กองทุนจะไม่ลงทุนในตราสารหนี้ที่มีอันดับความน่าเชื่อถือต่ำกว่าที่สามารถลงทุนได้ (Non-Investment Grade) ตราสารหนี้ที่ไม่ได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือ (Unrated Securities) หลักทรัพย์ของบริษัทที่ไม่ได้จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ (Unlisted Securities) และตราสารที่มีลักษณะของสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแฝง (Structured Note)
- กลยุทธ์การลงทุน มุ่งหวังให้ผลประกอบการเคลื่อนไหวตามดัชนีชี้วัด (passive management / index tracking) โดยจะพยายามดำรงค่า tracking error ไม่เกิน 3.00% ต่อปี

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (% ต่อปี)

กองทุนยังไม่ได้จดทะเบียนจัดตั้งเป็นกองทุนรวม จึงยังไม่มีข้อมูล

ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด (%ต่อปี)

กองทุนยังไม่ได้จดทะเบียนจัดตั้งเป็นกองทุนรวม จึงยังไม่มีข้อมูล

ระดับความเสี่ยง

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

เสี่ยงสูง

ลงทุนในตราสารทุนเป็นหลักโดยเฉลี่ยในรอบปีไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน 09 พฤษภาคม 2568

นโยบายการจ่ายเงินปันผล ไม่จ่าย

อายุกองทุน ไม่กำหนด

ผู้จัดการกองทุน

นายเมธี เมฆอรุณเรือง (ตั้งแต่วันที่ 09 พ.ค. 2568)

ดัชนีชี้วัด

SET ESG Total Return Index 100.00% ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน

วัตถุประสงค์การอ้างอิง เพื่อใช้เปรียบเทียบผลการดำเนินงานของกองทุนรวม

คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวมมิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต : ได้รับการรับรอง หนังสือชี้ชวนฉบับจาก CAC

ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือ บริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่อง ได้ที่หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



www.bcaph.co.th

การซื้อขายหน่วยลงทุน

วันทำการซื้อ : วันทำการซื้อ **ช่วง** IPO : วันที่ 2 – 8 พฤษภาคม 2568 (วันที่ 8 พฤษภาคม 2568 ไม่รับชำระด้วยเช็ค)
- ผู้สนับสนุนการขาย หรือรับซื้อคืน : 8.30 น. – 15.30 น.*
- โบนัสแบ่งกึ่งจาก ธนาคารกรุงเทพ : 8.30 น. – 16.00 น.

วันทำการซื้อ **หลัง** IPO : วันที่ 13 พ.ค. – 30 มิ.ย. 2568 เท่านั้น
- ผู้สนับสนุนการขาย หรือรับซื้อคืน : 8.30 น. – 15.30 น.*
- โบนัสแบ่งกึ่งจาก ธนาคารกรุงเทพ : ทุกวันตลอด 24 ชม.***

มูลค่าขั้นต่ำในการซื้อครั้งแรก : 500 บาท
มูลค่าขั้นต่ำในการซื้อครั้งถัดไป : 500 บาท

*ทั้งนี้ขึ้นอยู่กับผู้สนับสนุนการขายหรือรับซื้อคืนแต่ละราย
** ส่วนปี 2569 ทางบริษัทจัดการจะแจ้งให้ทราบผ่านทางเว็บไซต์ของบริษัทจัดการ หรือผ่านช่องทางอื่นใดตามความเหมาะสม
***การส่งคำสั่งซื้อขายหน่วยลงทุนหลังจากเวลา 16.00 น. เป็นต้นไป หรือในวันหยุดทำการซื้อขาย จะถือว่าเป็นรายการของวันทำการซื้อขายถัดไป สำหรับรายการสับเปลี่ยนจากกองทุน LTF มากองทุนนี้ สามารถทำรายการได้ตั้งแต่วันที่ 13 พ.ค. 2568 จนถึงเวลา 16.00 น. ของวันที่ 30 มิ.ย. 2568

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุน (% ต่อปีของ NAV)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	0.80%	0.642%
รวมค่าใช้จ่าย	2.14%	0.73295%
หมายเหตุ		
- ค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายข้างต้นได้รวมภาษีมูลค่าเพิ่มและภาษีอื่นใดในทำนองเดียวกันแล้ว (ถ้ามี)		
- เนื่องจากกองทุนจัดตั้ง/เปิดให้บริการหน่วยลงทุนยังไม่ครบรอบระยะเวลาบัญชีของกองทุน ดังนั้น หัวข้อ “รวมค่าใช้จ่าย” จะแสดงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงจากกองทุน (%ต่อปี) คือ ค่าธรรมเนียมการจัดการ ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ ค่าธรรมเนียมนายทะเบียนหน่วยลงทุน โดยอัตราที่แสดงยังไม่รวมค่าใช้จ่ายอื่นๆ (%ต่อปี) (ค่าใช้จ่ายอื่น (%ต่อปี) จะแสดงในรายงานรอบระยะเวลาบัญชี		

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วยลงทุน (% ต่อมูลค่าซื้อขาย)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การขาย	1.07%	ปัจจุบันไม่เรียกเก็บ
การรับซื้อคืน		
- ถือครองน้อยกว่าหรือเท่ากับ 1 ปี	ไม่เกิน 1.00% (ขั้นต่ำ 50 บาท)	ไม่เกิน 1.00% (ขั้นต่ำ 50 บาท)
- ถือครองมากกว่า 1 ปี	50 บาทต่อรายการ	50 บาทต่อรายการ
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า		
- ภายใต้การจัดการของบริษัทจัดการ	ไม่เรียกเก็บ	ไม่เรียกเก็บ
- ภายใต้การจัดการของบริษัทจัดการอื่น	อัตราเดียวกับค่าธรรมเนียมการขาย	ไม่เรียกเก็บ
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก		
- ภายใต้การจัดการของบริษัทจัดการ	ไม่เรียกเก็บ	ไม่เรียกเก็บ
- ภายใต้การจัดการของบริษัทจัดการอื่น	ไม่เกิน 200 บาทต่อรายการ	ไม่เกิน 200 บาทต่อรายการ
การโอน	ไม่มี	ไม่มี

หมายเหตุ
- ค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายข้างต้นได้รวมภาษีมูลค่าเพิ่มและภาษีอื่นใดในทำนองเดียวกันแล้ว (ถ้ามี)
- บริษัทจัดการอาจเรียกเก็บค่าธรรมเนียมการขายและรับซื้อคืนจากผู้ลงทุนแต่ละกลุ่มในอัตราที่ไม่เท่ากันได้ สามารถดูรายละเอียดเพิ่มเติมได้ที่ข้อมูลอื่นๆ
- ค่าธรรมเนียมการสับเปลี่ยนหน่วยลงทุน สามารถดูรายละเอียดเพิ่มเติมได้ที่ข้อมูลอื่นๆ
- ก่อนเปิดให้บริการสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนระหว่างบลจ. บริษัทจัดการจะแจ้งให้ผู้ถือหน่วยลงทุนทราบล่วงหน้าอย่างน้อย 7 วัน ผ่านทางเว็บไซต์ของบริษัทจัดการที่ www.bcap.co.th หรือผ่านช่องทางอื่นใดตามความเหมาะสม ทั้งนี้ สามารถศึกษาข้อมูลเพิ่มเติมได้ที่หนังสือชี้ชวนส่วนข้อมูลกองทุนรวม

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน	ทรัพย์สินที่ลงทุนสูงสุด 5 อันดับแรก	อันดับความน่าเชื่อถือของตราสารหนี้ (%)
% NAV	% NAV	-
กองทุนยังไม่ได้จัดทะเบียนจัดตั้งเป็นกองทุนรวม จึงยังไม่มีข้อมูล	กองทุนยังไม่ได้จัดทะเบียนจัดตั้งเป็นกองทุนรวม จึงยังไม่มีข้อมูล	

ข้อมูลความเสี่ยงเชิงสถิติ

Maximum drawdown	N/A
Recovering Period	N/A
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน	N/A
Sharpe Ratio	N/A
Alpha	N/A
Beta	N/A
Tracking Error	N/A
Tracking Difference	N/A

การจัดสรรการลงทุนในต่างประเทศ

% NAV
-

การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม 5 อันดับแรก

% NAV
กองทุนยังไม่ได้จัดทะเบียนจัดตั้งเป็นกองทุนรวม จึงยังไม่มีข้อมูล

ข้อมูลอื่นๆ

ค่าธรรมเนียมการสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า :

- ระหว่างวันที่ 13 พฤษภาคม – 30 มิถุนายน 2568: สับเปลี่ยนหน่วยลงทุนที่ถือทั้งหมดของกองทุน BCAP-BMSCITH LTF มายังกองทุน BCAPSETTHAIESGX : ยกเว้นไม่เรียกเก็บ
ผู้ถือหน่วยลงทุนสามารถส่งคำสั่งล่วงหน้าได้ทุกวันทำการ โดยบริษัทจัดการจะทำรายการสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนในทุกวันศุกร์ สำหรับการส่งคำสั่งในวันที่ 30 มิถุนายน 2568 บริษัทจัดการจะทำรายการสับเปลี่ยนในวันดังกล่าว
- ระหว่างวันที่ 1 กรกฎาคม – 30 ธันวาคม 2568*
 - ระหว่าง Thai ESGX ภายใต้การบริหารจัดการของบริษัทจัดการ : ไม่เรียกเก็บ
 - ระหว่าง Thai ESGX ภายใต้การจัดการของบริษัทจัดการอื่น** : อัตราเดียวกับค่าธรรมเนียมการขาย (เก็บจริง ไม่เรียกเก็บ)

ค่าธรรมเนียมการสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก :

- ระหว่างวันที่ 13 พฤษภาคม – 30 มิถุนายน 2568 : ไม่เปิดให้บริการ
- ระหว่างวันที่ 1 กรกฎาคม – 30 ธันวาคม 2568*
 - ระหว่าง Thai ESGX ภายใต้การบริหารจัดการของบริษัทจัดการ : ไม่เรียกเก็บ
 - ระหว่าง Thai ESGX ภายใต้การจัดการของบริษัทจัดการอื่น** : ไม่เกิน 200 บาทต่อรายการ (เก็บจริง 200 บาทต่อรายการ)

*ส่วนปี 2569 ทางบริษัทจัดการจะแจ้งให้ทราบผ่านทางเว็บไซต์ของบริษัทจัดการ หรือผ่านช่องทางอื่นใดตามความเหมาะสม

**ก่อนเปิดให้บริการสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนระหว่างบลจ. บริษัทจัดการจะแจ้งให้ผู้ถือหน่วยลงทุนทราบล่วงหน้าอย่างน้อย 7 วัน ผ่านทางเว็บไซต์ของบริษัทจัดการที่ www.bcap.co.th หรือผ่านช่องทางอื่นใดตามความเหมาะสม ทั้งนี้ สามารถศึกษาข้อมูลเพิ่มเติมได้ที่หนังสือชี้ชวนส่วนข้อมูลกองทุนรวม

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย

1 บริษัทจัดการอาจเรียกเก็บค่าธรรมเนียมการขายและค่าธรรมเนียมการรับซื้อคืนหน่วยลงทุนจากผู้ลงทุนแต่ละกลุ่มในอัตราที่ไม่เท่ากัน ดังนี้

1.1 บริษัทจัดการจะยกเว้นค่าธรรมเนียมการขายและค่าธรรมเนียมการรับซื้อคืนหน่วยลงทุนให้กับกองทุนสำรองเลี้ยงชีพและหรือกองทุนส่วนบุคคลและหรือกองทุนรวมภายใต้การจัดการของบริษัทจัดการ

1.2 สำหรับลูกค้าที่ไม่เข้าเกณฑ์ข้อ 1.1 บริษัทจัดการจะเรียกเก็บค่าธรรมเนียมการขายและค่าธรรมเนียมการรับซื้อคืนหน่วยลงทุนในอัตรา 100% ของค่าธรรมเนียมการขายและค่าธรรมเนียมการรับซื้อคืนหน่วยลงทุนที่เรียกเก็บจริง

คำอธิบาย

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

Recovering Period ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาดังแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลานานเท่าใด

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตกองทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลานึง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพ์กับผลรวมของมูลค่าการขายหลักทรัพ์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 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

Tracking Difference (TD) ค่าส่วนต่างระหว่างผลตอบแทนเฉลี่ยของกองทุนรวมและผลตอบแทนของดัชนีอ้างอิงของกองทุน

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน บางกอกแคปปิตอล จำกัด

โทรศัพท์ : 0-2618-1599 website : www.bcap.co.th

ที่อยู่ 191 อาคารสีลมคอมเพล็กซ์ ชั้น 24 ห้องเลขที่ A-C ถนนสีลม แขวงสีลม เขตบางรัก กรุงเทพฯ 10500

ข้อมูลอื่นๆ

ลักษณะที่สำคัญของกองทุน

1. นโยบายการลงทุน

เป็นกองทุนรวมดัชนี (Index Fund) มีนโยบายลงทุนในหลักทรัพย์ที่เป็นส่วนประกอบของดัชนีอ้างอิง (SET ESG Total Return Index) ซึ่งเป็นหลักทรัพย์ที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย และ/หรือตลาดหลักทรัพย์ เอ็ม เอ ไอ ที่มีลักษณะดังนี้ และมี net exposure ในทรัพย์สินที่ลงทุนดังกล่าว โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของ NAV 1.หุ้นของบริษัทที่ได้รับการคัดเลือกจากตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยว่ามีความโดดเด่นด้านความสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน (Environmental, Social and Governance หรือ ESG) และ/หรือ 2.หุ้นของบริษัทที่มีการเปิดเผยข้อมูลเกี่ยวกับการปล่อยก๊าซเรือนกระจก แผนการจัดการ และการตั้งเป้าหมายเพื่อให้บรรลุเป้าหมายในการลดปริมาณก๊าซเรือนกระจกของประเทศไทย และ/หรือ 3.หุ้นของบริษัทที่มีธรรมาภิบาล (Governance) ที่มีลักษณะเป็นไปตามประกาศ ซึ่งพิจารณาเลือกใช้กลยุทธ์แบบ Optimization เพื่อให้กองทุนสามารถสร้างผลตอบแทนที่ใกล้เคียงกับดัชนี SET Total Return Index

1.1 วิถีประสงค์การลงทุนที่เกี่ยวกับความยั่งยืน

กองทุนจะลงทุนในหลักทรัพย์ที่เป็นส่วนประกอบของดัชนีอ้างอิง (SET ESG Total Return Index) ซึ่งเป็นดัชนีที่สะท้อนการเคลื่อนไหวราคาของกลุ่มหลักทรัพย์ของบริษัทที่มีการดำเนินธุรกิจอย่างยั่งยืน ซึ่งพิจารณาจากปัจจัยด้านสิ่งแวดล้อม สังคม และธรรมาภิบาล (Environmental, Social and Governance หรือ ESG) ของบริษัทในการตัดสินใจลงทุนควบคู่ไปกับการวิเคราะห์ข้อมูลทางการเงินของบริษัท เพื่อสร้างผลตอบแทนที่ยั่งยืนให้กับผู้ถือหน่วยลงทุน

1.2 เป้าหมายที่กองทุนรวมต้องการบรรลุ

กองทุนมีนโยบายการลงทุนในหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินข้างต้น เพื่อสร้างผลตอบแทนที่ยั่งยืนให้กับผู้ถือหน่วยลงทุน รวมทั้งเป็นแรงขับเคลื่อนให้มีการมุ่งเน้นการดำเนินงานที่คำนึงถึงปัจจัยด้าน ESG มากขึ้น และเป็นกลไกหนึ่งที่จะช่วยสนับสนุนบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย และ/หรือตลาดหลักทรัพย์ เอ็ม เอ ไอ บรรลุเป้าหมายการพัฒนาที่ยั่งยืน (Sustainable Development Goals : SDGs) ขององค์การสหประชาชาติ

1.3 กรอบการลงทุน (Investment Universe)

กองทุนมีนโยบายลงทุนในหลักทรัพย์ที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย และ/หรือตลาดหลักทรัพย์ เอ็ม เอ ไอ ที่เป็นส่วนประกอบของดัชนี SET ESG Total Return Index เป็นหลัก

2. กลยุทธ์การลงทุน

กองทุนจะใช้กลยุทธ์การลงทุนแบบการคัดกรองเชิงลบ (Negative screening) โดยมีปัจจัยที่พิจารณา ได้แก่ ปัจจัยด้านสิ่งแวดล้อม สังคม และหลักการกำกับดูแลกิจการที่ดี โดยใช้ข้อมูลข่าวสารจากแหล่งข่าวที่เปิดเผยต่อสาธารณะ

2.1 หลักเกณฑ์ในการคัดเลือกหลักทรัพย์

กองทุนใช้กลยุทธ์การบริหารกองทุนเชิงรับ (Passive Management Strategy) โดยมีนโยบายการคัดเลือกหลักทรัพย์จากหลักทรัพย์ที่เป็นส่วนประกอบของดัชนีอ้างอิงคือ SET ESG Total Return Index หรือ ลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) ที่มีสินทรัพย์อ้างอิงเป็นหลักทรัพย์ที่เป็นส่วนประกอบของดัชนีอ้างอิง ซึ่งรวมถึงหลักทรัพย์ที่อยู่ระหว่างการเข้าหรือออกจากการเป็นหลักทรัพย์ที่เป็นส่วนประกอบของดัชนีอ้างอิงด้วย

หลักทรัพย์ที่เป็นส่วนประกอบของ SET ESG Total Return Index นั้น ทางตลาดหลักทรัพย์ฯ ใช้วิธีการ screening โดยพิจารณาคุณสมบัติหลักทรัพย์ดังนี้

1. เป็นหลักทรัพย์ของบริษัทที่มีผลประเมินหุ้นยั่งยืน SET ESG Ratings ชุดล่าสุดที่ตลาดหลักทรัพย์ฯ มีการประกาศให้ทราบโดยทั่วไป
2. เป็นหลักทรัพย์ที่มีมูลค่าหลักทรัพย์ตามราคาตลาด (Market Capitalization) เฉลี่ยอย่างน้อย 5,000 ล้านบาท โดยพิจารณาจากมูลค่าหลักทรัพย์ตามราคาตลาดเฉลี่ยต่อวันย้อนหลัง 3 เดือน ทั้งนี้ ในกรณี ของหลักทรัพย์ที่ได้รับการคัดเลือกตามเกณฑ์มีการเปลี่ยนแปลงรายชื่อหลักทรัพย์ระหว่างรอบที่มีข้อมูล มูลค่าหลักทรัพย์ตามราคาตลาดไม่ถึง 3 เดือน จะพิจารณามูลค่าหลักทรัพย์ตามราคาตลาดเฉลี่ยต่อวัน ย้อนหลังตั้งแต่วันที่หลักทรัพย์นั้นเข้าจดทะเบียนซื้อขาย
3. เป็นหลักทรัพย์ที่มีสัดส่วนผู้ถือหลักทรัพย์รายย่อย (Free-float) ไม่น้อยกว่าร้อยละ 20 ของทุนชำระแล้ว โดยพิจารณาข้อมูลล่าสุดตามรอบระยะเวลาในการทบทวน

4. เป็นหลักทรัพย์ที่มีการซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ฯ โดยจำนวนหุ้นซื้อขายดังกล่าวของหลักทรัพย์นั้นใน แต่ละเดือนไม่น้อยกว่าร้อยละ 0.5 ของจำนวนหุ้นจดทะเบียนของหลักทรัพย์นั้น ๆ เป็นเวลาไม่ต่ำกว่า 9 ใน 12 เดือน หรือน้อยกว่า 3 ใน 4 สำหรับหลักทรัพย์ที่มีระยะเวลาซื้อขายน้อยกว่า 12 เดือน ทั้งนี้ การซื้อขายจะไม่พิจารณารวมเดือนที่หลักทรัพย์ดังกล่าวเข้าข่ายมาตรการกำกับการซื้อขายหลักทรัพย์ (Market Surveillance measure list)

ตลาดหลักทรัพย์ฯได้กำหนดเกณฑ์สำหรับบริษัทจดทะเบียนที่จะได้รับการประกาศผลประเมินหุ้นยั่งยืน SET ESG Ratings ต้องผ่านเกณฑ์คัดกรองเบื้องต้น และ เกณฑ์คัดเลือก SET ESG Ratings ดังนี้

เกณฑ์คัดกรองเบื้องต้น

1. ไม่เป็นบริษัทที่จดทะเบียนในปีที่มีการประเมินความยั่งยืน ยกเว้นบริษัทจดทะเบียนที่มีการปรับโครงสร้างการถือหุ้นโดยตั้งบริษัทซึ่งประกอบธุรกิจโดยการถือหุ้น (Holding Company) และไม่มีการเปลี่ยนแปลงโครงสร้างทางธุรกิจอย่างมีนัยสำคัญ
2. ไม่เป็นบริษัทที่เข้าจดทะเบียนกับตลาดหลักทรัพย์ฯ โดยอ้อม (Backdoor Listing) ในปีที่มีการประเมินความยั่งยืน
3. ไม่เป็นบริษัทที่เข้าข่ายอาจถูกเพิกถอนหลักทรัพย์หรือไม่เป็นบริษัทที่อยู่ระหว่างการฟื้นฟูกิจการ
4. ไม่เป็นบริษัทที่อยู่ระหว่างการขอเพิกถอนหลักทรัพย์โดยสมัครใจ
5. ไม่เป็นบริษัทที่มีการกระจายการถือหุ้นโดยมีจำนวนผู้ถือหุ้นรายย่อยน้อยกว่า 150 ราย หรือถือหุ้น รวมกันต่ำกว่า 15% ของทุนชำระแล้ว
6. ไม่เป็นบริษัทที่ผู้สอบบัญชีไม่แสดงความเห็นต่อการเงินหรือเห็นว่าการเงินไม่ถูกต้องในปีที่มีการประเมินความยั่งยืนและปีก่อนหน้า
7. ไม่เป็นบริษัทที่ถูกหยุดพักการซื้อขายหลักทรัพย์เนื่องจากนำส่งงบการเงินล่าช้ากว่าที่กำหนดในปีที่มีการประเมินความยั่งยืนและปีก่อนหน้า
8. ไม่เป็นบริษัทที่ถูกตลาดหลักทรัพย์ฯ ดำเนินการกรณีมีเหตุการณ์ที่อาจส่งผลกระทบต่อฐานะทาง การเงินและการดำเนินธุรกิจเป็นต้นว่า ถูกขึ้นเครื่องหมาย CB, CS, CC และ CF ในปีที่มีการประเมินและปีก่อนหน้า
9. ไม่เป็นบริษัทที่มีพฤติกรรมการซื้อขายที่ผิดปกติโดยการกระทำของกรรมการและผู้บริหารหรือไม่เป็นบริษัทที่มีกรรมการและผู้บริหารที่มีลักษณะขาดความน่าไว้วางใจตามประกาศ ก.ล.ด. ในปี ที่มีการประเมินความยั่งยืนและปีก่อนหน้า

เกณฑ์คัดเลือก SET ESG Ratings

ตลาดหลักทรัพย์ฯ พิจารณาคุณสมบัติบริษัทจดทะเบียนที่มีสิทธิ์ได้รับการประกาศผลประเมินหุ้นยั่งยืน SET ESG Ratings ตามเกณฑ์คะแนนจากแบบประเมินความยั่งยืน และ เกณฑ์คุณสมบัติดังนี้

เกณฑ์คะแนนจากแบบประเมินความยั่งยืน

ตลาดหลักทรัพย์ฯ คัดเลือกจากบริษัทจดทะเบียนที่สมัครใจตอบแบบประเมินความยั่งยืนของตลาดหลักทรัพย์ฯ และมีคะแนน จากการตอบแบบประเมินความยั่งยืนอย่างน้อยครึ่งหนึ่งของคะแนนเต็มในแต่ละมิติ (มิติบรรษัทภิบาลและเศรษฐกิจ มิติสิ่งแวดล้อม และ มิติสังคม)

เกณฑ์คุณสมบัติ

ตลาดหลักทรัพย์ฯ พิจารณาจากข้อมูลในปีที่มีการประเมินความยั่งยืนและปีก่อนหน้า เว้นแต่จะระบุเป็นอย่างอื่น

1. เป็นบริษัทที่มีผลการประเมินคุณภาพรายงานด้านบรรษัทภิบาล (Corporate Governance Report หรือ CGR) ของรอบปีที่มีการประเมินความยั่งยืนตั้งแต่ 3 ดาวขึ้นไป
2. ไม่เป็นบริษัทที่เข้าข่ายอาจถูกเพิกถอนหลักทรัพย์หรืออยู่ระหว่างการฟื้นฟูกิจการหรืออยู่ระหว่างการขอเพิกถอนหลักทรัพย์โดยสมัครใจ
3. ไม่เป็นบริษัทที่มีการทำรายการเกี่ยวโยงที่ไม่เป็นธรรม ซึ่งหน่วยงานทางการแจ้งเตือนผู้ลงทุนให้ใช้วิจารณญาณในการตัดสินใจ
4. ไม่เป็นบริษัทที่เข้าข่ายฝ่าฝืนเกณฑ์เรื่องการดำรงสถานะการเป็นบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ฯ เรื่องกรรมการอิสระและ/หรือกรรมการตรวจสอบ และการกระจายการถือหุ้น (Free Float)
5. ไม่เป็นบริษัทที่มีพฤติกรรมการซื้อขายที่ผิดปกติโดยการกระทำของกรรมการและผู้บริหาร หรือ ไม่เป็นบริษัทที่มีกรรมการและผู้บริหารที่มีลักษณะขาดความน่าไว้วางใจตามประกาศ ก.ล.ด.
6. ไม่เป็นบริษัทที่ถูกกล่าวโทษหรือได้รับการตัดสินความผิดจากทางทางหรือหน่วยงานที่เกี่ยวข้อง หรือมีกรรมการหรือผู้บริหารถูกกล่าวโทษหรือได้รับการตัดสินความผิดจากทางทางหรือ หน่วยงาน ที่เกี่ยวข้องในเรื่องการกำกับดูแลกิจการ การสร้างผลกระทบต่อสังคมหรือสิ่งแวดล้อม
7. ไม่เป็นบริษัทที่ผู้สอบบัญชีแสดงความเห็นแบบมีเงื่อนไขเกี่ยวกับฐานะการเงินหรือผลการดำเนินงาน หรือความสามารถในการดำเนินงานต่อเนื่องในงบการเงินปีล่าสุด และไม่เป็นบริษัทที่ผู้สอบบัญชี ไม่แสดงความเห็นต่อการเงินหรือเห็นว่าการเงินไม่ถูกต้องในปีที่มีการประเมินความยั่งยืน
8. ไม่เป็นบริษัทที่ถูกหยุดพักการซื้อขายหลักทรัพย์เนื่องจากนำส่งงบการเงินล่าช้ากว่าที่กำหนด

9. ไม่เป็นบริษัทที่ถูกตลาดหลักทรัพย์ฯ ดำเนินการกรณีมีเหตุการณ์ที่อาจส่งผลกระทบต่อฐานะทาง การเงินและการดำเนินธุรกิจ เป็น ต้นว่า ถูกขึ้นเครื่องหมาย CB, CC, CF และ CS ในปีที่มีการประเมิน และปีก่อนหน้า
10. ไม่เป็นบริษัทที่มีส่วนของผู้ถือหุ้นในงบการเงินปีล่าสุดมีค่าต่ำกว่าศูนย์
11. ไม่เป็นบริษัทที่มีผลกำไรสุทธิไม่ถึง 3 ใน 5 ปีย้อนหลัง นับจากงบการเงินปีล่าสุด
12. คณะทำงานเพื่อการลงทุนอย่างยั่งยืนอาจพิจารณาประเด็นอื่น ในเรื่องการกำกับดูแลกิจการ การสร้าง ผลกระทบด้านสังคมหรือ สิ่งแวดล้อม ประกอบการคัดกรองบริษัทในการจัดทำหุ้นยั่งยืน SET ESG Ratings

2.2 กระบวนการวิเคราะห์และคัดเลือกหลักทรัพย์

นอกเหนือจากเกณฑ์ของตลาดหลักทรัพย์ฯ ในการคัดเลือกหลักทรัพย์ของบริษัทจดทะเบียนที่ได้รับการประกาศผลประเมินหุ้นยั่งยืน SET ESG Ratings และ เกณฑ์การคัดเลือกหลักทรัพย์ที่เป็นส่วนประกอบของ SET ESG Total Return Index แล้ว กองทุนจะ วิเคราะห์สภาพคล่องของหลักทรัพย์ที่เป็นส่วนประกอบของ SET ESG Total Return Index เพิ่มเติม เช่น มูลค่าการซื้อขายเฉลี่ยต่อวัน จำนวนหุ้นซื้อขายเฉลี่ยต่อวัน เป็นต้น โดยอาจไม่ลงทุนในหลักทรัพย์ที่เป็นส่วนประกอบของ SET ESG Total Return Index บางตัวที่มี สภาพคล่องต่ำ และพิจารณาเลือกใช้กลยุทธ์แบบ Optimization เพื่อให้กองทุนสามารถสร้างผลตอบแทนที่ใกล้เคียงกับ SETESG Total Return Index ในกรณีที่กองทุนวิเคราะห์สภาพคล่องของหลักทรัพย์ที่เป็นส่วนประกอบของ SETESG Index แล้วพิจารณาที่จะ ลงทุนในหลักทรัพย์ที่เป็นส่วนประกอบของ SET ESG Total Return Index ทุกตัว กองทุนจะพิจารณาเลือกใช้กลยุทธ์แบบ Optimization เพื่อให้กองทุนสามารถสร้างผลตอบแทนที่ใกล้เคียงกับ SETESG Total Return Index

กระบวนการวิเคราะห์การประเมินหุ้นยั่งยืน SET ESG Ratings ตามเกณฑ์ของตลาดหลักทรัพย์ฯ นั้น เริ่มจากบริษัทจดทะเบียนที่ผ่าน เกณฑ์คัดกรองเบื้องต้น สัมผัสจุดแบบประเมินความยั่งยืนในทั้ง 3 มิติคือ มิติบรรษัทภิบาลและเศรษฐกิจ มิติสิ่งแวดล้อม และ มิติสังคม โดย แบบประเมินความยั่งยืนแบ่งตาม 8 กลุ่มอุตสาหกรรม ประกอบด้วยคำถามทั่วไปและคำถามเฉพาะกลุ่มอุตสาหกรรม บริษัทจดทะเบียนที่ ได้คะแนนจากการตอบแบบประเมินความยั่งยืนไม่น้อยกว่า 50% ของแต่ละมิติ และผ่านเกณฑ์คุณสมบัติ จะได้รับการประกาศผล ประเมินหุ้นยั่งยืน SET ESG Ratings ซึ่งบริษัทจดทะเบียนที่ได้รับการประกาศผลประเมินหุ้นยั่งยืน SET ESG Ratings เหล่านี้ และมี คุณสมบัติตามเกณฑ์การคำนวณดัชนีจะได้รับคัดเลือกเป็นส่วนประกอบของ SET ESG Total Return Index

ทั้งนี้ เกณฑ์การประเมินหุ้นยั่งยืน SET ESG Ratings และ เกณฑ์การคัดเลือกหลักทรัพย์ที่เป็นส่วนประกอบของ SET ESG Total Return Index อาจมีการเปลี่ยนแปลงได้ โดยหากมีการเปลี่ยนแปลง กองทุนจะคัดเลือกหลักทรัพย์ที่เป็นส่วนประกอบของ SET ESG Total Return Index ที่คัดเลือกจากหลักเกณฑ์ใหม่ของตลาดหลักทรัพย์ฯ

2.3 การอ้างอิงดัชนีชี้วัดที่เกี่ยวกับความยั่งยืน

ดัชนีชี้วัดของกองทุน คือ SET ESG Total Return Index ร้อยละ 100 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน ซึ่งเป็นดัชนีจัดทำโดย ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยที่มีแนวทางในการจัดเลือกดังนี้

- เป็นบริษัทที่อยู่ในผลประเมินหุ้นยั่งยืน SET ESG Ratings ที่ประกาศล่าสุด ก่อนรอบการทบทวนรายชื่อหลักทรัพย์ในดัชนี
- เป็นหลักทรัพย์ที่มีมูลค่าหลักทรัพย์ตามราคาตลาด (Market Capitalization) ไม่น้อยกว่า 5,000 ล้านบาท และผ่านสภาพคล่องที่ กำหนด
- มีสัดส่วนผู้ถือหุ้นหลักทรัพย์รายย่อย (Free-Float) ไม่น้อยกว่าร้อยละ 20 ของทุนชำระแล้ว
- มีจำนวนหุ้นซื้อขายไม่น้อยกว่าร้อยละ 0.5 ของจำนวนหุ้นจดทะเบียนของบริษัท เป็นเวลาไม่ต่ำกว่า 9 ใน 12 เดือน
- ไม่รวมหลักทรัพย์ที่ถูกขึ้นเครื่องหมาย SP

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

ทั้งนี้ ในกรณีที่มีการยกเลิกการใช้หรือไม่มีการคำนวณดัชนี SET ESG Total Return Index บริษัทจัดการขอสงวนสิทธิในการ เปลี่ยนแปลงดัชนีเป็นดัชนีอื่นใดที่มีลักษณะเหมาะสมหรือใกล้เคียงกับดัชนี SET ESG Total Return Index และหากในอนาคตตลาด หลักทรัพย์แห่งประเทศไทย มีการจัดทำดัชนี TRI ที่นำสัดส่วนผู้ถือหุ้นหลักทรัพย์รายย่อยของแต่ละหลักทรัพย์ (free float) มาถ่วงน้ำหนัก ในการคำนวณดัชนี (ดัชนี free float TRI) บริษัทจัดการจะใช้ดัชนี free float TRI นั้น เป็นดัชนีชี้วัดแทนเพื่อให้เป็นไปตามหลักเกณฑ์ที่ คณะกรรมการกำกับตลาดทุนประกาศกำหนด

2.4 ข้อจำกัดด้านการลงทุน

กองทุนมีกรอบการลงทุนในหลักทรัพย์ที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย และ/หรือตลาดหลักทรัพย์ เอ็ม เอ ไอ ที่เป็น ส่วนประกอบของดัชนี SET ESG Total Return Index เป็นหลัก จึงทำให้กองทุนไม่สามารถลงทุนในหลักทรัพย์อื่นที่ไม่เข้าเกณฑ์ตาม กรอบการลงทุนได้เกินกว่าเกณฑ์ที่กำหนด

3. ความเสี่ยงที่เกี่ยวข้องกับการลงทุนอย่างยั่งยืน

- ความเสี่ยงจากการลงทุนในหลักทรัพย์ที่เป็นส่วนประกอบของดัชนีอ้างอิง (SET ESG Total Return Index) ทำให้กองทุนเสียโอกาสในการลงทุนในหลักทรัพย์ทั่วไปที่อาจให้ผลตอบแทนที่ดีกว่า
- ความเสี่ยงจากการกระจุกตัวในหลักทรัพย์ที่เกี่ยวข้องกับความยั่งยืน เนื่องจากข้อจำกัดด้านกรอบการลงทุน ทำให้กองทุนไม่สามารถลงทุนในบางหลักทรัพย์ได้
- ความเสี่ยงจากการลงทุนในหลักทรัพย์ที่อาจไม่เป็นไปตามกรอบการลงทุนด้านความยั่งยืนที่กองทุนกำหนด ตัวอย่างเช่น กรณีคู่ค้าของผู้ออกหลักทรัพย์ (ผู้ขายสินค้า ผู้รับจ้าง และ/หรือผู้ให้บริการ) มีการปฏิบัติไม่เป็นไปตามกรอบการลงทุนด้านความยั่งยืน
- ความเสี่ยงที่เกี่ยวข้องกับการขาดสภาพคล่องของตราสาร เนื่องจากหลักทรัพย์หรือตราสารที่ลงทุนอาจมีปริมาณการซื้อขายที่จำกัด ซึ่งอาจทำให้กองทุนไม่สามารถซื้อขายหลักทรัพย์หรือตราสารที่ถือครองอยู่ในราคาที่เหมาะสมและภายในระยะเวลาอันสมควร ทั้งนี้ ผู้จัดการกองทุนจะพิจารณาการลงทุนในตราสารที่มีคุณภาพและคำนึงสภาพคล่องในการซื้อขายก่อนตัดสินใจลงทุน
- ความเสี่ยงด้านสิทธิประโยชน์ทางภาษี การขายคืนหน่วยลงทุนของกองทุนนี้อาจส่งผลให้ผู้ลงทุนต้องชำระคืนสิทธิประโยชน์ทางภาษี ดังนั้น ผู้ลงทุนมีหน้าที่ต้องศึกษาและปฏิบัติตามข้อกำหนดในกฎหมายภาษีอากร ทั้งนี้ สำหรับผู้ลงทุนที่จะได้รับสิทธิประโยชน์ทางภาษี จะต้องถือหน่วยลงทุนครบตามระยะเวลาที่กฎหมายภาษีอากรกำหนด ณ วันที่ขายหน่วยลงทุน
- ความเสี่ยงของผู้ลงทุนของผู้ถือหน่วยลงทุนของกองทุนรวมหุ้นระยะยาวที่จะสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนมายังกองทุนรวมไทยเพื่อความยั่งยืนแบบพิเศษ เพื่อใช้สิทธิวงเงินลดหย่อน 500,000 บาท (ปีที่ 1 ไม่เกิน 300,000 บาท ส่วนปีที่ 2 – 5 ไม่เกินปีละ 50,000 บาท) จะต้องสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนของกองทุนรวมหุ้นระยะยาวที่ได้รับสิทธิลดหย่อนภาษีดังกล่าว ที่ผู้ถือหน่วยลงทุนลงทุนในกองทุนรวมหุ้นระยะยาวทุกกองทุนของทุกบริษัทจัดการมายังกองทุนรวมไทยเพื่อความยั่งยืนแบบพิเศษในช่วงระยะเวลาที่กองทุนรวมไทยเพื่อความยั่งยืนแบบพิเศษเปิดรับสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนจากกองทุนรวมหุ้นระยะยาวตามมติคณะรัฐมนตรี เมื่อวันที่ 11 มีนาคม 2568 ด้วย

4. แนวทางการดำเนินการ และมาตรการควบคุมผลกระทบในกรณีการลงทุนของ SRI Fund ไม่เป็นไปตามนโยบายการลงทุนด้านความยั่งยืนที่ได้กำหนดไว้

บริษัทจัดการจะทำการประเมินและทบทวนกระบวนการลงทุนอย่างสม่ำเสมอ เพื่อให้การลงทุนของกองทุนเป็นไปตามวัตถุประสงค์และนโยบายการลงทุนของกองทุนที่ให้ความยั่งยืน หากมีข่าวที่มีผลกระทบเชิงลบเกี่ยวกับสิ่งแวดล้อม สังคม และการกำกับกิจการที่ดี ผู้จัดการกองทุนจะติดต่อสอบถามไปยังบริษัทที่มีดังกล่าวเพื่อสอบถามสาเหตุและแนวทางแก้ไข รวมถึงสอบถามถึงประเด็นอื่นๆ โดยจะมีการติดตามการแก้ไขผลกระทบดังกล่าวจนกว่าจะสามารถแก้ไขได้แล้วเสร็จ หรืออาจมีความร่วมมือกับ ผู้ลงทุนอื่นเพื่อยกระดับการติดตามให้ใกล้ชิดมากขึ้น และเร่งรัดการแก้ไขปัญหาให้เสร็จโดยเร็ว โดยหากผู้จัดการกองทุนเห็นว่า บริษัทไม่สามารถหรือไม่มีความพยายามแก้ไขได้อย่างรวดเร็วเพียงพอ หรือความเสียหายที่เกิดขึ้นมีความเสี่ยงมากกว่าที่ยอมรับได้ ผู้จัดการกองทุนอาจพิจารณาลดสัดส่วนหรือถอนการลงทุนในบริษัทที่มีประเด็นดังกล่าว และนำหลักทรัพย์นั้นๆ ออกจากรายชื่อหลักทรัพย์ที่ลงทุน เพื่อให้เป็นไปตามนโยบายการลงทุนที่กำหนดไว้ และเป็นไปตามหลักเกณฑ์ที่กำหนด