



## กองทุนรวมบัวหลวงผสมไทยเพื่อความยั่งยืน

Bualuang Mixed Thailand ESG Fund

B-MIXED-THAIESG

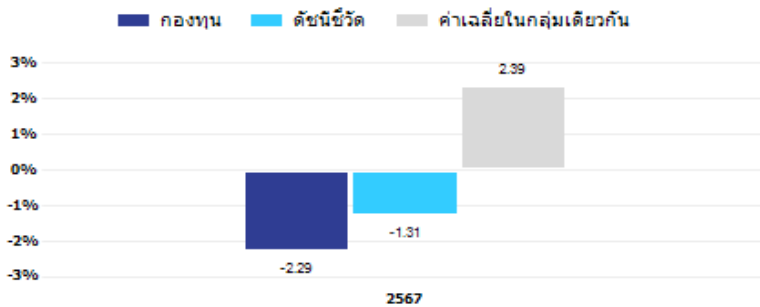
### ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมผสม/ กองทุนรวมไทยเพื่อความยั่งยืน/ กองทุนรวมเพื่อความยั่งยืน (SRI Fund)/ กองทุนรวมที่มีนโยบายเปิดให้มีการลงทุนในกองทุนรวมอื่นภายใต้ บลจ. เดียวกัน
- กองทุนที่ลงทุนแบบมีความเสี่ยงทั้งในและต่างประเทศ
- กลุ่ม Moderate Allocation

### นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- กองทุนมีนโยบายกระจายการลงทุนในทรัพย์สิน ดังต่อไปนี้
  - 1) หุ้นที่เป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET) และ/หรือตลาดหลักทรัพย์ เอ็ม เอ ไอ (mai) ที่มีลักษณะดังนี้ 1.1) หุ้นของบริษัทจดทะเบียนที่ได้รับการคัดเลือกจาก SET ว่ามีความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน (ESG) และ/หรือ 1.2) หุ้นของบริษัทจดทะเบียนที่มีการเปิดเผยข้อมูลเกี่ยวกับการปล่อยก๊าซเรือนกระจก แผนการจัดการ และการตั้งเป้าหมายเพื่อให้บรรลุเป้าหมายในการลดปริมาณการปล่อยก๊าซเรือนกระจกของประเทศไทย และ/หรือ 1.3) หุ้นของบริษัทจดทะเบียนที่มีธรรมาภิบาล (Governance) ที่มีลักษณะเป็นไปตามประกาศ และ/หรือ
  - 2) พันธบัตรรัฐบาล พันธบัตรหรือหุ้นกู้ที่กระทรวงการคลังค้ำประกันต้นเงินและดอกเบี้ยแต่ไม่รวมถึงหุ้นกู้แปลงสภาพตราสารหนี้อื่นๆ โดยพันธบัตร หุ้นกู้ หรือตราสารหนี้ต้องเป็นตราสารที่ออกโดยรัฐบาล (green bond) เพื่อความยั่งยืน (sustainability bond) หรือเพื่อส่งเสริมความยั่งยืน (sustainability - linked bond) ที่มีการเปิดเผยข้อมูลตามที่ตั้งสำนักงาน ก.ล.ต. กำหนด
- โดยมี net exposure ในทรัพย์สินที่ลงทุนดังกล่าวโดยเฉลี่ยรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV (สามารถดูรายละเอียดเพิ่มเติมได้ที่หน้า 3)
- กองทุนมีสัดส่วนการลงทุนในต่างประเทศโดยเฉลี่ยรอบปีบัญชีไม่เกิน 20% ของ NAV ทั้งนี้ กองทุนจะป้องกันความเสี่ยงด้านอัตราแลกเปลี่ยนตามดุลยพินิจของผู้จัดการกองทุน
- กองทุนมีสัดส่วนการลงทุนในกองทุนรวมอื่นภายใต้ บลจ. เดียวกัน โดยเฉลี่ยรอบปีบัญชีไม่เกิน 20% ของ NAV
- กองทุนอาจลงทุนใน Derivatives เพื่อป้องกันความเสี่ยงจากการลงทุน รวมถึงเพื่อเพิ่มประสิทธิภาพในการบริหารการลงทุน (EPM) และ/หรือ Structured Note
- กองทุนมุ่งหวังให้ผลตอบแทนการเคลื่อนไหวสูงกว่าดัชนีชี้วัด (Active Management)

### ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (% ต่อปี)



### ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด (ณ วันที่ 30 เมษายน 2568)

|                          | YTD   | 3 เดือน | 6 เดือน | 1 ปี*           |
|--------------------------|-------|---------|---------|-----------------|
| กองทุน                   | -3.19 | -1.50   | N/A     | N/A             |
| ดัชนีชี้วัด              | -4.81 | -1.80   | N/A     | N/A             |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน | -2.87 | -2.25   | -3.84   | -0.80           |
| ความผันผวนกองทุน         | 8.54  | 9.20    | N/A     | N/A             |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด    | 8.84  | 9.59    | 7.69    | N/A             |
|                          | 3 ปี* | 5 ปี*   | 10 ปี*  | ตั้งแต่จัดตั้ง* |
| กองทุน                   | N/A   | N/A     | N/A     | -5.41           |
| ดัชนีชี้วัด              | N/A   | N/A     | N/A     | -6.06           |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน | -1.49 | 0.52    | 0.29    | N/A             |
| ความผันผวนกองทุน         | N/A   | N/A     | N/A     | 7.62            |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด    | N/A   | N/A     | N/A     | 7.69            |

\* % ต่อปี

### ระดับความเสี่ยง

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

### เสี่ยงปานกลางค่อนข้างสูง

ลงทุนในตราสารทุน และ/หรือตราสารหนี้

โดยมีสัดส่วนการลงทุนในตราสารทุนน้อยกว่า 80% ของ NAV

### ข้อมูลกองทุนรวม

|                     |                  |
|---------------------|------------------|
| วันจดทะเบียนกองทุน  | 1 พฤศจิกายน 2567 |
| วันเริ่มต้น class   | -                |
| นโยบายจ่ายเงินปันผล | ไม่จ่าย          |
| อายุกองทุน          | ไม่กำหนด         |

### ผู้จัดการกองทุนรวม

1. น.ส.ดุสิต ภูพิพัฒน์ (ตั้งแต่ 1 พ.ย. 2567)
2. น.ส.อรุณี ศิลปการประดิษฐ์ (ตั้งแต่ 1 พ.ย. 2567)

### ดัชนีชี้วัด

1. ดัชนีผลตอบแทนรวมตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET TRI) สัดส่วน 50%
  2. ThaiBMA Government Bond ESG Index Net Total Return สัดส่วน 40%
  3. ผลตอบแทนรวมของดัชนีพันธบัตรรัฐบาลระยะสั้นของสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย สัดส่วน 10%
- ดัชนีชี้วัด : ใช้เป็นตัวแทนองค์ประกอบของพอร์ตโฟลิโอ

### คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวมมิได้เป็นสัญญานถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต : ได้รับการรับรองจาก CAC

จัดอันดับกองทุน Morningstar -

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



"ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือบริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่องได้ที่หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม"

<https://www.bblam.co.th/?cID=20776>

การซื้อขายหน่วยลงทุน

|                              |                 |
|------------------------------|-----------------|
| วันทำการซื้อ:                | ทุกวันทำการ     |
| เวลาทำการ:                   | 8.30 - 15.30 น. |
| การซื้อขายครั้งแรกขั้นต่ำ:   | 500 บาท         |
| การซื้อขายครั้งถัดไปขั้นต่ำ: | 500 บาท         |

การขายคืนหน่วยลงทุน

|                                   |                 |
|-----------------------------------|-----------------|
| วันทำการขายคืน:                   | ทุกวันทำการ     |
| เวลาทำการ:                        | 8.30 - 15.30 น. |
| การขายคืนขั้นต่ำ:                 | ไม่กำหนด        |
| ยอดคงเหลือขั้นต่ำ:                | ไม่กำหนด        |
| ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน*: T+2 |                 |

หมายเหตุ: \* บริษัทจัดการจะชำระเงินค่าขายคืน ภายใน 5 วันทำการนับแต่วันทำการขายคืน (ปัจจุบันคืนเงินค่าขายคืน T+2)  
T = วันทำการซื้อขายของกองทุน  
การซื้อขายหรือขายคืนหน่วยลงทุนจะได้รับราคา NAV ณ สิ้นวันทำการ

| ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV) |               |          |
|-------------------------------------------------------|---------------|----------|
| ค่าธรรมเนียม                                          | สูงสุดไม่เกิน | เก็บจริง |
| การจัดการ                                             | 1.0700        | 1.0700   |
| รวมค่าใช้จ่าย                                         | 2.4075        | 1.3246   |

หมายเหตุ: กรณีที่กองทุนลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมภายใต้การจัดการเดียวกัน บริษัทจัดการจะไม่เรียกเก็บค่าธรรมเนียมการจัดการซ้ำซ้อน สามารถดูข้อมูลเพิ่มเติมได้ที่หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม  
บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ

| ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วยลงทุน (% ของมูลค่าซื้อขาย) |                       |                     |
|------------------------------------------------------------------|-----------------------|---------------------|
| ค่าธรรมเนียม                                                     | สูงสุดไม่เกิน         | เก็บจริง            |
| การขาย                                                           | 1.00                  | ไม่เรียกเก็บ        |
| การรับซื้อคืน                                                    | 1.00 (ขั้นต่ำ 50 บาท) | ไม่เรียกเก็บ        |
| การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า                                      | 1.00                  | ตามหมายเหตุด้านล่าง |
| การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก                                       | 200 บาท/รายการ        | ตามหมายเหตุด้านล่าง |
| การโอนหน่วย                                                      | -                     | -                   |

หมายเหตุ: กรณีที่กองทุนลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมภายใต้การจัดการเดียวกัน บริษัทจัดการจะไม่เรียกเก็บค่าธรรมเนียมการขายหรือรับซื้อคืนหน่วยลงทุนซ้ำซ้อน สามารถดูข้อมูลเพิ่มเติมได้ที่หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม  
ค่าธรรมเนียมการขาย บริษัทจัดการขอสงวนสิทธิเรียกเก็บไม่เกิน 1.00% โดยจะแจ้งให้ทราบล่วงหน้า  
ค่าธรรมเนียมการรับซื้อคืน บริษัทจัดการขอสงวนสิทธิเรียกเก็บตามเงื่อนไขดังต่อไปนี้ โดยจะแจ้งให้ทราบล่วงหน้า

- ถือครองน้อยกว่าหรือเท่ากับ 1 ปี : ไม่เกิน 1.00% (ขั้นต่ำ 50 บาท)
- ถือครองมากกว่า 1 ปี : 50 บาทต่อรายการ

ค่าธรรมเนียมการสับเปลี่ยน

- ภายในบริษัทจัดการ : ไม่มี
- กับบริษัทจัดการอื่น : ยังไม่เปิดให้บริการ โดยก่อนเปิดให้บริการจะแจ้งให้ทราบผ่านทาง [www.bblam.co.th](http://www.bblam.co.th)

กองทุนรวมไทยเพื่อความยั่งยืนไม่สามารถนำหน่วยลงทุนไปจำหน่าย จ่าย โอน จำนำ หรือนำไปเป็นหลักประกันได้  
บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ

| สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน |       | ทรัพย์สินที่ลงทุนสูงสุด 5 อันดับแรก                      |       |
|--------------------------------|-------|----------------------------------------------------------|-------|
|                                | % NAV |                                                          | % NAV |
| พันธบัตร                       | 55.80 | พันธบัตรรัฐบาลเพื่อความยั่งยืน                           | 26.51 |
| หุ้นสามัญ                      | 41.64 | สำหรับปรับโครงสร้างหนี้ (พ.ร.ก. กู้เงินโควิด-19)         |       |
| เงินฝากธนาคาร                  | 2.93  | พันธบัตรรัฐบาลส่งเสริมความยั่งยืน                        | 17.21 |
| ทรัพย์สินอื่นและหนี้สินอื่น    | -0.37 | ในปีงบประมาณ พ.ศ. 2568 ครั้งที่ 1                        |       |
|                                |       | พันธบัตรเพื่อความยั่งยืน (Sustainability Bond)           | 9.51  |
|                                |       | ในปีงบประมาณ พ.ศ. 2563                                   |       |
|                                |       | หุ้นสามัญ บริษัท แอดวานซ์ อินโฟร์ เซอร์วิส จำกัด (มหาชน) | 3.49  |
|                                |       | หุ้นสามัญ ธนาคารกสิกรไทย จำกัด (มหาชน)                   | 3.33  |

| ข้อมูลเชิงสถิติ            |           |
|----------------------------|-----------|
| Maximum drawdown           | -9.1 %    |
| Recovering Period          | N/A       |
| FX Hedging                 | N/A       |
| อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน | 1.46 เท่า |
| Sharpe Ratio               | N/A       |
| Alpha                      | N/A       |
| Beta                       | N/A       |
| Tracking Error             | N/A       |
| อายุเฉลี่ยของตราสารหนี้    | N/A       |
| Yield to Maturity          | N/A       |

การจัดสรรการลงทุนในต่างประเทศ

-

การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม 5 อันดับแรก

-

การจัดสรรการลงทุนตามอันดับความน่าเชื่อถือ (%)

-

## ข้อมูลอื่นๆ

### ช่องทางการซื้อหน่วยลงทุน

- บริษัทจัดการ/ ผู้สนับสนุนการขายหรือรับซื้อคืน/ หักบัญชีเงินฝากแบบถัวเฉลี่ย\* : เวลา 8.30 น. - 15.30 น.
- Bangkok Bank Mobile Banking\*\*/ BF Fund Trading\*\*\* : ทุกวันตลอด 24 ชั่วโมง

### ช่องทางการขายคืนหน่วยลงทุน

- บริษัทจัดการ/ ผู้สนับสนุนการขายหรือรับซื้อคืน/ BF Fund Trading : เวลา 8.30 น. - 15.30 น.
- Bangkok Bank Mobile Banking\*\* : ทุกวันตลอด 24 ชั่วโมง

หมายเหตุ:

\* สามารถทำรายการผ่าน บมจ.ธนาคารกรุงเทพ/ Bangkok Bank Mobile Banking/ บมจ.กรุงเทพประกันชีวิต และ BF Fund Trading

\*\* การส่งคำสั่งซื้อหรือคำสั่งขายคืน หลังเวลา 16.00 น. ในวันทำการซื้อขายหรือในวันหยุดทำการซื้อขาย จะได้ราคาขายหรือราคารับซื้อคืนหน่วยลงทุนที่คำนวณได้ ณ สิ้นวันทำการซื้อขายถัดไป

\*\*\* การส่งคำสั่งซื้อ หลังเวลา 15.00 น. ในวันทำการซื้อขายหรือในวันหยุดทำการซื้อขาย จะได้ราคาขายหน่วยลงทุนที่คำนวณได้ ณ สิ้นวันทำการซื้อขายถัดไปค่าเตือนเพิ่มเติม

- ในกรณีที่เหตุการณ์ซึ่งสำนักงาน ก.ล.ต. กำหนดให้ต้องเลิกกองทุน บริษัทจัดการจะโอนย้ายการลงทุนไปยังกองทุนรวมไทยเพื่อความยั่งยืนอื่น ตามที่บริษัทจัดการเห็นสมควร
- การลงทุนในกองทุนรวมนี้ หากประสงค์นำไปใช้เพื่อสิทธิประโยชน์ทางภาษีต้องลงทุนให้เป็นไปตามเงื่อนไขของสรรพากร ทั้งข้อกำหนดและเงื่อนไขการลงทุนของกองทุนรวมไทยเพื่อความยั่งยืน

### วัตถุประสงค์การลงทุนที่เกี่ยวกับความยั่งยืน

กองทุนมีนโยบายกระจายการลงทุนในทรัพย์สินดังต่อไปนี้ โดยมี net exposure ในทรัพย์สินที่ลงทุนดังกล่าวโดยเฉลี่ยรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน

- ลงทุนในหุ้นที่เป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET) และ/หรือตลาดหลักทรัพย์ เอ็ม เอ ไอ (mai) ที่มีลักษณะดังนี้
    - หุ้นของบริษัทจดทะเบียนที่ได้รับการคัดเลือกจาก SET ว่ามีความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อม (Environment: E) หรือด้านความยั่งยืน (Environmental, Social and Governance: ESG) และ/หรือ
    - หุ้นของบริษัทจดทะเบียนที่มีการเปิดเผยข้อมูลเกี่ยวกับการปล่อยก๊าซเรือนกระจก แผนการจัดการ และการตั้งเป้าหมายเพื่อให้บรรลุเป้าหมายในการลดปริมาณการปล่อยก๊าซเรือนกระจกของประเทศไทย รวมทั้งจัดให้มีการทวนสอบการจัดทำคาร์บอนฟุตพริ้นท์ โดยผู้ทวนสอบที่สำนักงาน ก.ล.ต. ยอมรับ และ/หรือ
    - หุ้นของบริษัทจดทะเบียนที่มีธรรมาภิบาล (Governance) ที่มีลักษณะดังนี้
      - เป็นหุ้นของบริษัทจดทะเบียนที่มีธรรมาภิบาล (Governance) โดยได้รับการประเมินการกำกับดูแลกิจการบริษัทจดทะเบียน (Corporate Governance Report of Thai Listed Companies: CGR) จากสมาคมส่งเสริมสถาบันกรรมการบริษัทไทย ตั้งแต่ 90 คะแนนขึ้นไป หรือเทียบเท่า
      - มีการเปิดเผยเป้าหมายและแผนในเรื่องดังนี้ และรายงานความคืบหน้าการปฏิบัติตามเป้าหมายหรือแผน ผ่านช่องทางของ SET ซึ่งจัดไว้สำหรับการเปิดเผยข้อมูลดังกล่าวโดยเฉพาะ
        - การมีเป้าหมายและแผนธุรกิจที่เกี่ยวข้องกับการเพิ่มมูลค่าของกิจการ (corporate value up plan)
        - การมีเป้าหมายและแผนการยกระดับการดำเนินงานในเรื่องใดเรื่องหนึ่ง ดังนี้ โดยต้องตั้งเป้าหมายเพื่อดำเนินการให้เป็นไปตามแผนการยกระดับดังกล่าวให้แล้วเสร็จภายใน 2 ปีนับแต่วันที่เปิดเผยเป้าหมายและแผนการยกระดับ
          - แผนดำเนินการที่ชัดเจนเพื่อเข้ารับการประเมินจากผู้ประเมินผลการดำเนินงานด้านความยั่งยืนตามมาตรฐานสากลตามที่ประกาศการลงทุนของกองทุนกำหนด
          - เป้าหมายและแผนดำเนินการเพื่อลดปริมาณการปล่อยก๊าซเรือนกระจกของประเทศไทยตามข้อ (2)
      - มีการเพิ่มประสิทธิภาพการสื่อสารกับผู้ลงทุน ตามที่ SET กำหนด
  - ลงทุนในตราสารอย่างใดอย่างหนึ่ง หรือหลายอย่าง ดังนี้
    - ตราสารเพื่ออนุรักษ์สิ่งแวดล้อม (green bond) ตราสารเพื่อความยั่งยืน (sustainability bond) และ/หรือตราสารส่งเสริมความยั่งยืน (sustainability - linked bond) ที่ออกตามประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุนว่าด้วยการขออนุญาตและการอนุญาตให้เสนอขายตราสารหนี้ที่ออกใหม่ต่อประชาชนเป็นการทั่วไป ประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุนว่าด้วยการขออนุญาตและการอนุญาตให้เสนอขายตราสารหนี้ที่ออกใหม่ต่อบุคคลในวงจำกัด และการเสนอขายหุ้นกู้แปลงสภาพต่อบุคคลที่มีลักษณะเฉพาะ หรือประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุนว่าด้วยการออกและเสนอขายหุ้นกู้ และการเปิดเผยข้อมูล แล้วแต่กรณี ซึ่งมีการเปิดเผยข้อมูลในแบบแสดงรายการข้อมูลการเสนอขายตราสาร หรือเอกสารที่นำเสนอต่อผู้ลงทุนในการเสนอขายตราสารดังกล่าว ในเรื่องดังนี้
      - กรณีเป็นตราสารเพื่ออนุรักษ์สิ่งแวดล้อม (green bond) หรือตราสารเพื่อความยั่งยืน (sustainability bond) ต้องมีการเปิดเผยวัตถุประสงค์การใช้เงินที่ได้จากการระดมทุน (use of proceeds) ว่าเป็นไปเพื่อโครงการที่เกี่ยวข้องกับการอนุรักษ์สิ่งแวดล้อมหรือเพื่อโครงการที่เกี่ยวข้องกับความยั่งยืนของประเทศไทย แล้วแต่กรณี
      - กรณีเป็นตราสารส่งเสริมความยั่งยืน (sustainability - linked bond) ต้องมีการเปิดเผยข้อมูลเกี่ยวกับการกำหนดตัวชี้วัดและเป้าหมายด้านความยั่งยืนเพื่อส่งเสริมความยั่งยืนของผู้ออกตราสารดังกล่าวในประเทศไทย
    - พันธบัตรรัฐบาล พันธบัตรที่กระทรวงการคลังค้ำประกันต้นเงินและดอกเบี้ย หรือหุ้นกู้ที่กระทรวงการคลังค้ำประกันต้นเงินและดอกเบี้ยแต่ไม่รวมถึงหุ้นกู้แปลงสภาพ ซึ่งเป็นพันธบัตรหรือหุ้นกู้เพื่ออนุรักษ์สิ่งแวดล้อม (green bond) พันธบัตรหรือหุ้นกู้เพื่อความยั่งยืน (sustainability bond) หรือพันธบัตรหรือหุ้นกู้ส่งเสริมความยั่งยืน (sustainability - linked bond)
- ทั้งนี้ ในสภาวะปกติกองทุนจะลงทุนในทรัพย์สินที่มีความเสี่ยงสูงในสัดส่วนโดยเฉลี่ยรอบปีบัญชีไม่เกินร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน โดยทรัพย์สินที่มีความเสี่ยงสูง ได้แก่ หุ้น หน่วยลงทุนของกองทุนรวมอสังหาริมทรัพย์/REITs กองทุนรวมโครงสร้างพื้นฐาน หน่วย private equity เป็นต้น อย่างไรก็ตาม การลงทุนในหน่วยของกองทุนดังกล่าวจะลงทุนรวมกันโดยเฉลี่ยรอบปีบัญชีไม่เกินร้อยละ 20 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน

### เป้าหมายที่กองทุนรวมต้องการบรรลุ

กองทุนจะเน้นลงทุนในทรัพย์สินตามกรอบนโยบายการลงทุนที่ผู้ออกทรัพย์สินเป็นภาครัฐและ/หรือกิจการที่จัดตั้งขึ้นตามกฎหมายไทยที่มีการดำเนินธุรกิจที่สอดคล้องกับเป้าหมายการพัฒนาที่ยั่งยืน เพื่อสร้างผลตอบแทนที่ยั่งยืนให้กับผู้ลงทุน อีกทั้งเป็นแรงขับเคลื่อนให้กิจการที่มุ่งเน้นการดำเนินงานที่คำนึงถึงปัจจัยด้าน ESG มากขึ้น ส่งผลให้เกิดระบบนิเวศที่ยั่งยืนต่อระบบเศรษฐกิจ และเป็นแรงผลักดันให้ประเทศไทยบรรลุเป้าหมายการพัฒนาที่ยั่งยืน (Sustainable Development Goals: SDGs) ขององค์การสหประชาชาติ

### กรอบการลงทุน (Investment Universe)

กองทุนจะกระจายการลงทุนในหลักทรัพย์และ/หรือทรัพย์สิน ดังนี้

- ลงทุนในหุ้นของบริษัทจดทะเบียนใน SET และ/หรือ mai ดังนี้
  - หุ้นของบริษัทจดทะเบียนที่มีความโดดเด่นในการบริหารจัดการด้าน E หรือ ESG และ/หรือ
  - หุ้นของบริษัทจดทะเบียนที่มีการเปิดเผยข้อมูลเกี่ยวกับการปล่อยก๊าซเรือนกระจก แผนการจัดการ และการตั้งเป้าหมายเพื่อให้บรรลุเป้าหมายในการลดปริมาณการปล่อยก๊าซเรือนกระจกของประเทศไทย รวมทั้งจัดให้มีการทวนสอบการจัดทำคาร์บอนฟุตพริ้นท์โดยผู้ทวนสอบที่สำนักงาน ก.ล.ต. ยอมรับ และ/หรือ
  - หุ้นของบริษัทจดทะเบียนที่มีธรรมาภิบาล (Governance) ที่มีลักษณะตามที่ระบุไว้ในหัวข้อ “วัตถุประสงค์การลงทุนที่เกี่ยวกับความยั่งยืน” ข้อ 1 (3)
- ลงทุนในพันธบัตรรัฐบาล พันธบัตรที่กระทรวงการคลังค้ำประกันต้นเงินและดอกเบี้ย หรือหุ้นกู้ที่กระทรวงการคลังค้ำประกันต้นเงินและดอกเบี้ยแต่ไม่รวมถึงหุ้นกู้แปลงสภาพ หรือตราสารหนี้อื่นๆ ที่มีการเปิดเผยข้อมูลตามที่ระบุไว้ในหัวข้อ “วัตถุประสงค์การลงทุนที่เกี่ยวกับความยั่งยืน” ข้อ 2 (1) ทั้งนี้ การลงทุนในพันธบัตร หุ้นกู้ และตราสารหนี้ดังกล่าวจะต้องเป็น green bond sustainability bond หรือ sustainability-linked bond ที่ผู้ออกต้องการระดมทุนเพื่อนำเงินไปลงทุนหรือชำระหนี้สินเดิม (re-financing) ในโครงการที่เกี่ยวข้องกับการอนุรักษ์สิ่งแวดล้อม หรือความยั่งยืนของประเทศไทย หรือเป็นการส่งเสริมความยั่งยืนของผู้ออกตราสารดังกล่าวในประเทศไทย

การอ้างอิงดัชนีชี้วัดที่เกี่ยวกับความยั่งยืน

ตัวชี้วัดของกองทุนนี้ ได้แก่

- 1) ดัชนีผลตอบแทนรวมตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET TRI) เนื่องจากกองทุนมีวัตถุประสงค์ลงทุนในหุ้นของบริษัทจดทะเบียนที่คำนึงถึงด้าน E หรือ ESG และ/หรือด้านการช่วยลดผลกระทบจากการเปลี่ยนแปลงของสภาพภูมิอากาศโดยการลดปริมาณการปล่อยก๊าซเรือนกระจก และ/หรือด้านการมีธรรมาภิบาลตามกรอบนโยบายการลงทุน ดัชนีชี้วัดจึงควรประกอบด้วยหลักทรัพย์ที่สอดคล้องกับกรอบการลงทุนด้านความยั่งยืนซึ่งในปัจจุบันไม่มีดัชนีที่เกี่ยวกับความยั่งยืนที่ครอบคลุมกรอบการลงทุนของกองทุน ดังนั้น ดัชนี SET TRI ซึ่งประกอบด้วยหุ้นของบริษัทจดทะเบียนทั้งหมดและจัดทำขึ้นโดย SET จึงเป็นดัชนีที่เหมาะสมภายใต้กรอบการลงทุนด้านความยั่งยืนของกองทุน อีกทั้งบริษัทที่เป็นองค์ประกอบของดัชนี SET TRI เป็นบริษัทที่มีสภาพคล่องตามหลักเกณฑ์ที่ SET กำหนด และมีการเปิดเผยข้อมูลเพื่อนำไปใช้ในการวิเคราะห์ได้อย่างเพียงพอ
- ผู้ลงทุนสามารถศึกษาคุณลักษณะและองค์ประกอบของดัชนี รวมถึงวิธีการจัดทำดัชนีดังกล่าวได้ที่ <https://www.set.or.th/th/market/index/tri/profile>
- 2) ThaiBMA Government Bond ESG Index Net Total Return เนื่องจากเป็นดัชนีที่รวมตราสารหนี้ ESG ที่ออกโดยภาครัฐที่ขึ้นทะเบียนกับสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทยเป็นองค์ประกอบ จึงเป็นดัชนีที่เหมาะสมสอดคล้องกับวัตถุประสงค์และเป้าหมายด้านความยั่งยืนของกองทุน
- ผู้ลงทุนสามารถศึกษาคุณลักษณะและองค์ประกอบของดัชนี รวมถึงวิธีการจัดทำดัชนีดังกล่าวได้ที่สมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย หรือ <https://www.thaibma.or.th/pdf/Article/esgBondIndex.pdf>
- แหล่งข้อมูล: <https://www.thaibma.or.th/EN/Market/Index/ESGIndex.aspx>
- 3) ผลตอบแทนรวมของดัชนีพันธบัตรรัฐบาลระยะสั้นของสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย เนื่องจากเป็นดัชนีที่รวมตราสารหนี้ประเภทพันธบัตรรัฐบาลระยะสั้นที่ออกโดยกระทรวงการคลังและธนาคารแห่งประเทศไทยและมีอายุไม่เกิน 1 ปีเป็นองค์ประกอบ จึงเป็นดัชนีที่สะท้อนการลงทุนเพื่อเพิ่มโอกาสในสร้างผลตอบแทนของกองทุน
- ผู้ลงทุนสามารถศึกษาคุณลักษณะและองค์ประกอบของดัชนี รวมถึงวิธีการจัดทำดัชนีดังกล่าวได้ที่สมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย หรือ [https://www.thaibma.or.th/pdf/remark\\_ThaiBMA/ShorttermGovernmentBondIndex.pdf](https://www.thaibma.or.th/pdf/remark_ThaiBMA/ShorttermGovernmentBondIndex.pdf)
- แหล่งข้อมูล: <https://www.thaibma.or.th/EN/Market/Index/ShortTermIndex.aspx>

คำเตือนเพิ่มเติม

- ในกรณีที่เกิดเหตุการณ์ซึ่งสำนักงาน ก.ล.ต. กำหนดให้ต้องเลิกกองทุน บริษัทจัดการจะโอนย้ายการลงทุนไปยังกองทุนรวมไทยเพื่อความยั่งยืนอื่น ตามที่บริษัทจัดการเห็นสมควร
- การลงทุนในกองทุนรวมนี้ หากประสงค์นำไปใช้เพื่อสิทธิประโยชน์ทางภาษีต้องลงทุนให้เป็นไปตามเงื่อนไขของสรรพากร ทั้งข้อกำหนดและเงื่อนไขการลงทุนของกองทุนรวมไทยเพื่อความยั่งยืน

คำอธิบาย

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

**Recovering Period** ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาดังแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลานานเท่าใด

**FX Hedging** เปรี่อเช่นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

**อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน** ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตกองทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลาหนึ่ง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 1 ปีหารด้วยมูลค่า NAV ของกองทุนรวมเฉลี่ยในรอบระยะเวลาเดียวกัน กองทุนรวมที่มีค่า portfolio turnover สูง บ่งชี้ถึงการซื้อขายหลักทรัพย์บ่อยครั้งของผู้จัดการกองทุนและทำให้มีต้นทุนการซื้อขายหลักทรัพย์ที่สูง จึงต้องพิจารณาเปรียบเทียบกับผลการดำเนินงานของกองทุนรวม

เพื่อประเมินความคุ้มค่าของการซื้อขายหลักทรัพย์ดังกล่าว

**Sharpe Ratio** อัตราส่วนระหว่างผลตอบแทนส่วนเพิ่มของกองทุนรวมเปรียบเทียบกับความเสี่ยงจากการลงทุน โดยคำนวณจากผลต่างระหว่างอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมกับอัตราผลตอบแทนที่ปราศจากความเสี่ยง (risk-free rate) เปรียบเทียบกับค่าเบี่ยงเบนมาตรฐาน (standard deviation) ของกองทุนรวม ค่า Sharpe Ratio สะท้อนถึงอัตราผลตอบแทนที่กองทุนรวมควรได้รับเพิ่มขึ้นเพื่อชดเชยกับความเสี่ยงที่กองทุนรวมรับมา โดยกองทุนรวมที่มีค่า Sharpe Ratio สูงกว่าจะเป็นกองทุนที่มีประสิทธิภาพในการบริหารจัดการกองทุนที่ดีกว่าเนื่องจากได้รับผลตอบแทนส่วนเพิ่มที่สูงกว่าภายใต้ระดับความเสี่ยงเดียวกัน

**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 หมายถึง กองทุนรวมมีประสิทธิภาพในการสร้างผลตอบแทนให้ใกล้เคียงกับดัชนีชี้วัด กองทุนรวมที่มีค่า tracking error สูง จะมีอัตราผลตอบแทนโดยเฉลี่ยห่างจากดัชนีชี้วัดมากขึ้น

**Yield to Maturity** อัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในตราสารหนี้โดยถือจนครบกำหนดอายุ ซึ่งคำนวณจากดอกเบี้ยที่จะได้รับในอนาคตตลอดอายุตราสารและเงินต้นที่จะได้รับคืนนำมาคิดลดเป็นมูลค่าปัจจุบัน โดยใช้ตัวอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมตราสารหนี้ คำนวณจากค่าเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักของ Yield to Maturity ของตราสารหนี้แต่ละตัวที่กองทุนมีการลงทุน และเนื่องจาก Yield to Maturity มีหน่วยมาตรฐานเป็นเปอร์เซ็นต์ต่อปี จึงสามารถนำไปใช้เปรียบเทียบอัตราผลตอบแทนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีนโยบายถือครองตราสารหนี้จนครบกำหนดอายุและมีลักษณะการลงทุนที่ใกล้เคียงกันได้

ผู้สนับสนุนการขายหรือรับซื้อคืน:

- ☒ บมจ.ธนาคารกรุงเทพ โทร. 1333
- ☒ บมจ.หลักทรัพย์ บัวหลวง โทร. 0-2231-3777 และ 0-2618-1000
- ☒ บมจ.กรุงเทพประกันชีวิต โทร. 0-2777-8999
- ☒ บจ.หลักทรัพย์ เอเซีย พลัส โทร. 0-2680-1234
- ☒ บมจ.หลักทรัพย์ ฟิลลิป (ประเทศไทย) โทร. 0-2635-1700
- ☒ บมจ.หลักทรัพย์ เกียรตินาคินภัทร โทร. 0-2305-9449
- ☒ บจ.หลักทรัพย์ ดีบีเอส วิกเคอร์ส (ประเทศไทย) โทร. 0-2657-7000
- ☒ บมจ.หลักทรัพย์ กรุงศรี โทร. 0-2659-7000
- ☒ บจ.หลักทรัพย์นายหน้าซื้อขายหน่วยลงทุน ฟินโนมีนา โทร. 0-2026-5100 กด 1
- ☒ บจ.หลักทรัพย์ อินโนเวสต์ เอชซี โทร. 0-2949-1000
- ☒ บมจ.หลักทรัพย์ เคจีโอ (ประเทศไทย) โทร. 0-2658-8889
- ☒ บจ.หลักทรัพย์ โพน์ เวลท์ โซลูชั่น โทร. 0-2095-8999
- ☒ บจ.หลักทรัพย์ หยวนต้า (ประเทศไทย) 0-2009-8000
- ☒ บจ.หลักทรัพย์ เคเคพี ไดม์ Line: @dime.finance Email: contact@dime.co.th
- ☒ บมจ.หลักทรัพย์ คาโอ (ประเทศไทย) โทร. 0-2351-1800
- ☒ บมจ.หลักทรัพย์ เมย์แบงก์ (ประเทศไทย) โทร. 0-2658-5050
- ☒ บมจ.หลักทรัพย์ กลีกรไทย โทร. 0-2796-0011

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนรวม บัวหลวง จำกัด

เลขที่ 175 อาคารสารคดีห้าดาวเวอร์ ชั้น 7 ชั้น 21 และ ชั้น 26  
ถนนสาทรใต้ แขวงทุ่งมหาเมฆ เขตสาทร กรุงเทพมหานคร 10120  
โทร. 0-2674-6488 Website: [www.bblam.co.th](http://www.bblam.co.th) Email: [crm@bblam.co.th](mailto:crm@bblam.co.th)