บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน เอ็มเอฟซี จำกัด (มหาชน)

กองทุนเปิดเอ็มเอฟซีเฟล็กซิเบิลไทยเพื่อความยั่งยืน

MFC Flexible Thailand ESG Fund

MFLEX-ThaiESG

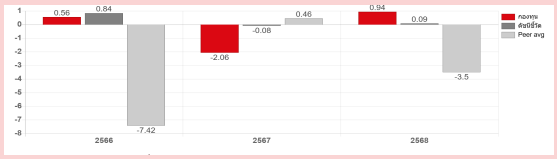
ประเภทกองทุนรวม/กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมผสม/ กองทุนรวมไทยเพื่อความยั่งยืน (Thailand ESG Fund)/ กองทุนรวมเพื่อความยั่งยืน (SRI Fund)
- กลุ่มกองทุนรวม : Aggressive Allocation
- กลยุทธ์การลงทุน : ESG Screening และ ESG Integration

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- ลงทุนในตราสารทุน ตราสารหนี้ และ/หรือเงินฝาก โดยจะเน้นลงทุนในทรัพย์สินที่ผู้ออกเป็นภาครัฐไทยหรือกิจการที่จัดตั้งขึ้นตามกฎหมายไทย โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของ NAV ซึ่งในสภาวะปกติกองทุนจะลงทุนในทรัพย์สินที่มีความเสี่ยงสูงในสัดส่วนไม่เกินร้อยละ 80 ของ NAV โดยทรัพย์สินที่มีความเสี่ยงสูง ได้แก่ หุ้น หรือโทเคนดิจิทัลเพื่อการลงทุน (investment token) เป็นต้น ทั้งนี้ ทรัพย์สินที่จะลงทุนจะเป็นทรัพย์สินอย่างใดอย่างหนึ่งหรือหลายอย่างดังต่อไปนี้ โดยสัดส่วนการลงทุนตามนโยบายดังกล่าวขึ้นอยู่กับดุลยพินิจของผู้จัดการกองทุนและตามความเหมาะสมกับสภาวการณ์ในแต่ละขณะ
  1. หุ้นที่จดทะเบียนใน SET และ/หรือ mai ที่มีความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน (Environmental, Social and Governance: ESG)
  2. หุ้นที่จดทะเบียนใน SET และ/หรือ mai ที่มีเป้าหมายเพื่อลดปริมาณการปล่อยก๊าซเรือนกระจก
  3. หุ้นที่จดทะเบียนใน SET และ/หรือ mai ที่มีลักษณะดังนี้
  3.1 เป็นหุ้นของบริษัทจดทะเบียนที่มีธรรมาภิบาล (Governance) โดยได้รับการประเมินการกำกับดูแลกิจการบริษัทจดทะเบียน (CGR) จากสมาคมส่งเสริมสถาบันกรรมการบริษัทไทย ตั้งแต่ 90 คะแนนขึ้นไป หรือเทียบเท่า
  3.2 มีการเปิดเผยเป้าหมายและแผนธุรกิจ/แผนการยกระดับ และรายงานความคืบหน้าการปฏิบัติตามเป้าหมายหรือแผน ผ่านช่องทางของ SET
  3.3 มีการเพิ่มประสิทธิภาพการสื่อสารกับผู้ลงทุน ตามที่ SET กำหนด
  4. ตราสารอย่างใดอย่างหนึ่งหรือหลายอย่าง ดังนี้
  4.1 ตราสารเพื่ออนุรักษ์สิ่งแวดล้อม (green bond) ตราสารเพื่อความยั่งยืน (sustainability bond) หรือตราสารส่งเสริมความยั่งยืน (sustainability - linked bond)
  4.2 พันธบัตรหรือหุ้นกู้เพื่ออนุรักษ์สิ่งแวดล้อม (green bond) พันธบัตรหรือหุ้นกู้เพื่อความยั่งยืน (sustainability bond) หรือพันธบัตรหรือหุ้นกู้ส่งเสริมความยั่งยืน (sustainability - linked bond) แต่ไม่รวมถึงหุ้นกู้แปลงสภาพ
  5. โทเคนดิจิทัลเพื่อการลงทุน (investment token) ที่ออกตามพระราชกำหนดว่าด้วยการประกอบธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัล ที่เป็นโทเคนดิจิทัลสำหรับโครงการอนุรักษ์สิ่งแวดล้อม โทเคนดิจิทัลสำหรับโครงการที่เกี่ยวข้องด้านความยั่งยืน หรือโทเคนดิจิทัลเพื่อส่งเสริมความยั่งยืน
- กองทุนมีกลยุทธ์การลงทุนเพื่อมุ่งหวังให้ผลประกอบการเคลื่อนไหวสูงกว่าดัชนีชี้วัด (active management) โดยมีการบริหารจัดการในเชิงรุก ซึ่งมีวัตถุประสงค์ที่จะอ้างอิงดัชนีชี้วัดเพื่อเปรียบเทียบกับผลการดำเนินงานของกองทุนรวม (Performance Objective)

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (%ต่อปี)



ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด (%ต่อปี)

	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี
กองทุน	17.75	3.90	11.12	17.67
ดัชนีชี้วัด	20.09	3.63	11.48	19.93
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	17.81	1.01	10.05	17.29
ความผันผวนกองทุน	11.65	8.60	8.62	11.13
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	11.27	8.34	8.23	10.71

	3 ปี	5 ปี	10 ปี	ตั้งแต่จัดตั้ง
กองทุน	-	-	-	5.84
ดัชนีชี้วัด	-	-	-	6.72
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	-	-	-	-
ความผันผวนกองทุน	-	-	-	11.08
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	-	-	-	11.19

* ผลตอบแทนที่มีอายุเกินหนึ่งปีจะแสดงเป็นผลตอบแทนต่อปี

ระดับความเสี่ยง

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

เสี่ยงปานกลางค่อนข้างสูง

ลงทุนในตราสารทุน ตราสารหนี้ และ investment token โดยเฉลี่ยในรอบปีไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม :

วันจดทะเบียนกองทุน	21 ธ.ค. 2566
นโยบายการจ่ายเงินปันผล	จ่าย
อายุกองทุน	ไม่กำหนดอายุโครงการ
การเรียกเก็บค่าธรรมเนียมตามผลการดำเนินงาน	ไม่มี

ผู้จัดการกองทุนรวม :

- นางอนุททยา สิทธิศุข (ตั้งแต่ 21 ธ.ค. 2566)
- นายพิพัฒน์ นรานันทน์ (ตั้งแต่ 21 ธ.ค. 2566)

ดัชนีชี้วัด :

1. ดัชนีผลตอบแทนรวม SET ESG (SETESG TRI) สัดส่วน 70%
2. ดัชนี ThaiBMA ESG Bond Index สัดส่วน 30%

คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวม มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต : ได้รับการรับรองจาก CAC

จัดอันดับกองทุน Morningstar :

ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือบริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่องได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

www.mfcfund.com

การซื้อหน่วยลงทุน		การขายคืนหน่วยลงทุน	
วันทำการซื้อ :	ทุกวันทำการ	วันทำการขายคืน :	ทุกวันทำการ
เวลาทำการ :	08:30 - 15:30 น.	เวลาทำการ :	08:30 - 15:30 น.
การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ :	500 บาท	การขายคืนขั้นต่ำ :	ไม่กำหนด
การซื้อครั้งถัดไปขั้นต่ำ :	500 บาท	ยอดคงเหลือขั้นต่ำ :	ไม่กำหนด
		ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน :	T+5*

หมายเหตุ:

- T+5 คือ 5 วันทำการหลังจากวันทำรายการขายคืน (ปัจจุบัน 3 วันทำการหลังจากวันทำรายการขายคืน)

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)

ค่าธรรมเนียมต่อไปนี้จะส่งผลกระทบต่อผู้ลงทุน เนื่องจากจะทำให้ผลตอบแทนจากการลงทุนลดลง ดังนั้น ผู้ลงทุนควรตรวจสอบทุกครั้งก่อนตัดสินใจลงทุน

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	2.1400	1.6050
ค่าตอบแทนแก่ตัวแทนขายหน่วยลงทุนของกองทุนรวม (trailer fee) : มี		
รวมค่าใช้จ่าย	4.8899	1.7683

หมายเหตุ:

- ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว
- การรวมค่าใช้จ่ายที่เก็บจริง คิดตามรอบปีบัญชีของกองทุน (ไม่รวมค่าภาษีเงินได้นิติบุคคล)

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)

ผู้ลงทุนจะถูกเรียกเก็บค่าธรรมเนียมต่อไปนี้โดยตรงทุกครั้งเมื่อทำรายการซื้อขายหรือสับเปลี่ยนหน่วยลงทุน

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การขาย	2.00	ไม่มี
การรับซื้อคืน	2.00	0.50
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า	ไม่มี	ดูหมายเหตุเพิ่มเติม
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก	ไม่มี	ดูหมายเหตุเพิ่มเติม
การโอนหน่วย	ไม่มี	ไม่มี

หมายเหตุ :

- ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว
- บริษัทจัดการขอสงวนสิทธิในการคิดค่าธรรมเนียมการขายหน่วยลงทุนและ/หรือค่าธรรมเนียมการรับซื้อคืนหน่วยลงทุนกับผู้สั่งซื้อหรือผู้ถือหน่วยลงทุนแต่ละกลุ่มไม่เท่ากันได้
- ค่าธรรมเนียมการรับซื้อคืน กรณีถือครองต่ำกว่า 5 ปี เก็บ 0.50% ถือครองครบ 5 ปี ไม่เก็บ
- ผู้ถือหน่วยลงทุนจะสับเปลี่ยนเข้าที่ราคาขาย ซึ่งเท่ากับ มูลค่าหน่วยลงทุนที่ใช้เพื่อการคำนวณราคาขาย + ค่าธรรมเนียมการขาย (ถ้ามี)
- ผู้ถือหน่วยลงทุนจะสับเปลี่ยนออกที่ราคารับซื้อคืน ซึ่งเท่ากับ มูลค่าหน่วยลงทุนที่ใช้เพื่อการคำนวณราคารับซื้อคืน - ค่าธรรมเนียมการรับซื้อคืน (ถ้ามี)
- ผู้ถือหน่วยลงทุนสามารถโอนย้ายหน่วยลงทุนมายังกองทุนรวมไทยเพื่อความยั่งยืนภายใต้การจัดการของ บลจ. ได้ โดยมีค่าธรรมเนียม เท่ากับ มูลค่าหน่วยลงทุนที่ใช้เพื่อการคำนวณราคาขาย + ค่าธรรมเนียมการขาย (ถ้ามี)
- ผู้ถือหน่วยลงทุนสามารถโอนย้ายหน่วยลงทุนไปยังกองทุนรวมไทยเพื่อความยั่งยืนภายใต้การจัดการของ บลจ.อื่น ได้ โดยมีค่าธรรมเนียม (คิดจริง) 0.50% ของมูลค่าหน่วยลงทุนของวันทำการล่าสุดก่อนวันทำรายการโอนย้าย (วัน T-1)
- ผู้ถือหน่วยลงทุนไม่สามารถนำหน่วยลงทุนของกองทุนรวมไทยเพื่อความยั่งยืนไปจำหน่าย โอน จำนำ หรือนำไปเป็นหลักประกันได้ ทั้งนี้เพื่อให้เป็นไปตามที่กฎหมายกำหนด
- บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ

ข้อมูลเชิงสถิติ

Maximum Drawdown	-17.91%
Recovering Period	10 เดือน 7 วัน
Sharpe Ratio	0.51
Alpha	-0.89%
Beta	0.58
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน	0.82 เท่า

การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม 5 อันดับแรก

กลุ่มอุตสาหกรรม	%NAV
ธนาคาร	18.47
พลังงาน	17.01
พาณิชย์	4.92
ขนส่ง	4.47
พัฒนาอสังหาริมทรัพย์	4.11

ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก

Holding	%NAV
พันธบัตรรัฐบาลเพื่อความยั่งยืนสำหรับปรับโครงสร้างหนี้(พ.ร.ก.กู้เงินโควิด-19) ในปีงบประมาณ พ.ศ.2565 ครั้งที่ 5	12.36
บมจ.ปตท.	4.28
บมจ.เอสซีบี เอกซ์	4.11
ธนาคารกรุงไทย จำกัด (มหาชน)	3.90
พันธบัตรรัฐบาลส่งเสริมความยั่งยืน ในปีงบประมาณ พ.ศ. 2568 ครั้งที่ 1	3.85

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน

Breakdown	%NAV
ตราสารทุน	70.23
ตราสารหนี้ภาครัฐ	25.30
เงินฝากธนาคาร และอื่นๆ	4.47

ข้อมูลอื่นๆ

สรุปข้อมูลด้านความยั่งยืน (Sustainability Corner)

(1) ประเภทของกองทุนรวมและเกณฑ์การพิจารณาโดยสรุป	
ประเภท SRI ตามวัตถุประสงค์	SRI Focus
เกณฑ์การพิจารณาโดยสรุป	กองทุนนี้เน้นคัดเลือกลงทุนในหลักทรัพย์ที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET) หรือตลาดหลักทรัพย์เอ็มเอไอ (mai) ที่มีความโดดเด่นด้าน ESG ด้านสิ่งแวดล้อม หรือ ด้านธรรมาภิบาล โดยจะเน้นลงทุนหุ้นที่ผ่านเงื่อนไขอย่างน้อย 1 ข้อ ได้แก่ มีผลประเมิน SET ESG Ratings หรือจากผู้ประเมินที่เป็นที่ยอมรับในระดับสากล, มีการเปิดเผยข้อมูลก๊าซเรือนกระจก, ได้รับคะแนน CGR ในระดับดีเลิศ (5 ดาว) หรือ มีการเข้าร่วมโครงการส่งเสริมการเพิ่มมูลค่าของบริษัทจดทะเบียน (JUMP+) กองทุนจะคัดเลือกลงทุนในตราสารเพื่ออนุรักษ์สิ่งแวดล้อม (green bond) ตราสารเพื่อความยั่งยืน (sustainability bond) หรือตราสารส่งเสริมความยั่งยืน (sustainability - linked bond) ที่มีการเปิดเผยข้อมูล ตามที่สำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ต. กำหนด หรือพันธบัตรหรือหุ้นกู้เพื่ออนุรักษ์สิ่งแวดล้อม (green bond) หรือพันธบัตรหรือหุ้นกู้เพื่อความยั่งยืน (sustainability bond) หรือพันธบัตรหรือหุ้นกู้ส่งเสริมความยั่งยืน (sustainability - linked bond) ที่ผ่านหลักเกณฑ์การคัดเลือกหลักทรัพย์ของบริษัทจัดการ เช่น มีการเปิดเผยวัตถุประสงค์การใช้เงินที่ได้จากการระดมทุน (use of proceeds) ว่าเป็นไปเพื่อโครงการที่เกี่ยวข้องกับการอนุรักษ์สิ่งแวดล้อมหรือเพื่อโครงการที่เกี่ยวข้องกับความยั่งยืนของประเทศไทย
(2) เป้าหมายด้านความยั่งยืน	
กองทุนไม่มีเป้าหมายด้านความยั่งยืนแบบเฉพาะเจาะจง โดยกองทุนจะเน้นลงทุนในหลักทรัพย์ที่สอดคล้องกับหลักเกณฑ์การลงทุน เพื่อสร้างพอร์ตการลงทุนที่ประกอบด้วยผู้ที่มีความโดดเด่นด้าน ESG	
(3) กลยุทธ์การลงทุน (เพื่อการบรรลุวัตถุประสงค์ด้านความยั่งยืน)	
กลยุทธ์ (เลือกได้มากกว่า 1)	☑ ESG integration ☑ Positive screening
เหตุผลและหลักการที่เลือกใช้กลยุทธ์ดังกล่าว	**1 . การวิเคราะห์หลักทรัพย์ด้วยปัจจัย ESG Integration** การวิเคราะห์หลักทรัพย์ของกองทุน ผสานจุดแข็งของบริษัทจัดการด้านการวิเคราะห์ปัจจัยพื้นฐานเชิงลึก ผนวกกับปัจจัยด้านสิ่งแวดล้อม สังคม และธรรมาภิบาลที่มีนัยสำคัญทางการเงิน (Financially Material) เพื่อเสริมมิติการวิเคราะห์โอกาสและความเสี่ยงที่เกี่ยวข้องกับปัจจัย ESG ที่อาจส่งผลต่อภาพรวมผลการดำเนินงานและความเสี่ยง ทั้งในระยะสั้นและในระยะยาวที่อาจนานกว่ากรอบการลงทุนของกองทุน นอกจากนี้ บริษัทจัดการมีกระบวนการวิเคราะห์และคัดเลือกตราสารผ่านการใช้ข้อมูลจากแหล่งข้อมูลที่น่าเชื่อถือ เช่นสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย รวมทั้งแหล่งข้อมูลภายนอกอื่นๆ เพื่อคัดเลือกตราสารที่จะลงทุนให้สอดคล้องกับวัตถุประสงค์การลงทุนของกองทุน โดยผู้จัดการกองทุนจะทำการวิเคราะห์กลยุทธ์ แผนการดำเนินงาน ฐานะทางการเงิน ความสามารถในการชำระหนี้ ผลกระทบต่อกำไรหรือผลการดำเนินงาน อันดับความน่าเชื่อถือของตราสาร ผู้ออกตราสาร รวมถึงวิเคราะห์โครงการที่จะนำเงินลงทุนไปใช้ เพื่อให้มั่นใจว่าเป็นโครงการที่เกี่ยวข้องกับการอนุรักษ์สิ่งแวดล้อมหรือความยั่งยืนของประเทศไทยอย่างแท้จริง **2. การคัดกรองเชิงบวก (Positive Screening) :** กองทุนมีกระบวนการคัดกรองหลักทรัพย์เชิงบวก โดยพิจารณาลงทุนในหลักทรัพย์ที่มีความโดดเด่นด้าน ESG และ/หรือ มีการเปิดเผยข้อมูลก๊าซเรือนกระจกอย่างชัดเจน และ/หรือ มี Governance ระดับดีเลิศ และ/หรือ มีการเข้าร่วมโครงการส่งเสริมการเพิ่มมูลค่าของบริษัทจดทะเบียน (JUMP+) โดยมีเหตุผลและหลักการที่เลือกใช้กลยุทธ์ดังนี้ • เพื่อสนับสนุนหลักทรัพย์ของกิจการที่ตระหนักถึงความสำคัญของปัจจัยด้านสิ่งแวดล้อม สังคม และบรรษัทภิบาล (ESG) และสนับสนุนบทบาทเชิงรุกของกองทุนในการขับเคลื่อนระบบเศรษฐกิจภาพรวมให้เปลี่ยนผ่านไปสู่การเติบโตที่มีความรับผิดชอบและยั่งยืน • เพื่อขยายขอบเขตการจัดสรรสินทรัพย์ไปยังหลักทรัพย์ที่มีมาตรฐาน ESG ในหลากหลายมิติ ซึ่งจะทำหน้าที่เป็นกลไกกระจายความเสี่ยงเพื่อลดทอนผลกระทบจากปัจจัยลบเฉพาะตัวของกิจการ และเสริมสร้างเสถียรภาพโดยรวมของพอร์ตการลงทุนได้อย่างมีประสิทธิภาพ • เพื่อสร้างผลตอบแทนระยะยาวที่มั่นคงและยั่งยืน ผ่านการคัดเลือกลงทุนในกิจการที่มีความโดดเด่นด้าน ESG ซึ่งมีศักยภาพในการเติบโตอย่างต่อเนื่อง เพื่อรักษาและสร้างประโยชน์สูงสุดให้แก่ผู้ถือหน่วยลงทุน และกองทุนมีกระบวนการคัดกรองการลงทุนที่เป็นตราสารเพื่ออนุรักษ์สิ่งแวดล้อม(green bond) ตราสารเพื่อความยั่งยืน (sustainability bond) หรือตราสารส่งเสริมความยั่งยืน(sustainability - linked bond) ที่มีการเปิดเผยข้อมูลตามที่สำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ต. กำหนด หรือพันธบัตรหรือหุ้นกู้เพื่ออนุรักษ์สิ่งแวดล้อม (green bond) พันธบัตรหรือหุ้นกู้เพื่อความยั่งยืน (sustainability bond) หรือพันธบัตรหรือหุ้นกู้ส่งเสริมความยั่งยืน (sustainability - linked bond)
(4) กรอบการลงทุน	
ลักษณะ/ขอบเขตการลงทุนหลัก	กองทุนมีนโยบายเน้นลงทุนในหลักทรัพย์และ/หรือทรัพย์สินที่เกี่ยวข้องกับความยั่งยืน โดยมีสัดส่วนการลงทุนสุทธิ (Net Exposure) ในทรัพย์สินกลุ่มความยั่งยืนที่มีลักษณะเป็นไปตามหลักเกณฑ์ที่สำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ต. กำหนด รวมกันโดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุนรวม (NAV)

	ทั้งนี้ ผู้ออกหลักทรัพย์ต้องเป็นบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยหรือตลาดหลักทรัพย์ เอ็ม เอ ไอ ที่มีการเปิดเผยข้อมูลด้านสิ่งแวดล้อม สังคม และบรรษัทภิบาล (ESG) และ/หรือ ข้อมูลการปล่อยก๊าซเรือนกระจกที่เพียงพอสำหรับการวิเคราะห์การลงทุน ซึ่งต้องมีคุณสมบัติสอดคล้องกับเกณฑ์ข้อใดข้อหนึ่งหรือหลายข้อดังต่อไปนี้: 1. หลักทรัพย์ที่มีความโดดเด่นด้านความยั่งยืน: หุ้นของบริษัทจดทะเบียนที่ได้รับการคัดเลือกจากตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยหรือจากผู้ประเมินที่เป็นที่ยอมรับในระดับสากล ว่ามีความโดดเด่นในการบริหารจัดการด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน (Environmental, Social and Governance: ESG) 2. หลักทรัพย์ที่มีแผนการลดก๊าซเรือนกระจก: หุ้นของบริษัทจดทะเบียนที่มีการเปิดเผยข้อมูลปริมาณการปล่อยก๊าซเรือนกระจก แผนการบริหารจัดการ และการตั้งเป้าหมายการดำเนินงานเพื่อร่วมบรรลุเป้าหมายการลดการปล่อยก๊าซเรือนกระจกของประเทศไทย 3. หลักทรัพย์ที่มีบรรษัทภิบาลระดับดีเลิศและมีแผนยกระดับสิ่งแวดล้อม: หุ้นของบริษัทจดทะเบียนที่ได้รับการประเมินการกำกับดูแลกิจการ (CGR) จากสมาคมส่งเสริมสถาบันกรรมการบริษัทไทย (IOD) ตั้งแต่ 90 คะแนนขึ้นไป (ระดับดีเลิศ) หรือเทียบเท่า ซึ่งมีการเปิดเผยแผนการเพิ่มมูลค่าของกิจการ ตลอดจนเป้าหมายและแผนการยกระดับการดำเนินงานด้านสิ่งแวดล้อมให้แล้วเสร็จภายในกรอบระยะเวลา 2 ปี 4. หลักทรัพย์ในโครงการส่งเสริมการเพิ่มมูลค่ากิจการ: หุ้นของบริษัทจดทะเบียนที่เข้าร่วมโครงการส่งเสริมการเพิ่มมูลค่าของบริษัทจดทะเบียน (JUMP+) ของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย และได้มีการเปิดเผยเป้าหมายรวมถึงแผนการดำเนินงานตามโครงการดังกล่าวอย่างชัดเจน และกองทุนจะลงทุนในตราสารเพื่ออนุรักษ์สิ่งแวดล้อม (green bond) ตราสารเพื่อความยั่งยืน (sustainability bond) หรือตราสารส่งเสริมความยั่งยืน (sustainability - linked bond) ที่มีการเปิดเผยข้อมูลตามที่สำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ต. กำหนด หรือพันธบัตรหรือหุ้นกู้เพื่ออนุรักษ์สิ่งแวดล้อม (green bond) พันธบัตรหรือหุ้นกู้เพื่อความยั่งยืน (sustainability bond) หรือพันธบัตรหรือหุ้นกู้ส่งเสริมความยั่งยืน (sustainability - linked bond) ซึ่งผ่านกระบวนการวิเคราะห์การลงทุนแบบ ESG Integration

คำอธิบาย

- **Maximum Drawdown:** เปอร์เซ็นต์ผลขาดทุนสูงสุดของกองทุนรวมในระยะเวลา 5 ปีย้อนหลัง (หรือตั้งแต่จัดตั้งกองทุนกรณีที่ยังไม่ครบ 5 ปี) โดยวัดจากระดับ NAV ต่อหน่วยที่จุดสูงสุดไปจนถึงจุดต่ำสุดในช่วงที่ NAV ต่อหน่วยปรับตัวลดลง ค่า Maximum Drawdown เป็นข้อมูลที่ช่วยให้ทราบถึงความเสี่ยงที่อาจจะขาดทุน จากการลงทุนในกองทุนรวม
- **Recovering Period:** ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาตั้งแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลานานเท่าใด
- **FX Hedging:** เปอร์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน
- **อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน:** ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตกองทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลาหนึ่ง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อหลักทรัพย์กับผลรวมของมูลค่าการขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 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:** อัตราผลตอบแทนของกองทุนมีประสิทธิภาพในการเลียนแบบดัชนีชี้วัด 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

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน เอ็มเอฟซี จำกัด (มหาชน)
เลขที่ 195 อาคารวัน แบงค็อก ทาวเวอร์ 4 ชั้นที่ 16-17
ถนนวิทยุ แขวงลุมพินี เขตปทุมวัน กรุงเทพมหานคร 10330
โทรศัพท์ : 0-2649-2000 **www.mfcfund.com**