ประกาศ

การแก้ไขเพิ่มเติมรายละเอียดโครงการจัดการกองทุน จำนวน 3 กองทุน
กองทุนเปิด MEGA 20 ไทยเพื่อความยั่งยืน (MEGA20THAIESG)
กองทุนเปิด MEGA 20 ไทยเพื่อความยั่งยืนแบบพิเศษ 80-20 C (MEGATX8020C)
กองทุนเปิด MEGA 20 ไทยเพื่อความยั่งยืนแบบพิเศษ 80-20 U (MEGATX8020U)

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ทาลิส จำกัด (“บริษัทจัดการ”) ในฐานะบริษัทจัดการกองทุนเปิด MEGA 20 ไทยเพื่อความยั่งยืน (MEGA20THAIESG) กองทุนเปิด MEGA 20 ไทยเพื่อความยั่งยืนแบบพิเศษ 80-20 C (MEGATX8020C) และกองทุนเปิด MEGA 20 ไทยเพื่อความยั่งยืนแบบพิเศษ 80-20 U (MEGATX8020U) (รวมเรียกว่า “กองทุน”) ขอเรียนให้ท่านผู้ถือหน่วยลงทุนทราบว่า บริษัทจัดการได้รับความเห็นชอบจากสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ (สำนักงาน ก.ล.ต.) เมื่อวันที่ 29 ตุลาคม 2569 ให้แก้ไขเพิ่มเติมโครงการจัดการกองทุนดังกล่าว โดยมีรายละเอียดดังนี้

1. กำหนดให้ FTSE INTERNATIONAL LIMITED (“FTSE Russell” หรือ “ผู้ประเมินฯ”) เป็นผู้ประเมินผลการดำเนินงานด้านความยั่งยืนตามมาตรฐานสากลของกองทุน ซึ่งการกำหนดผู้ประเมินฯข้างต้น ต้องปรับหลักเกณฑ์การคัดเลือกหลักทรัพย์ให้สอดคล้องกับหลักเกณฑ์และชื่อเรียกเฉพาะของผู้ประเมินฯ จากหลักทรัพยที่ได้รับการประเมินผลการดำเนินงานหรือผลคะแนนด้านความยั่งยืน (ESG Rating/Score) ในระดับ AA หรือเทียบเท่าขึ้นไป เป็นได้รับ FTSE ESG Scores ในระดับตั้งแต่ 3.0 ขึ้นไป ซึ่งเป็นระดับคะแนนที่แสดงถึงบริษัทที่มีการดำเนินงานด้านความยั่งยืนในระดับดีที่ปฏิบัติตามมาตรฐานสากล (Good Practice) ทั้งนี้ การแก้ไขเพิ่มเติมดังกล่าวไม่กระทบต่อนโยบายการลงทุนหลักในส่วนอื่น ๆ ของกองทุน
2. กำหนด SET100 Free Float Adjusted Market Capitalization Weighted Index (SET100FF Index) เป็นดัชนีชี้วัดผลการดำเนินงาน (Performance benchmark) ของกองทุน (ในส่วนการลงทุนในหุ้นบริษัทจดทะเบียนฯ) โดยไม่รวมถึงการเป็นดัชนีชี้วัดด้านความยั่งยืน (Reference ESG benchmark) ที่เป็นภาคสมัครใจของบริษัทจัดการ

การแก้ไขเพิ่มเติมรายละเอียดโครงการข้างต้น ให้มีผลใช้บังคับ**ตั้งแต่วันที่ 30 ธันวาคม 2569 เป็นต้นไป**

ทั้งนี้ หากท่านผู้ถือหน่วยลงทุนไม่ประสงค์จะลงทุนในกองทุนอีกต่อไป ท่านสามารถทำรายการขายคืนหรือสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออกทั้งระหว่างกองทุนภายในบริษัทจัดการเองหรือไปยังบริษัทจัดการอื่นได้โดยไม่มีการเรียกเก็บค่าธรรมเนียมการรับซื้อคืนหน่วยลงทุน (exit without fee) ได้ตั้งแต่แต่บัดนี้เป็นต้นไปจนถึงวันที่ 29 ธันวาคม 2569 และหากท่านผู้ถือหน่วยลงทุนมีข้อสอบถามเพิ่มเติม กรุณาติดต่อบริษัทจัดการได้ที่ โทรศัพท์ 0 2015 0222 กด 5 หรือเจ้าหน้าที่การตลาดที่ดูแลบัญชีของท่านผู้ถือหน่วยลงทุน หรือที่ www.talisam.co.th

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ทาลิส จำกัด
ประกาศ ณ วันที่ 29 ตุลาคม 2569

ตารางแสดงรายละเอียดเรื่องที่ขอแก้ไขเพิ่มเติมโครงการ

กองทุนเปิด MEGA 20 ไทยเพื่อความยั่งยืน (MEGA20THAIESG)

หัวข้อ	ข้อความเดิม	ข้อความที่แก้ไข	หมายเหตุ
ส่วนข้อมูลโครงการ			
2. ประเภทกองทุน	**ผู้ประเมินผลการดำเนินงานด้านความยั่งยืนตามมาตรฐานสากล :** ~~**ไม่มี**~~	**ผู้ประเมินผลการดำเนินงานด้านความยั่งยืนตามมาตรฐานสากล :** มี **ชื่อผู้ประเมินผลการดำเนินงานด้านความยั่งยืนตามมาตรฐานสากล :** - FTSE INTERNATIONAL LIMITED	(1) กำหนดให้ FTSE INTERNATIONAL LIMITED เป็นผู้ประเมินผลการดำเนินงานด้านความยั่งยืนตามมาตรฐานสากลของกองทุน ซึ่งต้องปรับหลักเกณฑ์การคัดเลือกหลักทรัพย์จากการให้ Rating ระดับ AA หรือเทียบเท่าขึ้นไป เป็นได้รับ FTSE ESG Scores ในระดับตั้งแต่ 3.0 ขึ้นไป โดยเป็นไปตามหลักเกณฑ์/ชื่อเรียกเฉพาะของผู้ประเมินฯ ทั้งนี้ การแก้ไขไม่กระทบต่อนโยบายการลงทุนหลักในส่วนอื่น ๆ ของกองทุน (2) กำหนด SET100 Free Float Adjusted Market Capitalization Weighted Index (SET100FF Index) เป็นดัชนีชี้วัดผลการ
	รายละเอียดเพิ่มเติมเกี่ยวกับนโยบายการลงทุนและลักษณะพิเศษ: **1. นโยบายการลงทุน** กองทุนมีนโยบายลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งหุ้นของบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย และ/หรือตลาดหลักทรัพย์เอ็ม เอ ไอ (“บริษัทจดทะเบียนฯ”) ที่มีความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน (Environmental, Social and Governance: ESG) โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน กองทุนจะใช้ข้อมูลผลคะแนนด้านความยั่งยืน (ESG scores) หรือข้อมูลการจัดอันดับด้านความยั่งยืน (ESG Ratings) จากผู้ประเมินผลการดำเนินงานด้านความยั่งยืนตามมาตรฐานสากลหรือผู้ให้บริการข้อมูลด้าน ESG เป็นข้อมูลในการพิจารณาถึงความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อมหรือด้านความยั่งยืน ทั้งนี้ บริษัทจัดการขอสงวนสิทธิที่จะเปลี่ยนผู้ประเมินหรือผู้ให้บริการข้อมูล รวมถึงแต่งตั้งผู้ประเมินหรือผู้ให้บริการข้อมูลที่จะใช้ในอนาคต โดยจะประกาศให้ทราบล่วงหน้าไม่น้อยกว่า 3 วันทำการ ...	**รายละเอียดเพิ่มเติมเกี่ยวกับนโยบายการลงทุนและลักษณะพิเศษ:** **1.นโยบายการลงทุน** กองทุนมีนโยบายลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งหุ้นของบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย และ/หรือตลาดหลักทรัพย์เอ็ม เอ ไอ (“บริษัทจดทะเบียนฯ”) ที่ได้รับการประเมินจาก FTSE INTERNATIONAL LIMITED (“FTSE Russell”) ว่ามีความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน (Environmental, Social and Governance: ESG) โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน กองทุนจะพิจารณาลงทุนในหุ้นของบริษัทจดทะเบียนฯตามวรรคแรกที่ได้รับการประเมิน FTSE Russell ESG Scores ในระดับตั้งแต่ 3.0 ขึ้นไป เนื่องจากเป็นระดับคะแนนที่แสดงถึงบริษัทที่มีการดำเนินงานด้านความยั่งยืนในระดับดีที่ปฏิบัติตามมาตรฐานสากล (Good Practice) ทั้งนี้ FTSE Russell ESG Scores เป็นผลคะแนนที่จัดทำโดย FTSE Russell จากการประเมินการดำเนินงานด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน (Environmental, Social and Governance: ESG) ของบริษัทจดทะเบียนฯ โดยคะแนนจะอยู่ใน	

หัวข้อ	ข้อความเดิม	ข้อความที่แก้ไข	หมายเหตุ
ส่วนข้อมูลโครงการ			
	วัตถุประสงค์การลงทุนที่เกี่ยวข้องกับความยั่งยืน เพื่อสะท้อนให้เห็นถึงการลงทุนที่คำนึงถึงปัจจัยด้านความยั่งยืน และมุ่งเน้นลงทุนในหุ้นของบริษัทจดทะเบียนฯ ที่เห็นความสำคัญและดำเนินธุรกิจที่มีความยั่งยืนในระยะยาว (Sustainability) และสร้างผลกระทบเชิงบวกต่อสังคมและสิ่งแวดล้อม โดยกองทุนจะลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งหุ้นของบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย และ/หรือ ตลาดหลักทรัพย์เอ็ม เอ ไอ ที่มีข้อมูลผลคะแนนด้านความยั่งยืน (ESG scores) หรือข้อมูลการจัดอันดับด้านความยั่งยืน (ESG Ratings) จากผู้ประเมินผลการดำเนินงานด้านความยั่งยืนตามมาตรฐานสากลหรือผู้ให้บริการข้อมูลด้าน ESG ว่ามีความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน (Environmental, Social and Governance: ESG) โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน **กรอบการลงทุน (Investment Universe)** กองทุนจะเน้นลงทุนในหุ้นสามัญของบริษัทจดทะเบียนฯ จากทุกกลุ่มอุตสาหกรรม เฉพาะบริษัทที่จดทะเบียนจัดตั้งในประเทศไทย ที่ได้รับ	รูปแบบของตัวเลขคะแนน 0.0 – 5.0 คะแนน 0.0 หมายถึง ไม่มีข้อมูลให้ประเมิน และคะแนน 5.0 หมายถึงเป็น Best practices ทั้งนี้ บริษัทจัดการขอสงวนสิทธิที่จะเปลี่ยนผู้ประเมินหรือผู้ให้บริการข้อมูล รวมถึงแต่งตั้งผู้ประเมินหรือผู้ให้บริการข้อมูลที่จะใช้ในอนาคต โดยจะประกาศให้ทราบล่วงหน้าไม่น้อยกว่า 3 วันทำการ ... **วัตถุประสงค์การลงทุนที่เกี่ยวข้องกับความยั่งยืน** เพื่อสะท้อนให้เห็นถึงการลงทุนที่คำนึงถึงปัจจัยด้านความยั่งยืน และมุ่งเน้นลงทุนในหุ้นของบริษัทจดทะเบียนฯ ที่เห็นความสำคัญและดำเนินธุรกิจที่มีความยั่งยืนในระยะยาว (Sustainability) และสร้างผลกระทบเชิงบวกต่อสังคมและสิ่งแวดล้อม โดยกองทุนจะลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งหุ้นของบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย และ/หรือตลาดหลักทรัพย์เอ็ม เอ ไอ ที่ได้รับการประเมินจาก FTSE Russell ว่ามีความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน (Environmental, Social and Governance: ESG) โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน **กรอบการลงทุน (Investment Universe)** กองทุนจะเน้นลงทุนในหุ้นสามัญของบริษัทจดทะเบียนฯ จากทุกกลุ่มอุตสาหกรรม เฉพาะบริษัทที่จดทะเบียนจัดตั้งในประเทศไทย ที่ได้รับ	ดำเนินงาน (Performance benchmark) ของกองทุน (ในส่วนการลงทุนในหุ้น) โดยไม่รวมถึงการเป็นดัชนีชี้วัดด้านความยั่งยืน (Reference ESG benchmark) ที่เป็นภาคสมัครใจของบริษัทจัดการ

หัวข้อ	ข้อความเดิม	ข้อความที่แก้ไข	หมายเหตุ
ส่วนข้อมูลโครงการ			
	การประเมินผลการดำเนินงานหรือผลคะแนนด้านความยั่งยืน (ESG Rating/Score) ในระดับ AA หรือเทียบเท่าขึ้นไป โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน กรอบการลงทุนข้างต้นนี้ใช้เกณฑ์ ESG Rating/Score ในระดับ AA หรือเทียบเท่าขึ้นไป ซึ่งตัวชี้วัดนี้ไม่ได้แยกพิจารณาแค่ด้านใดด้านหนึ่ง แต่เป็นการประเมินแบบรวมทั้ง 3 มิติ: ... ดังนั้น การที่กองทุนเลือกลงทุนในหุ้นที่ผ่านเกณฑ์ AA หรือเทียบเท่าขึ้นไป จึงเป็นการส่งเสริมคุณลักษณะด้าน ESG แบบองค์รวม ผ่านกระบวนการ ESG Integration ที่เข้มข้น โดยใช้กลยุทธ์ Positive Screening เพื่อคัดเลือกลงทุนเฉพาะหุ้นไทยระดับ Top-Tier ด้านความยั่งยืน (ระดับ AA หรือเทียบเท่าขึ้นไป) โดยมุ่งหวังผลตอบแทนที่มั่นคง ควบคู่ไปกับการลดความเสี่ยงด้านความยั่งยืนอย่างต่อเนื่อง **2. กลยุทธ์การลงทุน** **หลักเกณฑ์ในการคัดเลือกหลักทรัพย์** กองทุนจะใช้การบริหารแบบ Rule-based Approach ซึ่งจะกำหนดเกณฑ์ในการคัดเลือกจากหลักทรัพย์เฉพาะที่ได้รับการประเมินผลการดำเนินงานหรือผลคะแนนด้านความยั่งยืน (ESG Rating/Score) ในระดับ AA หรือเทียบเท่าขึ้นไป ณ ขณะลงทุน	FTSE Russell ESG Scores ในระดับตั้งแต่ 3.0 ขึ้นไป โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน กรอบการลงทุนข้างต้นนี้ใช้การคัดเลือกหลักทรัพย์ที่ได้รับ FTSE Russell ESG Scores ในระดับตั้งแต่ 3.0 ขึ้นไป ซึ่งตัวชี้วัดนี้ไม่ได้แยกพิจารณาแค่ด้านใดด้านหนึ่ง แต่เป็นการประเมินแบบรวมทั้ง 3 มิติ: ... ดังนั้น การที่กองทุนเลือกลงทุนในหุ้นที่ผ่านเกณฑ์ ที่ได้รับ FTSE Russell ESG Scores ในระดับตั้งแต่ 3.0 ขึ้นไป จึงเป็นการส่งเสริมคุณลักษณะด้าน ESG แบบองค์รวม ผ่านกระบวนการ ESG Integration ที่เข้มข้น โดยใช้กลยุทธ์ Positive Screening เพื่อคัดเลือกลงทุนเฉพาะหุ้นไทยระดับ Top-Tier ด้านความยั่งยืน (ในระดับ 3.0 ขึ้นไป) โดยมุ่งหวังผลตอบแทนที่มั่นคง ควบคู่ไปกับการลดความเสี่ยงด้านความยั่งยืนอย่างต่อเนื่อง อนึ่ง FTSE Russell ESG Scores ในระดับ 3.0 คือบริษัทที่มีการดำเนินงานด้านความยั่งยืนในระดับดีที่ปฏิบัติตามมาตรฐานสากล (Good Practice) **2. กลยุทธ์การลงทุน** **หลักเกณฑ์ในการคัดเลือกหลักทรัพย์** กองทุนจะใช้การบริหารแบบ Rule-based Approach ซึ่งจะกำหนดเกณฑ์ในการคัดเลือกจากหลักทรัพย์เฉพาะที่ได้รับ FTSE Russell ESG Scores ในระดับตั้งแต่ 3.0 ขึ้นไป ณ ขณะลงทุน	

หัวข้อ	ข้อความเดิม	ข้อความที่แก้ไข	หมายเหตุ
ส่วนข้อมูลโครงการ			
	กระบวนการวิเคราะห์และคัดเลือกหลักทรัพย์ ขั้นตอนที่ 1: คัดเลือกหลักทรัพย์ที่ได้รับการประเมินผลการดำเนินงานหรือผลคะแนนด้านความยั่งยืน (ESG Rating/Score) ขั้นตอนที่ 2: คัดเลือกหลักทรัพย์ที่ได้รับการประเมินผลการดำเนินงานหรือผลคะแนนด้านความยั่งยืน (ESG Rating/Score) จากตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยหรือผู้บริการข้อมูลด้าน ESG ว่ามีความโดดเด่นด้าน ESG ในระดับตั้งแต่ AA หรือเทียบเท่าขึ้นไปเท่านั้น (รวมถึง AA และ AAA) ... **ดัชนีชี้วัดผลการดำเนินงาน (Performance benchmark) และดัชนีชี้วัดด้านความยั่งยืน (Reference ESG benchmark)** ดัชนีผลตอบแทนรวม SETESG (SETESG TRI) ในสัดส่วน 100% จัดทำโดยตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย ซึ่งเป็นดัชนีประเภท Total Return Index (TRI) ที่สะท้อนการเคลื่อนไหวราคาของกลุ่มหลักทรัพย์ของบริษัทจดทะเบียนที่มีการดำเนินธุรกิจอย่างยั่งยืนซึ่งมีขนาดมูลค่าหลักทรัพย์ตามราคาตลาด (Market Capitalization) และสภาพคล่องผ่านตามเกณฑ์ที่กำหนด โดยไม่ได้จำกัดจำนวนหลักทรัพย์ในดัชนี นอกจากนี้ ดัชนีได้รับการคัดกรองหลักทรัพย์ในด้านสิ่งแวดล้อม สังคม และบรรษัทภิบาล (ESG) มาแล้วอย่างเข้มงวดเพราะคัดเลือกเฉพาะหุ้นที่ผ่านการประเมิน SET ESG Ratings ตั้งแต่ระดับ BBB ขึ้นไป ซึ่งช่วยสร้างความน่าเชื่อถือในด้านความยั่งยืนของหุ้นในดัชนี	**กระบวนการวิเคราะห์และคัดเลือกหลักทรัพย์** ขั้นตอนที่ 1: คัดเลือกหลักทรัพย์ที่ได้รับการประเมินจาก FTSE Russell ว่ามีความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน (Environmental, Social and Governance: ESG) ขั้นตอนที่ 2: คัดเลือกหลักทรัพย์จากขั้นตอนที่ 1 ที่ได้รับ FTSE Russell ESG Scores ในระดับตั้งแต่ 3.0 ขึ้นไป ... **ดัชนีชี้วัดผลการดำเนินงาน (Performance benchmark)** ~~**และดัชนีชี้วัดด้านความยั่งยืน (Reference ESG benchmark)**~~ ดัชนี SET100 Free Float Adjusted Market Capitalization Weighted Index (SET100FF Index) ในสัดส่วนร้อยละ 100 SET100FF Index เป็นดัชนีที่จัดทำโดยตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เป็นดัชนีราคาหุ้นที่สะท้อนความเคลื่อนไหวของหุ้นขนาดใหญ่ 100 อันดับแรกในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย โดยนำสัดส่วนผู้ถือหุ้นรายย่อย (Free Float) มาถ่วงน้ำหนักร่วมกับมูลค่าหลักทรัพย์ตามราคาตลาด (Market Capitalization) โดยโครงสร้างของดัชนีดังกล่าวสอดคล้องกับกระบวนการลงทุนของกองทุนที่ใช้การบริหารแบบ Rule-based Approach ซึ่งมุ่งลงทุนในบริษัทที่มีมูลค่าหลักทรัพย์ตามราคาตลาด (Market Capitalization) สูง ทั้งนี้ บริษัทจัดการจะพิจารณา FTSE Russell ESG Scores จาก	

หัวข้อ	ข้อความเดิม	ข้อความที่แก้ไข	หมายเหตุ
ส่วนข้อมูลโครงการ			
	ผู้ลงทุนสามารถศึกษาวิธีการจัดทำดัชนี (Index Methodology) ได้ที่ www.set.or.th/th/market/index/setesg/profile **3. ความเสี่ยงที่เกี่ยวข้องกับการลงทุนของกองทุน** **ความเสี่ยงจากปัจจัยด้านความยั่งยืนต่อการลงทุน** • กองทุนเน้นลงทุนในหลักทรัพย์ของบริษัทที่ได้รับการประเมินผลการดำเนินงานหรือผลคะแนนด้านความยั่งยืน (ESG Rating/Score) จาก SET ที่เป็นผู้ประเมินผลการดำเนินงานด้านความยั่งยืนตามมาตรฐานสากลในระดับตั้งแต่ AA หรือเทียบเท่าขึ้นไป อาจมีความเสี่ยงที่เหตุการณ์หรือปัจจัยด้าน ESG อาจส่งผลกระทบเชิงลบต่อมูลค่าการลงทุนหรือผลการดำเนินงานของกองทุน ดังนี้ O ความเสี่ยงจากการอ้างอิงข้อมูล ESG Rating/Score ในการพิจารณาคัดเลือกหุ้นที่จะลงทุน เพราะข้อมูล ESG Rating/Score ที่ใช้อาจเป็นข้อมูลในอดีตที่อาจล่าช้าหรือยังไม่มีการปรับปรุงให้เป็นปัจจุบันได้ทันทีเมื่อมีเหตุการณ์เกี่ยวกับ ESG มากระทบกับบริษัทนั้นในเชิงลบ ซึ่งเหตุการณ์ดังกล่าวอาจส่งผลกระทบต่อราคาหุ้นของบริษัทนั้นและผลตอบแทนจากการลงทุนได้ทันที O ความเสี่ยงจากการฟอกเขียว (Greenwashing) ของบริษัทที่ได้ผลการประเมิน ESG Rating/Score ในระดับสูง โดยเกิดจากการที่บริษัทสร้างภาพลักษณ์หรือให้ข้อมูลที่ทำให้เข้าใจผิดว่ากิจการหรือผลิตภัณฑ์ของบริษัทนั้น เป็นมิตรต่อสิ่งแวดล้อมหรือสังคมเกินความเป็นจริง ดังนั้น ข้อมูล ESG Rating/Score อาจไม่สามารถสะท้อนหรือให้ความมั่นใจถึงการดำเนินงานที่ให้ความสำคัญในด้านความ	การประเมินของ FTSE Russell ในการคัดเลือกหลักทรัพย์ เพื่อให้สอดคล้องกับวัตถุประสงค์ด้านความยั่งยืนของกองทุน **3. ความเสี่ยงที่เกี่ยวข้องกับการลงทุนของกองทุน** **ความเสี่ยงจากปัจจัยด้านความยั่งยืนต่อการลงทุน** • กองทุนเน้นลงทุนในหุ้นของบริษัทจดทะเบียนฯ ที่ได้รับการประเมินจาก FTSE Russell ว่ามีความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน (Environmental, Social and Governance: ESG) ที่ได้รับ FTSE Russell ESG Scores ในระดับตั้งแต่ 3.0 ขึ้นไป อาจมีความเสี่ยงที่เหตุการณ์หรือปัจจัยด้าน ESG อาจส่งผลกระทบเชิงลบต่อมูลค่าการลงทุนหรือผลการดำเนินงานของกองทุน ดังนี้ o ความเสี่ยงจากการอ้างอิงข้อมูล FTSE Russell ESG Scores ในการพิจารณาคัดเลือกหุ้นที่จะลงทุน เพราะข้อมูล FTSE Russell ESG Scores ที่ใช้อาจเป็นข้อมูลในอดีตที่อาจล่าช้าหรือยังไม่มีการปรับปรุงให้เป็นปัจจุบันได้ทันทีเมื่อมีเหตุการณ์เกี่ยวกับ ESG มากระทบกับบริษัทนั้นในเชิงลบ ซึ่งเหตุการณ์ดังกล่าวอาจส่งผลกระทบต่อราคาหุ้นของบริษัทนั้นและผลตอบแทนจากการลงทุนได้ทันที o ความเสี่ยงจากการฟอกเขียว (Greenwashing) ของบริษัทที่ได้ผลการประเมินคะแนนในระดับสูง โดยเกิดจากการที่บริษัทสร้างภาพลักษณ์หรือให้ข้อมูลที่ทำให้เข้าใจผิดว่ากิจการหรือผลิตภัณฑ์ของบริษัทนั้น เป็นมิตรต่อสิ่งแวดล้อมหรือสังคมเกินความเป็นจริง	

หัวข้อ	ข้อความเดิม	ข้อความที่แก้ไข	หมายเหตุ
ส่วนข้อมูลโครงการ			
	ยั่งยืนได้จริงเสมอไป และเมื่อมีข่าวลบหรือการเปิดเผยข้อมูลที่ขัดแย้งกับภาพลักษณ์ในด้าน ESG ก็อาจส่งผลกระทบต่อราคาหุ้นของบริษัทนั้นและผลตอบแทนจากการลงทุนได้ ... **ความเสี่ยงจากการลงทุนต่อปัจจัยด้านความยั่งยืน** • แม้กองทุนจะคัดเลือกบริษัท... • ตราสารทุนที่กองทุนเข้าลงทุนเกินกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุนจะใช้วิธีคัดเลือกจากบริษัทที่ได้รับการประเมินผลการดำเนินงานหรือผลคะแนนด้านความยั่งยืน (ESG Rating/Score) จาก SET ที่เป็นผู้ประเมินผลการดำเนินงานด้านความยั่งยืนตามมาตรฐานสากล ว่ามีความโดดเด่นด้าน ESG ในระดับตั้งแต่ AA หรือเทียบเท่าขึ้นไป... **4. แนวทางดำเนินการ และมาตรการควบคุมผลกระทบในกรณีการลงทุนไม่เป็นไปตามนโยบายการลงทุน** • กองทุนใช้กลยุทธ์การลงทุนแบบ Screening... • บริษัทจัดการจะทำการติดตามผลการประเมินผลการดำเนินงานด้านความยั่งยืน (ESG Rating/Score) จาก SET หรือผู้ประเมินผลการ	ดังนั้น ข้อมูลคะแนนอาจไม่สามารถสะท้อนหรือให้ความมั่นใจถึงการดำเนินงานที่ให้ความสำคัญในด้านความยั่งยืนได้จริงเสมอไป และเมื่อมีข่าวลบหรือการเปิดเผยข้อมูลที่ขัดแย้งกับภาพลักษณ์ในด้าน ESG ก็อาจส่งผลกระทบต่อราคาหุ้นของบริษัทนั้นและผลตอบแทนจากการลงทุนได้ ... **ความเสี่ยงจากการลงทุนต่อปัจจัยด้านความยั่งยืน** • แม้กองทุนจะคัดเลือกบริษัท... • ตราสารทุนที่กองทุนเข้าลงทุนเกินกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุนจะใช้วิธีคัดเลือกจากบริษัทที่ได้รับการประเมินจาก FTSE Russell ว่ามีความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน (Environmental, Social and Governance: ESG) ที่ได้รับ FTSE Russell ESG Scores ในระดับตั้งแต่ 3.0 ขึ้นไป ... **4. แนวทางดำเนินการ และมาตรการควบคุมผลกระทบในกรณีการลงทุนไม่เป็นไปตามนโยบายการลงทุน** • กองทุนใช้กลยุทธ์การลงทุนแบบ Screening... • บริษัทจัดการจะทำการติดตามผล FTSE Russell ESG Scores จาก FTSE Russell อย่างสม่ำเสมอ และพิจารณาปรับรายชื่อหลักทรัพย์	

หัวข้อ	ข้อความเดิม	ข้อความที่แก้ไข	หมายเหตุ
ส่วนข้อมูลโครงการ			
	ดำเนินงานด้านความยั่งยืน อย่างสม่ำเสมอ และพิจารณาปรับรายชื่อหลักทรัพย์เพื่อให้เป็นไปตามหลักเกณฑ์การคัดเลือกหลักทรัพย์ตามนโยบายการลงทุน • กรณีที่การลงทุน...	หาก FTSE Russell ESG Scores มีการเปลี่ยนแปลง เพื่อให้เป็นไปตามหลักเกณฑ์การคัดเลือกหลักทรัพย์ตามนโยบายการลงทุน • กรณีที่การลงทุน...	

ตารางแสดงรายละเอียดเรื่องที่ขอแก้ไขเพิ่มเติมโครงการ

กองทุนเปิด MEGA 20 ไทยเพื่อความยั่งยืนแบบพิเศษ 80-20 C (MEGATX8020C)

หัวข้อ	ข้อความเดิม	ข้อความที่แก้ไข	หมายเหตุ
ส่วนข้อมูลโครงการ			
2. ประเภทกองทุน	**ผู้ประเมินผลการดำเนินงานด้านความยั่งยืนตามมาตรฐานสากล :** ~~**ไม่มี**~~	**ผู้ประเมินผลการดำเนินงานด้านความยั่งยืนตามมาตรฐานสากล :** **มี** **ชื่อผู้ประเมินผลการดำเนินงานด้านความยั่งยืนตามมาตรฐานสากล :** - FTSE INTERNATIONAL LIMITED	(1) กำหนดให้ FTSE INTERNATIONAL LIMITED เป็นผู้ประเมินผลการดำเนินงานด้านความยั่งยืนตามมาตรฐานสากลของกองทุน ซึ่งต้องปรับหลักเกณฑ์การคัดเลือกหลักทรัพย์จากการให้ Rating ระดับ AA หรือเทียบเท่าขึ้นไป เป็นได้รับ FTSE ESG Scores ในระดับตั้งแต่ 3.0 ขึ้นไป โดยเป็นไปตามหลักเกณฑ์/ชื่อเรียกเฉพาะของผู้ประเมินฯ ทั้งนี้ การแก้ไขไม่กระทบต่อนโยบายการลงทุนหลักในส่วนอื่น ๆ ของกองทุน (2) กำหนด SET100 Free Float Adjusted Market Capitalization Weighted Index (SET100FF Index) เป็นดัชนีชี้วัดผลการ
	รายละเอียดเพิ่มเติมเกี่ยวกับนโยบายการลงทุนและลักษณะพิเศษ: **1. นโยบายการลงทุน** กองทุนมีนโยบายลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งหุ้นของบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย และ/หรือตลาดหลักทรัพย์เอ็ม เอ ไอ (“บริษัทจดทะเบียนฯ”) ที่มีความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน (Environmental, Social and Governance: ESG) โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน กองทุนจะใช้ข้อมูลผลคะแนนด้านความยั่งยืน (ESG scores) หรือข้อมูลการจัดอันดับด้านความยั่งยืน (ESG Ratings) จากผู้ประเมินผลการดำเนินงานด้านความยั่งยืนตามมาตรฐานสากลหรือผู้ให้บริการข้อมูลด้าน ESG เป็นข้อมูลในการพิจารณาถึงความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อมหรือด้านความยั่งยืน ทั้งนี้ บริษัทจัดการขอสงวนสิทธิที่จะเปลี่ยนผู้ประเมินหรือผู้ให้บริการข้อมูล รวมถึงแต่งตั้งผู้ประเมินหรือผู้ให้บริการข้อมูลที่จะใช้ในอนาคต โดยจะประกาศให้ทราบล่วงหน้าไม่น้อยกว่า 3 วันทำการ ...	**รายละเอียดเพิ่มเติมเกี่ยวกับนโยบายการลงทุนและลักษณะพิเศษ:** **1.นโยบายการลงทุน** กองทุนมีนโยบายลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งหุ้นของบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย และ/หรือตลาดหลักทรัพย์เอ็ม เอ ไอ (“บริษัทจดทะเบียนฯ”) ที่ได้รับการประเมินจาก FTSE INTERNATIONAL LIMITED (“FTSE Russell”) ว่ามีความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน (Environmental, Social and Governance: ESG) โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน กองทุนจะพิจารณาลงทุนในหุ้นของบริษัทจดทะเบียนฯตามวรรคแรกที่ได้รับการประเมิน FTSE Russell ESG Scores ในระดับตั้งแต่ 3.0 ขึ้นไป เนื่องจากเป็นระดับคะแนนที่แสดงถึงบริษัทที่มีการดำเนินงานด้านความยั่งยืนในระดับดีที่ปฏิบัติตามมาตรฐานสากล (Good Practice) ทั้งนี้ FTSE Russell ESG Scores เป็นผลคะแนนที่จัดทำโดย FTSE Russell จากการประเมินการดำเนินงานด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน (Environmental, Social and Governance: ESG) ของบริษัทจดทะเบียนฯ โดยคะแนนจะอยู่ใน	

หัวข้อ	ข้อความเดิม	ข้อความที่แก้ไข	หมายเหตุ
ส่วนข้อมูลโครงการ			
	วัตถุประสงค์การลงทุนที่เกี่ยวข้องกับความยั่งยืน เพื่อสะท้อนให้เห็นถึงการลงทุนที่คำนึงถึงปัจจัยด้านความยั่งยืน และมุ่งเน้นลงทุนในหุ้นของบริษัทจดทะเบียนฯ ที่เห็นความสำคัญและดำเนินธุรกิจที่มีความยั่งยืนในระยะยาว (Sustainability) และสร้างผลกระทบเชิงบวกต่อสังคมและสิ่งแวดล้อม โดยกองทุนจะลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งหุ้นของบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย และ/หรือตลาดหลักทรัพย์เอ็ม เอ ไอ ที่มีข้อมูลผลคะแนนด้านความยั่งยืน (ESG scores) หรือข้อมูลการจัดอันดับด้านความยั่งยืน (ESG Ratings) จากผู้ประเมินผลการดำเนินงานด้านความยั่งยืนตามมาตรฐานสากลหรือผู้ให้บริการข้อมูลด้าน ESG ว่ามีความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน (Environmental, Social and Governance: ESG) หรือหุ้นของบริษัทจดทะเบียนฯที่มีธรรมาภิบาล (Governance) (รายละเอียดปรากฏตามกรอบการลงทุน (Investment Universe)) โดยมี net exposure ในทรัพย์สินที่ลงทุนดังกล่าวโดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน	รูปแบบของตัวเลขคะแนน 0.0 – 5.0 คะแนน 0.0 หมายถึง ไม่มีข้อมูลให้ประเมิน และคะแนน 5.0 หมายถึงเป็น Best practices ทั้งนี้ บริษัทจัดการขอสงวนสิทธิที่จะเปลี่ยนผู้ประเมินหรือผู้ให้บริการข้อมูล รวมถึงแต่งตั้งผู้ประเมินหรือผู้ให้บริการข้อมูลที่จะใช้ในอนาคต โดยจะประกาศให้ทราบล่วงหน้าไม่น้อยกว่า 3 วันทำการ ... **วัตถุประสงค์การลงทุนที่เกี่ยวข้องกับความยั่งยืน** เพื่อสะท้อนให้เห็นถึงการลงทุนที่คำนึงถึงปัจจัยด้านความยั่งยืน และมุ่งเน้นลงทุนในหุ้นของบริษัทจดทะเบียนฯ ที่เห็นความสำคัญและดำเนินธุรกิจที่มีความยั่งยืนในระยะยาว (Sustainability) และสร้างผลกระทบเชิงบวกต่อสังคมและสิ่งแวดล้อม โดยกองทุนจะลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งหุ้นของบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย และ/หรือตลาดหลักทรัพย์เอ็ม เอ ไอ ที่ได้รับการประเมินจาก FTSE Russell ว่ามีความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน (Environmental, Social and Governance: ESG) หรือหุ้นของบริษัทจดทะเบียนฯที่มีธรรมาภิบาล (Governance) (รายละเอียดปรากฏตามกรอบการลงทุน (Investment Universe)) โดยมี net exposure ในทรัพย์สินที่ลงทุนดังกล่าวโดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน	ดำเนินงาน (Performance benchmark) ของกองทุน (ในส่วนการลงทุนในหุ้น) โดยไม่รวมถึงการเป็นดัชนีชี้วัดด้านความยั่งยืน (Reference ESG benchmark) ที่เป็นภาคสมัครใจของบริษัทจัดการ

หัวข้อ	ข้อความเดิม	ข้อความที่แก้ไข	หมายเหตุ
ส่วนข้อมูลโครงการ			
	กรอบการลงทุน (Investment Universe) กองทุนจะเน้นลงทุนในหุ้นสามัญของบริษัทจดทะเบียนฯ จากทุกกลุ่มอุตสาหกรรม เฉพาะบริษัทที่จดทะเบียนจัดตั้งในประเทศไทย ที่ได้รับการประเมินผลการดำเนินงานหรือผลคะแนนด้านความยั่งยืน (ESG Rating/Score) ในระดับ AA หรือเทียบเท่าขึ้นไป หรือหุ้นของบริษัทจดทะเบียนฯที่มีธรรมาภิบาล (Governance) โดยมี net exposure ในทรัพย์สินที่ลงทุนดังกล่าวโดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน ... กรอบการลงทุนข้างต้นนี้ใช้เกณฑ์ ESG Rating/Score ในระดับ AA หรือเทียบเท่าขึ้นไป ซึ่งตัวชี้วัดนี้ไม่ได้แยกพิจารณาแค่ด้านใดด้านหนึ่ง แต่เป็นการประเมินแบบรวมทั้ง 3 มิติ: ... ดังนั้น การที่กองทุนเลือกลงทุนในหุ้นที่ผ่านเกณฑ์ AA หรือเทียบเท่าขึ้นไป จึงเป็นการส่งเสริมคุณลักษณะด้าน ESG แบบองค์รวม ผ่านกระบวนการ ESG Integration ที่เข้มข้น โดยใช้กลยุทธ์ Positive Screening เพื่อคัดเลือกลงทุนเฉพาะหุ้นไทยระดับ Top-Tier ด้านความยั่งยืน (ระดับ AA หรือเทียบเท่าขึ้นไป) โดยมุ่งหวังผลตอบแทนที่มั่นคง ควบคู่ไปกับการลดความเสี่ยงด้านความยั่งยืนอย่างต่อเนื่อง	**กรอบการลงทุน (Investment Universe)** กองทุนจะเน้นลงทุนในหุ้นสามัญของบริษัทจดทะเบียนฯ จากทุกกลุ่มอุตสาหกรรม เฉพาะบริษัทที่จดทะเบียนจัดตั้งในประเทศไทย ที่ได้รับ FTSE Russell ESG Scores ในระดับตั้งแต่ 3.0 ขึ้นไป หรือหุ้นของบริษัทจดทะเบียนฯที่มีธรรมาภิบาล (Governance) โดยมี net exposure ในทรัพย์สินที่ลงทุนดังกล่าวโดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน ... กรอบการลงทุนข้างต้นนี้ใช้การคัดเลือกหลักทรัพย์ที่ได้รับ FTSE Russell ESG Scores ในระดับตั้งแต่ 3.0 ขึ้นไป ซึ่งตัวชี้วัดนี้ไม่ได้แยกพิจารณาแค่ด้านใดด้านหนึ่ง แต่เป็นการประเมินแบบรวมทั้ง 3 มิติ: ... ดังนั้น การที่กองทุนเลือกลงทุนในหุ้นที่ผ่านเกณฑ์ ที่ได้รับ FTSE Russell ESG Scores ในระดับตั้งแต่ 3.0 ขึ้นไป จึงเป็นการส่งเสริมคุณลักษณะด้าน ESG แบบองค์รวม ผ่านกระบวนการ ESG Integration ที่เข้มข้น โดยใช้กลยุทธ์ Positive Screening เพื่อคัดเลือกลงทุนเฉพาะหุ้นไทยระดับ Top-Tier ด้านความยั่งยืน (ในระดับ 3.0 ขึ้นไป) โดยมุ่งหวังผลตอบแทนที่มั่นคง ควบคู่ไปกับการลดความเสี่ยงด้านความยั่งยืนอย่างต่อเนื่อง อนึ่ง FTSE Russell ESG Scores ในระดับ 3.0 คือบริษัทที่มีการดำเนินงานด้านความยั่งยืนในระดับดีที่ปฏิบัติตามมาตรฐานสากล (Good Practice)	

หัวข้อ	ข้อความเดิม	ข้อความที่แก้ไข	หมายเหตุ
ส่วนข้อมูลโครงการ			
	2. กลยุทธ์การลงทุน ในส่วนของการลงทุนในหุ้นของบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย และ/หรือตลาดหลักทรัพย์เอ็ม เอ ไอ (“บริษัทจดทะเบียนฯ”) ที่มีความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน (Environmental, Social and Governance: ESG) นั้น กองทุนจะใช้กลยุทธ์การลงทุนแบบ Positive Screening โดยจะคัดเลือกหลักทรัพย์ที่ได้รับการประเมินผลการดำเนินงานหรือผลคะแนนด้านความยั่งยืน (ESG Rating/Score) ในระดับตั้งแต่ AA หรือเทียบเท่าขึ้นไป เป็นหลักเกณฑ์ (Rule-based Investment Strategy) ซึ่งเป็นการกำหนดหลักเกณฑ์ เงื่อนไข รวมถึงขั้นตอนการคัดเลือกหลักทรัพย์เพื่อเข้าลงทุนไว้ล่วงหน้า **หลักเกณฑ์ในการคัดเลือกหลักทรัพย์** กองทุนจะใช้การบริหารแบบ Rule-based Approach ซึ่งจะกำหนดเกณฑ์ในการคัดเลือกจากหลักทรัพย์เฉพาะที่ได้รับการประเมินผลการดำเนินงานหรือผลคะแนนด้านความยั่งยืน (ESG Rating/Score) ในระดับ AA หรือเทียบเท่าขึ้นไป ณ ขณะลงทุน **กระบวนการวิเคราะห์และคัดเลือกหลักทรัพย์** ขั้นตอนที่ 1: คัดเลือกหลักทรัพย์ที่ได้รับการประเมินผลการดำเนินงานหรือผลคะแนนด้านความยั่งยืน (ESG Rating/Score) ขั้นตอนที่ 2: คัดเลือกหลักทรัพย์ที่ได้รับการประเมินผลการดำเนินงานหรือผลคะแนนด้านความยั่งยืน (ESG Rating/Score) จากตลาด	**2. กลยุทธ์การลงทุน** ในส่วนของการลงทุนในหุ้นของบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย และ/หรือตลาดหลักทรัพย์เอ็ม เอ ไอ (“บริษัทจดทะเบียนฯ”) ที่มีความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน (Environmental, Social and Governance: ESG) นั้น กองทุนจะใช้กลยุทธ์การลงทุนแบบ Positive Screening โดยจะคัดเลือกหลักทรัพย์เฉพาะที่ได้รับ FTSE Russell ESG Scores ในระดับตั้งแต่ 3.0 ขึ้นไป เป็นหลักเกณฑ์ (Rule-based Investment Strategy) ซึ่งเป็นการกำหนดหลักเกณฑ์ เงื่อนไข รวมถึงขั้นตอนการคัดเลือกหลักทรัพย์เพื่อเข้าลงทุนไว้ล่วงหน้า **หลักเกณฑ์ในการคัดเลือกหลักทรัพย์** กองทุนจะใช้การบริหารแบบ Rule-based Approach ซึ่งจะกำหนดเกณฑ์ในการคัดเลือกจากหลักทรัพย์เฉพาะที่ได้รับ FTSE Russell ESG Scores ในระดับตั้งแต่ 3.0 ขึ้นไป ณ ขณะลงทุน **กระบวนการวิเคราะห์และคัดเลือกหลักทรัพย์** ขั้นตอนที่ 1: คัดเลือกหลักทรัพย์ที่ได้รับการประเมินจาก FTSE Russell ว่ามีความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน (Environmental, Social and Governance: ESG)	

หัวข้อ	ข้อความเดิม	ข้อความที่แก้ไข	หมายเหตุ
ส่วนข้อมูลโครงการ			
	หลักทรัพย์แห่งประเทศไทยหรือผู้บริการข้อมูลด้าน ESG ว่ามีความโดดเด่นด้าน ESG ในระดับตั้งแต่ AA หรือเทียบเท่าขึ้นไปเท่านั้น (รวมถึง AA และ AAA) ... **ดัชนีชี้วัดผลการดำเนินงาน (Performance benchmark) และดัชนีชี้วัดด้านความยั่งยืน (Reference ESG benchmark)** (1) ดัชนีผลตอบแทนรวม SETESG (SETESG TRI) ซึ่งเป็นดัชนีที่จัดทำโดยตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เป็นดัชนีประเภท Total Return Index (TRI) ที่สะท้อนการเคลื่อนไหวราคาของกลุ่มหลักทรัพย์ของบริษัทจดทะเบียนที่มีการดำเนินธุรกิจอย่างยั่งยืนซึ่งมีขนาดมูลค่าหลักทรัพย์ตามราคาตลาด (Market Capitalization) และสภาพคล่องผ่านตามเกณฑ์ที่กำหนด โดยไม่ได้จำกัดจำนวนหลักทรัพย์ในดัชนี นอกจากนี้ ดัชนีได้รับการคัดกรองหลักทรัพย์ในด้านสิ่งแวดล้อม สังคม และบรรษัทภิบาล (ESG) มาแล้วอย่างเข้มงวดเพราะคัดเลือกเฉพาะหุ้นที่ผ่านการประเมิน SET ESG Ratings ตั้งแต่ระดับ BBB ขึ้นไป ซึ่งช่วยสร้างความน่าเชื่อถือในด้านความยั่งยืนของหุ้นในดัชนี ในสัดส่วนร้อยละ 80 ผู้ลงทุนสามารถศึกษาวิธีการจัดทำดัชนีผลตอบแทนรวม SETESG (SETESG TRI) (Index Methodology) ได้ที่ www.set.or.th/th/market/index/setesg/profile ทั้งนี้ บริษัทจัดการจะเปลี่ยนแปลงดัชนีชี้วัดของกองทุนตามข้างต้นที่จัดทำโดยตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เมื่อตลาดหลักทรัพย์	ขั้นตอนที่ 2: คัดเลือกหลักทรัพย์จากขั้นตอนที่ 1 ที่ได้รับ FTSE Russell ESG Scores ในระดับตั้งแต่ 3.0 ขึ้นไป ... **ดัชนีชี้วัดผลการดำเนินงาน (Performance benchmark)** ~~และดัชนีชี้วัดด้านความยั่งยืน (Reference ESG benchmark)~~ (1) ดัชนี SET100 Free Float Adjusted Market Capitalization Weighted Index (SET100FF Index) ในสัดส่วนร้อยละ 80 SET100FF Index เป็นดัชนีที่จัดทำโดยตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เป็นดัชนีราคาหุ้นที่สะท้อนความเคลื่อนไหวของหุ้นขนาดใหญ่ 100 อันดับแรกในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย โดยนำสัดส่วนผู้ถือหุ้นรายย่อย (Free Float) มาถ่วงน้ำหนักร่วมกับมูลค่าหลักทรัพย์ตามราคาตลาด (Market Capitalization) โดยโครงสร้างของดัชนีดังกล่าวสอดคล้องกับกระบวนการลงทุนของกองทุนที่ใช้การบริหารแบบ Rule-based Approach ซึ่งมุ่งลงทุนในบริษัทที่มีมูลค่าหลักทรัพย์ตามราคาตลาด (Market Capitalization) สูง ทั้งนี้ บริษัทจัดการจะพิจารณา FTSE Russell ESG Scores จากการประเมินของ FTSE Russell ในการคัดเลือกหลักทรัพย์ เพื่อให้สอดคล้องกับวัตถุประสงค์ด้านความยั่งยืนของกองทุน (2) ดัชนี...	

หัวข้อ	ข้อความเดิม	ข้อความที่แก้ไข	หมายเหตุ
ส่วนข้อมูลโครงการ			
	แห่งประเทศไทยมีการจัดทำดัชนี TRI ที่นำสัดส่วนผู้ถือหลักทรัพย์รายย่อยของแต่ละหลักทรัพย์ (free float) มาถ่วงน้ำหนักในการคำนวณดัชนี (ดัชนี free float TRI) เพื่อให้เป็นไปตามหลักเกณฑ์ที่คณะกรรมการกำกับตลาดทุนประกาศกำหนด (2) ดัชนี... **3. ความเสี่ยงที่เกี่ยวข้องกับการลงทุนของกองทุน** **ความเสี่ยงจากปัจจัยด้านความยั่งยืนต่อการลงทุน** • กองทุนเน้นลงทุนในหลักทรัพย์ของบริษัทที่ได้รับการประเมินผลการดำเนินงานหรือผลคะแนนด้านความยั่งยืน (ESG Rating/Score) จาก SET ที่เป็นผู้ประเมินผลการดำเนินงานด้านความยั่งยืนตามมาตรฐานสากลในระดับตั้งแต่ AA หรือเทียบเท่าขึ้นไป อาจมีความเสี่ยงที่เหตุการณ์หรือปัจจัยด้าน ESG อาจส่งผลกระทบเชิงลบต่อมูลค่าการลงทุนหรือผลการดำเนินงานของกองทุน ดังนี้ O ความเสี่ยงจากการอ้างอิงข้อมูล ESG Rating/Score ในการพิจารณาคัดเลือกหุ้นที่จะลงทุน เพราะข้อมูล ESG Rating/Score ที่ใช้อาจเป็นข้อมูลในอดีตที่อาจล่าช้าหรือยังไม่มีการปรับปรุงให้เป็นปัจจุบันได้ทันทีเมื่อมีเหตุการณ์เกี่ยวกับ ESG มากระทบกับบริษัทนั้นในเชิงลบ ซึ่งเหตุการณ์ดังกล่าวอาจส่งผลกระทบต่อราคาหุ้นของบริษัทนั้นและผลตอบแทนจากการลงทุนได้ทันที O ความเสี่ยงจากการฟอกเขียว (Greenwashing) ของบริษัทที่ได้ผลการประเมิน ESG Rating/Score ในระดับสูง โดยเกิดจากการ	**3. ความเสี่ยงที่เกี่ยวข้องกับการลงทุนของกองทุน** **ความเสี่ยงจากปัจจัยด้านความยั่งยืนต่อการลงทุน** • กองทุนเน้นลงทุนในหุ้นของบริษัทจดทะเบียนฯ ที่ได้รับการประเมินจาก FTSE Russell ว่ามีความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน (Environmental, Social and Governance: ESG) ที่ได้รับ FTSE Russell ESG Scores ในระดับตั้งแต่ 3.0 ขึ้นไป อาจมีความเสี่ยงที่เหตุการณ์หรือปัจจัยด้าน ESG อาจส่งผลกระทบเชิงลบต่อมูลค่าการลงทุนหรือผลการดำเนินงานของกองทุน ดังนี้ o ความเสี่ยงจากการอ้างอิงข้อมูล FTSE Russell ESG Scores ในการพิจารณาคัดเลือกหุ้นที่จะลงทุน เพราะข้อมูล FTSE Russell ESG Scores ที่ใช้อาจเป็นข้อมูลในอดีตที่อาจล่าช้าหรือยังไม่มีการปรับปรุงให้เป็นปัจจุบันได้ทันทีเมื่อมีเหตุการณ์เกี่ยวกับ ESG มากระทบกับบริษัทนั้นในเชิงลบ ซึ่งเหตุการณ์ดังกล่าวอาจส่งผลกระทบต่อราคาหุ้นของบริษัทนั้นและผลตอบแทนจากการลงทุนได้ทันที	

หัวข้อ	ข้อความเดิม	ข้อความที่แก้ไข	หมายเหตุ
ส่วนข้อมูลโครงการ			
	ที่บริษัทสร้างภาพลักษณ์หรือให้ข้อมูลที่ทำให้เข้าใจผิดว่ากิจการหรือผลิตภัณฑ์ของบริษัทนั้น เป็นมิตรต่อสิ่งแวดล้อมหรือสังคมเกินความเป็นจริง ดังนั้น ข้อมูล ESG Rating/Score อาจไม่สามารถสะท้อนหรือให้ความมั่นใจถึงการดำเนินงานที่ให้ความสำคัญในด้านความยั่งยืนได้จริงเสมอไป และเมื่อมีข่าวลบหรือการเปิดเผยข้อมูลที่ขัดแย้งกับภาพลักษณ์ในด้าน ESG ก็อาจส่งผลกระทบต่อราคาหุ้นของบริษัทนั้นและผลตอบแทนจากการลงทุนได้ ... **ความเสี่ยงจากการลงทุนต่อปัจจัยด้านความยั่งยืน** • แม้กองทุนจะคัดเลือกบริษัท... • ตราสารทุนที่กองทุนเข้าลงทุนเกินกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุนจะใช้วิธีคัดเลือกจากบริษัทที่ได้รับการประเมินผลการดำเนินงานหรือผลคะแนนด้านความยั่งยืน (ESG Rating/Score) จาก SET ที่เป็นผู้ประเมินผลการดำเนินงานด้านความยั่งยืนตามมาตรฐานสากล ว่ามีความโดดเด่นด้าน ESG ในระดับตั้งแต่ AA หรือเทียบเท่าขึ้นไป... • ในส่วนของการลงทุนในหลักทรัพย์ของบริษัทที่ได้รับการประเมินผลการดำเนินงานด้านความยั่งยืน (ESG Rating) จาก SET กองทุนจะเน้นเฉพาะการลงทุนในกลุ่มตราสาร... **...**	o ความเสี่ยงจากการฟอกเขียว (Greenwashing) ของบริษัทที่ได้ผลการประเมินคะแนนในระดับสูง โดยเกิดจากการที่บริษัทสร้างภาพลักษณ์หรือให้ข้อมูลที่ทำให้เข้าใจผิดว่ากิจการหรือผลิตภัณฑ์ของบริษัทนั้น เป็นมิตรต่อสิ่งแวดล้อมหรือสังคมเกินความเป็นจริง ดังนั้น ข้อมูลคะแนนอาจไม่สามารถสะท้อนหรือให้ความมั่นใจถึงการดำเนินงานที่ให้ความสำคัญในด้านความยั่งยืนได้จริงเสมอไป และเมื่อมีข่าวลบหรือการเปิดเผยข้อมูลที่ขัดแย้งกับภาพลักษณ์ในด้าน ESG ก็อาจส่งผลกระทบต่อราคาหุ้นของบริษัทนั้นและผลตอบแทนจากการลงทุนได้ ... **ความเสี่ยงจากการลงทุนต่อปัจจัยด้านความยั่งยืน** • แม้กองทุนจะคัดเลือกบริษัท... • ตราสารทุนที่กองทุนเข้าลงทุนเกินกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุนจะใช้วิธีคัดเลือกจากบริษัทที่ได้รับการประเมินจาก FTSE Russell ว่ามีความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน (Environmental, Social and Governance: ESG) ที่ได้รับ FTSE Russell ESG Scores ในระดับตั้งแต่ 3.0 ขึ้นไป ... • ในส่วนของการลงทุนในหลักทรัพย์ของบริษัทที่ได้รับการประเมินจาก FTSE Russell ว่ามีความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน (Environmental, Social and Governance:	

หัวข้อ	ข้อความเดิม	ข้อความที่แก้ไข	หมายเหตุ
ส่วนข้อมูลโครงการ			
		ESG) ที่ได้รับ FTSE Russell ESG Scores ในระดับตั้งแต่ 3.0 ขึ้นไป นี้ กองทุนจะเน้นเฉพาะการลงทุนในกลุ่มตราสาร... ... **4. แนวทางดำเนินการ และมาตรการควบคุมผลกระทบในกรณีการลงทุนไม่เป็นไปตามนโยบายการลงทุน** • กองทุนใช้กลยุทธ์การลงทุนแบบ Screening... • บริษัทจัดการจะทำการติดตามผล FTSE Russell ESG Scores จาก FTSE Russell อย่างสม่ำเสมอ และพิจารณาปรับรายชื่อหลักทรัพย์ หาก FTSE Russell ESG Scores มีการเปลี่ยนแปลง เพื่อให้เป็นไปตามหลักเกณฑ์การคัดเลือกหลักทรัพย์ตามนโยบายการลงทุน • กรณีที่การลงทุน...	
	4. แนวทางดำเนินการ และมาตรการควบคุมผลกระทบในกรณีการลงทุนไม่เป็นไปตามนโยบายการลงทุน • กองทุนใช้กลยุทธ์การลงทุนแบบ Screening... • บริษัทจัดการจะทำการติดตามผลการประเมินผลการดำเนินงานด้านความยั่งยืน (ESG Rating/Score) จาก SET หรือผู้ประเมินผลการดำเนินงานด้านความยั่งยืน อย่างสม่ำเสมอ และพิจารณาปรับรายชื่อหลักทรัพย์เพื่อให้เป็นไปตามหลักเกณฑ์การคัดเลือกหลักทรัพย์ตามนโยบายการลงทุน • กรณีที่การลงทุน...		

ตารางแสดงรายละเอียดเรื่องที่ขอแก้ไขเพิ่มเติมโครงการ

กองทุนเปิด MEGA 20 ไทยเพื่อความยั่งยืนแบบพิเศษ 80-20 U (MEGATX8020U)

หัวข้อ	ข้อความเดิม	ข้อความที่แก้ไข	หมายเหตุ
ส่วนข้อมูลโครงการ			
2. ประเภทกองทุน	**ผู้ประเมินผลการดำเนินงานด้านความยั่งยืนตามมาตรฐานสากล :** ~~**ไม่มี**~~	**ผู้ประเมินผลการดำเนินงานด้านความยั่งยืนตามมาตรฐานสากล :** **มี** **ชื่อผู้ประเมินผลการดำเนินงานด้านความยั่งยืนตามมาตรฐานสากล :** - FTSE INTERNATIONAL LIMITED	(1) กำหนดให้ FTSE INTERNATIONAL LIMITED เป็นผู้ประเมินผลการดำเนินงานด้านความยั่งยืนตามมาตรฐานสากลของกองทุน ซึ่งต้องปรับหลักเกณฑ์การคัดเลือกหลักทรัพย์จากการให้ Rating ระดับ AA หรือเทียบเท่าขึ้นไป เป็นได้รับ FTSE ESG Scores ในระดับตั้งแต่ 3.0 ขึ้นไป โดยเป็นไปตามหลักเกณฑ์/ชื่อเรียกเฉพาะของผู้ประเมินฯ ทั้งนี้ การแก้ไขไม่กระทบต่อนโยบายการลงทุนหลักในส่วนอื่น ๆ ของกองทุน (2) กำหนด SET100 Free Float Adjusted Market Capitalization Weighted Index (SET100FF Index) เป็นดัชนีชี้วัดผลการ
	รายละเอียดเพิ่มเติมเกี่ยวกับนโยบายการลงทุนและลักษณะพิเศษ: **1. นโยบายการลงทุน** กองทุนมีนโยบายลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งหุ้นของบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย และ/หรือตลาดหลักทรัพย์เอ็ม เอ ไอ (“บริษัทจดทะเบียนฯ”) ที่มีความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน (Environmental, Social and Governance: ESG) โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน กองทุนจะใช้ข้อมูลผลคะแนนด้านความยั่งยืน (ESG scores) หรือข้อมูลการจัดอันดับด้านความยั่งยืน (ESG Ratings) จากผู้ประเมินผลการดำเนินงานด้านความยั่งยืนตามมาตรฐานสากลหรือผู้ให้บริการข้อมูลด้าน ESG เป็นข้อมูลในการพิจารณาถึงความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อมหรือด้านความยั่งยืน ทั้งนี้ บริษัทจัดการขอสงวนสิทธิที่จะเปลี่ยนผู้ประเมินหรือผู้ให้บริการข้อมูล รวมถึงแต่งตั้งผู้ประเมินหรือผู้ให้บริการข้อมูลที่จะใช้ในอนาคต โดยจะประกาศให้ทราบล่วงหน้าไม่น้อยกว่า 3 วันทำการ ...	**รายละเอียดเพิ่มเติมเกี่ยวกับนโยบายการลงทุนและลักษณะพิเศษ:** **1. นโยบายการลงทุน** กองทุนมีนโยบายลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งหุ้นของบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย และ/หรือตลาดหลักทรัพย์เอ็ม เอ ไอ (“บริษัทจดทะเบียนฯ”) ที่ได้รับการประเมินจาก FTSE INTERNATIONAL LIMITED (“FTSE Russell”) ว่ามีความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน (Environmental, Social and Governance: ESG) โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน กองทุนจะพิจารณาลงทุนในหุ้นของบริษัทจดทะเบียนฯตามวรรคแรกที่ได้รับการประเมิน FTSE Russell ESG Scores ในระดับตั้งแต่ 3.0 ขึ้นไป เนื่องจากเป็นระดับคะแนนที่แสดงถึงบริษัทที่มีการดำเนินงานด้านความยั่งยืนในระดับดีที่ปฏิบัติตามมาตรฐานสากล (Good Practice) ทั้งนี้ FTSE Russell ESG Scores เป็นผลคะแนนที่จัดทำโดย FTSE Russell จากการประเมินการดำเนินงานด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน (Environmental, Social and Governance: ESG) ของบริษัทจดทะเบียนฯ โดยคะแนนจะอยู่ใน	

หัวข้อ	ข้อความเดิม	ข้อความที่แก้ไข	หมายเหตุ
ส่วนข้อมูลโครงการ			
	วัตถุประสงค์การลงทุนที่เกี่ยวข้องกับความยั่งยืน เพื่อสะท้อนให้เห็นถึงการลงทุนที่คำนึงถึงปัจจัยด้านความยั่งยืน และมุ่งเน้นลงทุนในหุ้นของบริษัทจดทะเบียนฯ ที่เห็นความสำคัญและดำเนินธุรกิจที่มีความยั่งยืนในระยะยาว (Sustainability) และสร้างผลกระทบเชิงบวกต่อสังคมและสิ่งแวดล้อม โดยกองทุนจะลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งหุ้นของบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย และ/หรือตลาดหลักทรัพย์เอ็ม เอ ไอ ที่มีข้อมูลผลคะแนนด้านความยั่งยืน (ESG scores) หรือข้อมูลการจัดอันดับด้านความยั่งยืน (ESG Ratings) จากผู้ประเมินผลการดำเนินงานด้านความยั่งยืนตามมาตรฐานสากลหรือผู้ให้บริการข้อมูลด้าน ESG ว่ามีความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน (Environmental, Social and Governance: ESG) หรือหุ้นของบริษัทจดทะเบียนฯที่มีธรรมาภิบาล (Governance) (รายละเอียดปรากฏตามกรอบการลงทุน (Investment Universe)) โดยมี net exposure ในทรัพย์สินที่ลงทุนดังกล่าวโดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน	รูปแบบของตัวเลขคะแนน 0.0 – 5.0 คะแนน 0.0 หมายถึง ไม่มีข้อมูลให้ประเมิน และคะแนน 5.0 หมายถึงเป็น Best practices ทั้งนี้ บริษัทจัดการขอสงวนสิทธิที่จะเปลี่ยนผู้ประเมินหรือผู้ให้บริการข้อมูล รวมถึงแต่งตั้งผู้ประเมินหรือผู้ให้บริการข้อมูลที่จะใช้ในอนาคต โดยจะประกาศให้ทราบล่วงหน้าไม่น้อยกว่า 3 วันทำการ ... **วัตถุประสงค์การลงทุนที่เกี่ยวข้องกับความยั่งยืน** เพื่อสะท้อนให้เห็นถึงการลงทุนที่คำนึงถึงปัจจัยด้านความยั่งยืน และมุ่งเน้นลงทุนในหุ้นของบริษัทจดทะเบียนฯ ที่เห็นความสำคัญและดำเนินธุรกิจที่มีความยั่งยืนในระยะยาว (Sustainability) และสร้างผลกระทบเชิงบวกต่อสังคมและสิ่งแวดล้อม โดยกองทุนจะลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งหุ้นของบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย และ/หรือตลาดหลักทรัพย์เอ็ม เอ ไอ ที่ได้รับการประเมินจาก FTSE Russell ว่ามีความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน (Environmental, Social and Governance: ESG) หรือหุ้นของบริษัทจดทะเบียนฯที่มีธรรมาภิบาล (Governance) (รายละเอียดปรากฏตามกรอบการลงทุน (Investment Universe)) โดยมี net exposure ในทรัพย์สินที่ลงทุนดังกล่าวโดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน	ดำเนินงาน (Performance benchmark) ของกองทุน (ในส่วนการลงทุนในหุ้น) โดยไม่รวมถึงการเป็นดัชนีชี้วัดด้านความยั่งยืน (Reference ESG benchmark) ที่เป็นภาคสมัครใจของบริษัทจัดการ

หัวข้อ	ข้อความเดิม	ข้อความที่แก้ไข	หมายเหตุ
ส่วนข้อมูลโครงการ			
	กรอบการลงทุน (Investment Universe) กองทุนจะเน้นลงทุนในหุ้นสามัญของบริษัทจดทะเบียนฯ จากทุกกลุ่มอุตสาหกรรม เฉพาะบริษัทที่จดทะเบียนจัดตั้งในประเทศไทย ที่ได้รับการประเมินผลการดำเนินงานหรือผลคะแนนด้านความยั่งยืน (ESG Rating/Score) ในระดับ AA หรือเทียบเท่าขึ้นไป หรือหุ้นของบริษัทจดทะเบียนฯที่มีธรรมาภิบาล (Governance) โดยมี net exposure ในทรัพย์สินที่ลงทุนดังกล่าวโดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน ... กรอบการลงทุนข้างต้นนี้ใช้เกณฑ์ ESG Rating/Score ในระดับ AA หรือเทียบเท่าขึ้นไป ซึ่งตัวชี้วัดนี้ไม่ได้แยกพิจารณาแค่ด้านใดด้านหนึ่ง แต่เป็นการประเมินแบบรวมทั้ง 3 มิติ: ... ดังนั้น การที่กองทุนเลือกลงทุนในหุ้นที่ผ่านเกณฑ์ AA หรือเทียบเท่าขึ้นไป จึงเป็นการส่งเสริมคุณลักษณะด้าน ESG แบบองค์รวม ผ่านกระบวนการ ESG Integration ที่เข้มข้น โดยใช้กลยุทธ์ Positive Screening เพื่อคัดเลือกลงทุนเฉพาะหุ้นไทยระดับ Top-Tier ด้านความยั่งยืน (ระดับ AA หรือเทียบเท่าขึ้นไป) โดยมุ่งหวังผลตอบแทนที่มั่นคง ควบคู่ไปกับการลดความเสี่ยงด้านความยั่งยืนอย่างต่อเนื่อง	**กรอบการลงทุน (Investment Universe)** กองทุนจะเน้นลงทุนในหุ้นสามัญของบริษัทจดทะเบียนฯ จากทุกกลุ่มอุตสาหกรรม เฉพาะบริษัทที่จดทะเบียนจัดตั้งในประเทศไทย ที่ได้รับ FTSE Russell ESG Scores ในระดับตั้งแต่ 3.0 ขึ้นไป หรือหุ้นของบริษัทจดทะเบียนฯที่มีธรรมาภิบาล (Governance) โดยมี net exposure ในทรัพย์สินที่ลงทุนดังกล่าวโดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน ... กรอบการลงทุนข้างต้นนี้ใช้การคัดเลือกหลักทรัพย์ที่ได้รับ FTSE Russell ESG Scores ในระดับตั้งแต่ 3.0 ขึ้นไป ซึ่งตัวชี้วัดนี้ไม่ได้แยกพิจารณาแค่ด้านใดด้านหนึ่ง แต่เป็นการประเมินแบบรวมทั้ง 3 มิติ: ... ดังนั้น การที่กองทุนเลือกลงทุนในหุ้นที่ผ่านเกณฑ์ ที่ได้รับ FTSE Russell ESG Scores ในระดับตั้งแต่ 3.0 ขึ้นไป จึงเป็นการส่งเสริมคุณลักษณะด้าน ESG แบบองค์รวม ผ่านกระบวนการ ESG Integration ที่เข้มข้น โดยใช้กลยุทธ์ Positive Screening เพื่อคัดเลือกลงทุนเฉพาะหุ้นไทยระดับ Top-Tier ด้านความยั่งยืน (ในระดับ 3.0 ขึ้นไป) โดยมุ่งหวังผลตอบแทนที่มั่นคง ควบคู่ไปกับการลดความเสี่ยงด้านความยั่งยืนอย่างต่อเนื่อง อนึ่ง FTSE Russell ESG Scores ในระดับ 3.0 คือบริษัทที่มีการดำเนินงานด้านความยั่งยืนในระดับดีที่ปฏิบัติตามมาตรฐานสากล (Good Practice)	

หัวข้อ	ข้อความเดิม	ข้อความที่แก้ไข	หมายเหตุ
ส่วนข้อมูลโครงการ			
	2. กลยุทธ์การลงทุน ในส่วนของการลงทุนในหุ้นของบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย และ/หรือตลาดหลักทรัพย์เอ็ม เอ ไอ (“บริษัทจดทะเบียนฯ”) ที่มีความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน (Environmental, Social and Governance: ESG) นั้น กองทุนจะใช้กลยุทธ์การลงทุนแบบ Positive Screening โดยจะคัดเลือกหลักทรัพย์ที่ได้รับการประเมินผลการดำเนินงานหรือผลคะแนนด้านความยั่งยืน (ESG Rating/Score) ในระดับตั้งแต่ AA หรือเทียบเท่าขึ้นไป เป็นหลักเกณฑ์ (Rule-based Investment Strategy) ซึ่งเป็นการกำหนดหลักเกณฑ์ เงื่อนไข รวมถึงขั้นตอนการคัดเลือกหลักทรัพย์เพื่อเข้าลงทุนไว้ล่วงหน้า **หลักเกณฑ์ในการคัดเลือกหลักทรัพย์** กองทุนจะใช้การบริหารแบบ Rule-based Approach ซึ่งจะกำหนดเกณฑ์ในการคัดเลือกจากหลักทรัพย์เฉพาะที่ได้รับการประเมินผลการดำเนินงานหรือผลคะแนนด้านความยั่งยืน (ESG Rating/Score) ในระดับ AA หรือเทียบเท่าขึ้นไป ณ ขณะลงทุน **กระบวนการวิเคราะห์และคัดเลือกหลักทรัพย์** ขั้นตอนที่ 1: คัดเลือกหลักทรัพย์ที่ได้รับการประเมินผลการดำเนินงานหรือผลคะแนนด้านความยั่งยืน (ESG Rating/Score) ขั้นตอนที่ 2: คัดเลือกหลักทรัพย์ที่ได้รับการประเมินผลการดำเนินงานหรือผลคะแนนด้านความยั่งยืน (ESG Rating/Score) จากตลาด	**2. กลยุทธ์การลงทุน** ในส่วนของการลงทุนในหุ้นของบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย และ/หรือตลาดหลักทรัพย์เอ็ม เอ ไอ (“บริษัทจดทะเบียนฯ”) ที่มีความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน (Environmental, Social and Governance: ESG) นั้น กองทุนจะใช้กลยุทธ์การลงทุนแบบ Positive Screening โดยจะคัดเลือกหลักทรัพย์เฉพาะที่ได้รับ FTSE Russell ESG Scores ในระดับตั้งแต่ 3.0 ขึ้นไป เป็นหลักเกณฑ์ (Rule-based Investment Strategy) ซึ่งเป็นการกำหนดหลักเกณฑ์ เงื่อนไข รวมถึงขั้นตอนการคัดเลือกหลักทรัพย์เพื่อเข้าลงทุนไว้ล่วงหน้า **หลักเกณฑ์ในการคัดเลือกหลักทรัพย์** กองทุนจะใช้การบริหารแบบ Rule-based Approach ซึ่งจะกำหนดเกณฑ์ในการคัดเลือกจากหลักทรัพย์เฉพาะที่ได้รับ FTSE Russell ESG Scores ในระดับตั้งแต่ 3.0 ขึ้นไป ณ ขณะลงทุน **กระบวนการวิเคราะห์และคัดเลือกหลักทรัพย์** ขั้นตอนที่ 1: คัดเลือกหลักทรัพย์ที่ได้รับการประเมินจาก FTSE Russell ว่ามีความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน (Environmental, Social and Governance: ESG)	

หัวข้อ	ข้อความเดิม	ข้อความที่แก้ไข	หมายเหตุ
ส่วนข้อมูลโครงการ			
	หลักทรัพย์แห่งประเทศไทยหรือผู้บริการข้อมูลด้าน ESG ว่ามีความโดดเด่นด้าน ESG ในระดับตั้งแต่ AA หรือเทียบเท่าขึ้นไปเท่านั้น (รวมถึง AA และ AAA) ... **ดัชนีชี้วัดผลการดำเนินงาน (Performance benchmark) และดัชนีชี้วัดด้านความยั่งยืน (Reference ESG benchmark)** (1) ดัชนีผลตอบแทนรวม SETESG (SETESG TRI) ซึ่งเป็นดัชนีที่จัดทำโดยตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เป็นดัชนีประเภท Total Return Index (TRI) ที่สะท้อนการเคลื่อนไหวราคาของกลุ่มหลักทรัพย์ของบริษัทจดทะเบียนที่มีการดำเนินธุรกิจอย่างยั่งยืนซึ่งมีขนาดมูลค่าหลักทรัพย์ตามราคาตลาด (Market Capitalization) และสภาพคล่องผ่านตามเกณฑ์ที่กำหนด โดยไม่ได้จำกัดจำนวนหลักทรัพย์ในดัชนี นอกจากนี้ ดัชนีได้รับการคัดกรองหลักทรัพย์ในด้านสิ่งแวดล้อม สังคม และบรรษัทภิบาล (ESG) มาแล้วอย่างเข้มงวดเพราะคัดเลือกเฉพาะหุ้นที่ผ่านการประเมิน SET ESG Ratings ตั้งแต่ระดับ BBB ขึ้นไป ซึ่งช่วยสร้างความน่าเชื่อถือในด้านความยั่งยืนของหุ้นในดัชนี ในสัดส่วนร้อยละ 80 ผู้ลงทุนสามารถศึกษาวิธีการจัดทำดัชนีผลตอบแทนรวม SETESG (SETESG TRI) (Index Methodology) ได้ที่ www.set.or.th/th/market/index/setesg/profile ทั้งนี้ บริษัทจัดการจะเปลี่ยนแปลงดัชนีชี้วัดของกองทุนตามข้างต้นที่จัดทำโดยตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เมื่อตลาดหลักทรัพย์	ขั้นตอนที่ 2: คัดเลือกหลักทรัพย์จากขั้นตอนที่ 1 ที่ได้รับ FTSE Russell ESG Scores ในระดับตั้งแต่ 3.0 ขึ้นไป ... **ดัชนีชี้วัดผลการดำเนินงาน (Performance benchmark)** ~~และดัชนีชี้วัดด้านความยั่งยืน (Reference ESG benchmark)~~ (1) ดัชนี SET100 Free Float Adjusted Market Capitalization Weighted Index (SET100FF Index) ในสัดส่วนร้อยละ 80 SET100FF Index เป็นดัชนีที่จัดทำโดยตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เป็นดัชนีราคาหุ้นที่สะท้อนความเคลื่อนไหวของหุ้นขนาดใหญ่ 100 อันดับแรกในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย โดยนำสัดส่วนผู้ถือหุ้นรายย่อย (Free Float) มาถ่วงน้ำหนักร่วมกับมูลค่าหลักทรัพย์ตามราคาตลาด (Market Capitalization) โดยโครงสร้างของดัชนีดังกล่าวสอดคล้องกับกระบวนการลงทุนของกองทุนที่ใช้การบริหารแบบ Rule-based Approach ซึ่งมุ่งลงทุนในบริษัทที่มีมูลค่าหลักทรัพย์ตามราคาตลาด (Market Capitalization) สูง ทั้งนี้ บริษัทจัดการจะพิจารณา FTSE Russell ESG Scores จากการประเมินของ FTSE Russell ในการคัดเลือกหลักทรัพย์ เพื่อให้สอดคล้องกับวัตถุประสงค์ด้านความยั่งยืนของกองทุน (2) ดัชนี...	

หัวข้อ	ข้อความเดิม	ข้อความที่แก้ไข	หมายเหตุ
ส่วนข้อมูลโครงการ			
	แห่งประเทศไทยมีการจัดทำดัชนี TRI ที่นำสัดส่วนผู้ถือหลักทรัพย์รายย่อยของแต่ละหลักทรัพย์ (free float) มาถ่วงน้ำหนักในการคำนวณดัชนี (ดัชนี free float TRI) เพื่อให้เป็นไปตามหลักเกณฑ์ที่คณะกรรมการกำกับตลาดทุนประกาศกำหนด (2) ดัชนี... **3. ความเสี่ยงที่เกี่ยวข้องกับการลงทุนของกองทุน** **ความเสี่ยงจากปัจจัยด้านความยั่งยืนต่อการลงทุน** • กองทุนเน้นลงทุนในหลักทรัพย์ของบริษัทที่ได้รับการประเมินผลการดำเนินงานหรือผลคะแนนด้านความยั่งยืน (ESG Rating/Score) จาก SET ที่เป็นผู้ประเมินผลการดำเนินงานด้านความยั่งยืนตามมาตรฐานสากลในระดับตั้งแต่ AA หรือเทียบเท่าขึ้นไป อาจมีความเสี่ยงที่เหตุการณ์หรือปัจจัยด้าน ESG อาจส่งผลกระทบเชิงลบต่อมูลค่าการลงทุนหรือผลการดำเนินงานของกองทุน ดังนี้ O ความเสี่ยงจากการอ้างอิงข้อมูล ESG Rating/Score ในการพิจารณาคัดเลือกหุ้นที่จะลงทุน เพราะข้อมูล ESG Rating/Score ที่ใช้อาจเป็นข้อมูลในอดีตที่อาจล่าช้าหรือยังไม่มีการปรับปรุงให้เป็นปัจจุบันได้ทันทีเมื่อมีเหตุการณ์เกี่ยวกับ ESG มากระทบกับบริษัทนั้นในเชิงลบ ซึ่งเหตุการณ์ดังกล่าวอาจส่งผลกระทบต่อราคาหุ้นของบริษัทนั้นและผลตอบแทนจากการลงทุนได้ทันที O ความเสี่ยงจากการฟอกเขียว (Greenwashing) ของบริษัทที่ได้ผลการประเมิน ESG Rating/Score ในระดับสูง โดยเกิดจากการ	**3. ความเสี่ยงที่เกี่ยวข้องกับการลงทุนของกองทุน** **ความเสี่ยงจากปัจจัยด้านความยั่งยืนต่อการลงทุน** • กองทุนเน้นลงทุนในหุ้นของบริษัทจดทะเบียนฯ ที่ได้รับการประเมินจาก FTSE Russell ว่ามีความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน (Environmental, Social and Governance: ESG) ที่ได้รับ FTSE Russell ESG Scores ในระดับตั้งแต่ 3.0 ขึ้นไป อาจมีความเสี่ยงที่เหตุการณ์หรือปัจจัยด้าน ESG อาจส่งผลกระทบเชิงลบต่อมูลค่าการลงทุนหรือผลการดำเนินงานของกองทุน ดังนี้ o ความเสี่ยงจากการอ้างอิงข้อมูล FTSE Russell ESG Scores ในการพิจารณาคัดเลือกหุ้นที่จะลงทุน เพราะข้อมูล FTSE Russell ESG Scores ที่ใช้อาจเป็นข้อมูลในอดีตที่อาจล่าช้าหรือยังไม่มีการปรับปรุงให้เป็นปัจจุบันได้ทันทีเมื่อมีเหตุการณ์เกี่ยวกับ ESG มากระทบกับบริษัทนั้นในเชิงลบ ซึ่งเหตุการณ์ดังกล่าวอาจส่งผลกระทบต่อราคาหุ้นของบริษัทนั้นและผลตอบแทนจากการลงทุนได้ทันที	

หัวข้อ	ข้อความเดิม	ข้อความที่แก้ไข	หมายเหตุ
ส่วนข้อมูลโครงการ			
	ที่บริษัทสร้างภาพลักษณ์หรือให้ข้อมูลที่ทำให้เข้าใจผิดว่ากิจการหรือผลิตภัณฑ์ของบริษัทนั้น เป็นมิตรต่อสิ่งแวดล้อมหรือสังคมเกินความเป็นจริง ดังนั้น ข้อมูล ESG Rating/Score อาจไม่สามารถสะท้อนหรือให้ความมั่นใจถึงการดำเนินงานที่ให้ความสำคัญในด้านความยั่งยืนได้จริงเสมอไป และเมื่อมีข่าวลบหรือการเปิดเผยข้อมูลที่ขัดแย้งกับภาพลักษณ์ในด้าน ESG ก็อาจส่งผลกระทบต่อราคาหุ้นของบริษัทนั้นและผลตอบแทนจากการลงทุนได้ ... **ความเสี่ยงจากการลงทุนต่อปัจจัยด้านความยั่งยืน** • แม้กองทุนจะคัดเลือกบริษัท... • ตราสารทุนที่กองทุนเข้าลงทุนเกินกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุนจะใช้วิธีคัดเลือกจากบริษัทที่ได้รับการประเมินผลการดำเนินงานหรือผลคะแนนด้านความยั่งยืน (ESG Rating/Score) จาก SET ที่เป็นผู้ประเมินผลการดำเนินงานด้านความยั่งยืนตามมาตรฐานสากล ว่ามีความโดดเด่นด้าน ESG ในระดับตั้งแต่ AA หรือเทียบเท่าขึ้นไป... • ในส่วนของการลงทุนในหลักทรัพย์ของบริษัทที่ได้รับการประเมินผลการดำเนินงานด้านความยั่งยืน (ESG Rating) จาก SET กองทุนจะเน้นเฉพาะการลงทุนในกลุ่มตราสาร... **...**	o ความเสี่ยงจากการฟอกเขียว (Greenwashing) ของบริษัทที่ได้ผลการประเมินคะแนนในระดับสูง โดยเกิดจากการที่บริษัทสร้างภาพลักษณ์หรือให้ข้อมูลที่ทำให้เข้าใจผิดว่ากิจการหรือผลิตภัณฑ์ของบริษัทนั้น เป็นมิตรต่อสิ่งแวดล้อมหรือสังคมเกินความเป็นจริง ดังนั้น ข้อมูลคะแนนอาจไม่สามารถสะท้อนหรือให้ความมั่นใจถึงการดำเนินงานที่ให้ความสำคัญในด้านความยั่งยืนได้จริงเสมอไป และเมื่อมีข่าวลบหรือการเปิดเผยข้อมูลที่ขัดแย้งกับภาพลักษณ์ในด้าน ESG ก็อาจส่งผลกระทบต่อราคาหุ้นของบริษัทนั้นและผลตอบแทนจากการลงทุนได้ ... **ความเสี่ยงจากการลงทุนต่อปัจจัยด้านความยั่งยืน** • แม้กองทุนจะคัดเลือกบริษัท... • ตราสารทุนที่กองทุนเข้าลงทุนเกินกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุนจะใช้วิธีคัดเลือกจากบริษัทที่ได้รับการประเมินจาก FTSE Russell ว่ามีความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน (Environmental, Social and Governance: ESG) ที่ได้รับ FTSE Russell ESG Scores ในระดับตั้งแต่ 3.0 ขึ้นไป ... • ในส่วนของการลงทุนในหลักทรัพย์ของบริษัทที่ได้รับการประเมินจาก FTSE Russell ว่ามีความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน (Environmental, Social and Governance:	

หัวข้อ	ข้อความเดิม	ข้อความที่แก้ไข	หมายเหตุ
ส่วนข้อมูลโครงการ			
		ESG) ที่ได้รับ FTSE Russell ESG Scores ในระดับตั้งแต่ 3.0 ขึ้นไป นี้ กองทุนจะเน้นเฉพาะการลงทุนในกลุ่มตราสาร... ... **4. แนวทางดำเนินการ และมาตรการควบคุมผลกระทบในกรณีการลงทุนไม่เป็นไปตามนโยบายการลงทุน** • กองทุนใช้กลยุทธ์การลงทุนแบบ Screening... • บริษัทจัดการจะทำการติดตามผล FTSE Russell ESG Scores จาก FTSE Russell อย่างสม่ำเสมอ และพิจารณาปรับรายชื่อหลักทรัพย์ หาก FTSE Russell ESG Scores มีการเปลี่ยนแปลง เพื่อให้เป็นไปตามหลักเกณฑ์การคัดเลือกหลักทรัพย์ตามนโยบายการลงทุน • กรณีที่การลงทุน...	
	4. แนวทางดำเนินการ และมาตรการควบคุมผลกระทบในกรณีการลงทุนไม่เป็นไปตามนโยบายการลงทุน • กองทุนใช้กลยุทธ์การลงทุนแบบ Screening... • บริษัทจัดการจะทำการติดตามผลการประเมินผลการดำเนินงานด้านความยั่งยืน (ESG Rating/Score) จาก SET หรือผู้ประเมินผลการดำเนินงานด้านความยั่งยืน อย่างสม่ำเสมอ และพิจารณาปรับรายชื่อหลักทรัพย์เพื่อให้เป็นไปตามหลักเกณฑ์การคัดเลือกหลักทรัพย์ตามนโยบายการลงทุน • กรณีที่การลงทุน...		