

กองทุนเปิดเอ็กซ์สปริง หุ้นไทยยั่งยืนซิสเทมาติก
XSpringam Sustainable Thai Equity Systematic Fund (X-SEQS-RA)
ชนิดผู้ลงทุนทั่วไป (แบบสะสมมูลค่า)

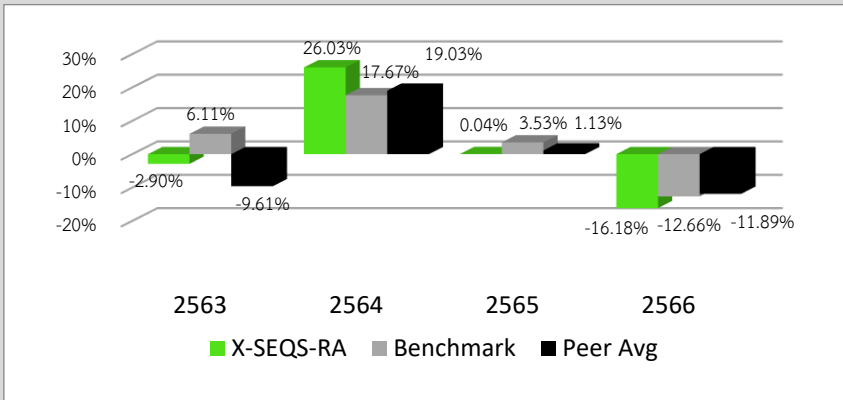
ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมตราสารทุน
- กองทุนรวมที่เน้นลงทุนแบบไม่มีความเสี่ยงต่างประเทศ
- กลุ่ม Equity General

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- กองทุนจะลงทุนในตราสารทุน ซึ่งจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET) และ/หรือตลาดหลักทรัพย์เอ็ม เอ ไอ (MAI) ที่มีการดำเนินธุรกิจ โดยคำนึงถึงปัจจัยทางด้านสิ่งแวดล้อม สังคม และธรรมาภิบาลที่ดี โดยกองทุนจะลงทุนให้มี Net Exposure ในตราสารทุนโดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน
- มุ่งหวังให้ผลประกอบการสูงกว่าดัชนีชี้วัด (active management)

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (% ต่อปี)



ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด (% ต่อปี)

	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี
X-SEQS-RA	-5.38%	-0.24%	-2.36%	-11.93%
ดัชนีชี้วัด	-1.65%	2.05%	0.95%	-7.56%
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	-1.86%	2.12%	0.06%	-7.62%
ความผันผวนกองทุน	13.55%	13.37%	13.34%	13.34%
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	11.19%	11.13%	11.19%	11.59%
	3 ปี	5 ปี	10 ปี	ตั้งแต่จัดตั้ง
X-SEQS-RA	-6.34%	-	-	-0.78%
ดัชนีชี้วัด	-1.87%	-	-	2.81%
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	-2.84%	-	-	-
ความผันผวนกองทุน	12.46%	-	-	12.91%
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	11.30%	-	-	12.70%

ระดับความเสี่ยง

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

6 : เสี่ยงสูง

ลงทุนในตราสารทุนเป็นหลักโดยเฉลี่ย
ในรอบปีไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน	21 กรกฎาคม 2563
วันเริ่มต้น class	21 กรกฎาคม 2563
นโยบายการจ่ายเงินปันผล	ไม่จ่าย
อายุกองทุน	ไม่กำหนดอายุโครงการ

ผู้จัดการกองทุนรวม

ชื่อ - นามสกุล	วันที่เริ่มบริหารกองทุน
นางสาวมนชญา รัชตกุล	23 สิงหาคม 2564
นายดำรงฤทธิ์ สำเร็จวิทย์	16 พฤษภาคม 2566

ดัชนีชี้วัด

SET TRI สัดส่วน 100%

คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวมมิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต : ไม่เข้าร่วม CAC

ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือ
บริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่อง
ได้ที่หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



www.xspringam.com

การซื้อขายหน่วยลงทุน	การขายคืนหน่วยลงทุน
วันทำการซื้อ : ทุกวันทำการ	วันทำการขายคืน : ทุกวันทำการ
เวลาทำการ : เวลาเริ่มทำการถึง 15.30 น.	เวลาทำการ : เวลาเริ่มทำการถึง 14.00 น.
การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ : 100 บาท	การขายคืนขั้นต่ำ : ไม่กำหนด
การซื้อครั้งถัดไปขั้นต่ำ : 100 บาท	ยอดคงเหลือขั้นต่ำ : ไม่กำหนด
	ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน : ภายใน 3 วันทำการ (ปัจจุบัน T+2)

ข้อมูลเชิงสถิติ

Maximum drawdown	-26.50%
Recovering Period	-
FX Hedging	-
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน	0.02
Sharpe ratio	-0.67
Alpha	-4.64
Beta	0.95
Tracking Error	-
อายุเฉลี่ยของตราสารหนี้	ไม่กำหนดอายุโครงการ

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	2.1400	1.6050
รวมค่าใช้จ่าย	5.5640	1.9636

ค่าธรรมเนียมดังกล่าวเป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะ หรือภาษีอื่นใดแล้ว

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การขาย	1.0700	1.0700
▪ กรณีซื้อกองทุนนี้อย่างเดียว		
การรับซื้อคืน	0.5350	ปัจจุบันไม่เรียกเก็บ
▪ กรณีซื้อกองทุนนี้อย่างเดียว		
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า	1.0700	1.0700
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก	0.5350	ปัจจุบันไม่เรียกเก็บ
การโอนหน่วย	ไม่มี	ไม่มี

ค่าธรรมเนียมดังกล่าวเป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะ หรือภาษีอื่นใดแล้ว

หมายเหตุ:

บริษัทจัดการขอสงวนสิทธิเรียกเก็บค่าธรรมเนียมการขาย การรับซื้อคืน การสับเปลี่ยน ค่าธรรมเนียม และค่าใช้จ่ายที่เกี่ยวกับหน่วยลงทุนกับผู้ลงทุน แต่ละชนิดไม่เท่ากัน

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน

ชื่อทรัพย์สิน	%NAV
ตราสารทุน	96.69
เงินฝากธนาคาร	3.31
ทรัพย์สินและหนี้สินอื่น	0.00

ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก

ชื่อทรัพย์สิน	%NAV
1.บริษัท ปตท. สำรวจและผลิตปิโตรเลียม จำกัด (มหาชน)	2.29
2.ธนาคารทหารไทยธนชาติ จำกัด(มหาชน)	2.27
3.บริษัท ทางด่วนและรถไฟฟ้ากรุงเทพ จำกัด (มหาชน)	2.26
4.บริษัท ผลิตไฟฟ้าราชบุรีโฮลดิ้ง จำกัด (มหาชน)	2.19
5.บริษัท ซีพี แอ็กซ์ตรา จำกัด (มหาชน)	2.16

การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม

ชื่อทรัพย์สิน	%NAV
1.ทรัพยากร/พลังงานและสาธารณูปโภค	28.32
2.พาณิชย์	12.37
3.เกษตรและอุตสาหกรรมอาหาร/อาหารและเครื่องดื่ม	9.74
4.ขนส่งและโลจิสติกส์	9.22
5.ธนาคาร	8.71

Maximum Drawdown	เปอร์เซ็นต์ผลขาดทุนสูงสุดของกองทุนรวมในระยะเวลา 5 ปีย้อนหลัง (หรือตั้งแต่จัดตั้งกองทุนกรณีที่ยังไม่ครบ 5 ปี) โดยวัดจากระดับ NAV ต่อหน่วยที่จุดสูงสุดไปจนถึงจุดต่ำสุดในช่วงที่ NAV ต่อหน่วยปรับตัวลดลง ค่า Maximum Drawdown เป็นข้อมูลที่ช่วยให้ทราบถึงความเสี่ยงที่อาจจะขาดทุนจากการลงทุนในกองทุนรวม
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน	ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลาหนึ่ง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์กับผลรวมของมูลค่าการขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 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 แสดงว่า หลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนน้อยกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด Beta มากกว่า 1 แสดงว่าหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนมากกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด
ความเสี่ยงจากความผันผวนของราคาหลักทรัพย์ (Market Risk)	ความเสี่ยงที่มีมูลค่าของหลักทรัพย์ที่กองทุนรวมลงทุนจะเปลี่ยนแปลงเพิ่มขึ้นหรือลดลงจากปัจจัยภายนอก เช่น สภาวะเศรษฐกิจการลงทุน ปัจจัยทางการเมืองทั้งในและต่างประเทศ เป็นต้น ซึ่งพิจารณาได้จากค่า Standard deviation (SD) ของกองทุนรวม หากกองทุนรวมมีค่า SD สูงแสดงว่ากองทุนรวมมีความผันผวนจากการเปลี่ยนแปลงของราคาหลักทรัพย์สูง
ความเสี่ยงจากการกระจุกตัว (High Concentration Risk)	<p>1. ความเสี่ยงจากการกระจุกตัวลงทุนในผู้ออกรายใดรายหนึ่ง (High issuer concentration Risk) พิจารณาการลงทุนแบบกระจุกตัวในตราสารของผู้ออกตราสาร คู่สัญญา หรือบุคคลอื่นที่มีภาระผูกพันตามตราสารหรือสัญญานั้นรายใดรายหนึ่งมากกว่า 10% ของ NAV รวมกันทั้งนี้ การลงทุนแบบกระจุกตัวไม่รวมถึงกรณีการลงทุนในทรัพย์สินดังนี้</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. ตราสารหนี้ภาครัฐไทย 2. ตราสารภาครัฐต่างประเทศที่มีการจัดอันดับความน่าเชื่อถืออยู่ในอันดับที่สามารถลงทุนได้ 3. เงินฝากหรือตราสารเทียบเท่าเงินฝากที่ผู้รับฝากหรือผู้ออกตราสารที่มีการจัดอันดับความน่าเชื่อถืออยู่ในอันดับที่สามารถลงทุนได้ <p>2. ความเสี่ยงจากการลงทุนกระจุกตัวในหมวดอุตสาหกรรมใดอุตสาหกรรมหนึ่ง (Sector Concentration Risk) เกิดจากกองทุนลงทุนในบางหมวดอุตสาหกรรมมากกว่า 20% ของ NAV รวมกัน ซึ่งหากเกิดเหตุการณ์ที่ส่งผลกระทบต่ออุตสาหกรรมนั้น กองทุนดังกล่าวอาจมีผลการดำเนินงานที่ผันผวนมากกว่ากองทุนที่กระจายการลงทุนในหลายหมวดอุตสาหกรรม</p>
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุนของกองทุนรวม (Portfolio Turnover Ratio: PTR)	คำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อขายทรัพย์สินที่กองทุนรวมลงทุนในรอบระยะเวลาบัญชีที่ผ่านมาหารด้วยมูลค่าทรัพย์สินสุทธิเฉลี่ยของกองทุนรวมในรอบระยะเวลาบัญชีเดียวกัน เพื่อให้ผู้ลงทุนทราบถึงข้อมูลการซื้อขายทรัพย์สินและสะท้อนกลยุทธ์การลงทุนของกองทุน เช่น กองทุน Passive Management จะมี PTR ต่ำ ในขณะที่กองทุน Active Management จะมี PTR สูง ดังนั้น ทรัพย์สินที่นำมาคำนวณรวมใน PTR จึงควรเป็นทรัพย์สินประเภทที่โดยลักษณะแล้วจะมีการซื้อขายเปลี่ยนมือเพื่อการลงทุน เช่น ตราสารทุนตราสารหนี้ เป็นต้น

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน เอ็กซ์สปริง จำกัด

โทร. 02-030-3730 www.xspringam.com

เลขที่ 59 สิริ แคมปัส อาคาร ดี ชั้น 2

ซอยริมคลองพระโขนง แขวงพระโขนงเหนือ เขตวัฒนา กรุงเทพมหานคร