

# กองทุนเปิดเอ็กซ์สปริง หุ้นไทยยั่งยืนซิสเทมาติก

## XSpring Sustainable Thai Equity Systematic Fund (X-SEQS-ASSF)

### ชนิดผู้ลงทุนเพื่อการออม (แบบสะสมมูลค่า)

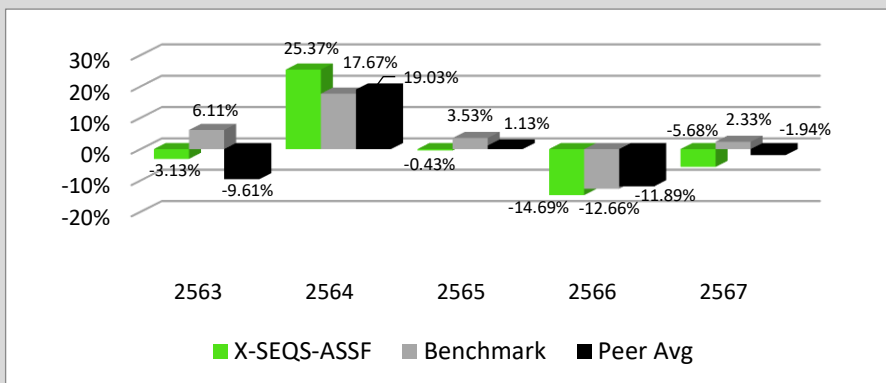
#### ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- 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-ASSF              | -15.66% | -9.37%  | -15.66% | -11.37%        |
| ดัชนีชี้วัด              | -19.87% | -4.44%  | -19.87% | -12.70%        |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน | -19.20% | -6.07%  | -19.20% | -15.83%        |
| ความผันผวนกองทุน         | 14.69%  | 17.18%  | 14.69%  | 14.04%         |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด    | 19.96%  | 22.80%  | 19.96%  | 16.61%         |
|                          | 3 ปี    | 5 ปี    | 10 ปี   | ตั้งแต่จัดตั้ง |
| X-SEQS-ASSF              | -10.24% | -       | -       | -3.92%         |
| ดัชนีชี้วัด              | -8.31%  | -       | -       | -1.55%         |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน | -9.89%  | -       | -       | -              |
| ความผันผวนกองทุน         | 12.67%  | -       | -       | 13.02%         |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด    | 13.05%  | -       | -       | 13.45%         |

#### 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 |
|----------------------|-------------------------|
| นาย ยศกร พลเลิศ      | 1 กันยายน 2567          |
| นาย เมธวัฒน์ ว่องกิจ | 1 กันยายน 2567          |

#### ดัชนีชี้วัด

SET TRI สัดส่วน 100%

#### คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวมมิได้เป็นที่ยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต : ไม่เข้าร่วม CAC

ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือ  
บริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่อง  
ได้ที่หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



www.xspringam.com

## การซื้อขายหน่วยลงทุน

วันทำการซื้อ : ทุกวันทำการ

เวลาทำการ : เวลาเริ่มทำการถึง 15.30 น.

การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ : 100 บาท

การซื้อครั้งถัดไปขั้นต่ำ : 100 บาท

## การขายคืนหน่วยลงทุน

วันทำการขายคืน : ทุกวันทำการ

เวลาทำการ : เวลาเริ่มทำการถึง 14.00 น.

การขายคืนขั้นต่ำ : ไม่กำหนด

ยอดคงเหลือขั้นต่ำ : ไม่กำหนด

ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน : ภายใน 3 วันทำการ (ปัจจุบัน T+2)

## ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)

| ค่าธรรมเนียม  | สูงสุดไม่เกิน | เก็บจริง |
|---------------|---------------|----------|
| การจัดการ     | 2.1400        | 2.1400   |
| รวมค่าใช้จ่าย | 5.5640        | 2.4986   |

ค่าธรรมเนียมดังกล่าวเป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะ หรือภาษีอื่นใดแล้ว

## ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)

| ค่าธรรมเนียม                                                                                 | สูงสุดไม่เกิน | เก็บจริง             |
|----------------------------------------------------------------------------------------------|---------------|----------------------|
| การขาย <ul style="list-style-type: none"> <li>กรณีซื้อกองทุนน้อยอย่างเดียว</li> </ul>        | 1.0700        | ปัจจุบันไม่เรียกเก็บ |
| การรับซื้อคืน <ul style="list-style-type: none"> <li>กรณีซื้อกองทุนน้อยอย่างเดียว</li> </ul> | 0.5350        | ปัจจุบันไม่เรียกเก็บ |
| การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า                                                                  | 1.0700        | 1.0700               |
| การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก                                                                   | 0.5350        | ปัจจุบันไม่เรียกเก็บ |
| การโอนหน่วย                                                                                  | ไม่มี         | ไม่มี                |

ค่าธรรมเนียมดังกล่าวเป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะ หรือภาษีอื่นใดแล้ว  
หมายเหตุ:

บริษัทจัดการขอสงวนสิทธิเรียกเก็บค่าธรรมเนียมการขาย การรับซื้อคืน การสับเปลี่ยน ค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายเกี่ยวกับหน่วยลงทุนกับผู้ลงทุน แต่ละชนิดไม่เท่ากัน

## ข้อมูลเชิงสถิติ

|                            |         |
|----------------------------|---------|
| Maximum drawdown           | -35.98% |
| Recovering Period          | -       |
| FX Hedging                 | -       |
| อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน | 0.01    |
| Sharpe ratio               | -1.14   |
| Alpha                      | -3.92   |
| Beta                       | 0.86    |
| Tracking Error             | -       |

## สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน

| ชื่อทรัพย์สิน           | %NAV  |
|-------------------------|-------|
| ตราสารทุน               | 94.04 |
| เงินฝากธนาคาร           | 5.96  |
| ทรัพย์สินและหนี้สินอื่น | 0.00  |

## ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก

| ชื่อทรัพย์สิน                                | %NAV |
|----------------------------------------------|------|
| บริษัท ทีเอสโก้ไฟแนนเชียลกรุ๊ป จำกัด (มหาชน) | 9.32 |
| บริษัท กรุงเทพดุสิตเวชการ จำกัด (มหาชน)      | 9.17 |
| บริษัท ทุนธนชาติ จำกัด (มหาชน)               | 9.06 |
| ธนาคาร กสิกรไทย จำกัด (มหาชน)                | 7.75 |
| บริษัท เมก้า โลฟไซแอนซ์ จำกัด (มหาชน)        | 6.09 |

## การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม

| ชื่อทรัพย์สิน                               | %NAV  |
|---------------------------------------------|-------|
| ธนาคาร                                      | 35.94 |
| การแพทย์                                    | 20.16 |
| พาณิชย์                                     | 12.45 |
| เกษตรและอุตสาหกรรมอาหาร/อาหารและเครื่องดื่ม | 7.27  |
| พัฒนาอสังหาริมทรัพย์                        | 5.83  |

**คำอธิบาย**

|                                                                               |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
|-------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <b>Maximum Drawdown</b>                                                       | เปอร์เซ็นต์ผลขาดทุนสูงสุดของกองทุนรวมในระยะเวลา 5 ปีย้อนหลัง (หรือตั้งแต่จัดตั้งกองทุนกรณีที่ยังไม่ครบ 5 ปี) โดยวัดจากระดับ NAV ต่อหน่วยที่จุดสูงสุดไปจนถึงจุดต่ำสุดในช่วงที่ NAV ต่อหน่วยปรับตัวลดลง ค่า Maximum Drawdown เป็นข้อมูลที่ช่วยให้ทราบถึงความเสี่ยงที่อาจจะขาดทุนจากการลงทุนในกองทุนรวม                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| <b>อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน</b>                                             | ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลาหนึ่ง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์กับผลรวมของมูลค่าการขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 1 ปีหารด้วยมูลค่า NAV ของกองทุนรวมเฉลี่ยในรอบระยะเวลาเดียวกัน กองทุนรวมที่มีค่า portfolio turnover สูง บ่งชี้ถึงการซื้อขายหลักทรัพย์บ่อยครั้งของผู้จัดการกองทุนและทำให้มีต้นทุนการซื้อขายหลักทรัพย์ที่สูง จึงต้องพิจารณาเปรียบเทียบกับผลการดำเนินงานของกองทุนรวมเพื่อประเมินความคุ้มค่าของการซื้อขายหลักทรัพย์ดังกล่าว                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| <b>Sharpe Ratio</b>                                                           | อัตราส่วนระหว่างผลตอบแทนส่วนเพิ่มของกองทุนรวมเปรียบเทียบกับความเสี่ยงจากการลงทุน โดยคำนวณจากผลต่างระหว่างอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมกับอัตราผลตอบแทนที่ปราศจากความเสี่ยง (risk-free rate) เปรียบเทียบกับค่าเบี่ยงเบนมาตรฐาน (standard deviation) ของกองทุนรวม ค่า Sharpe Ratio สะท้อนถึงอัตราผลตอบแทนที่กองทุนรวมควรได้รับเพิ่มขึ้นเพื่อชดเชยกับความเสี่ยงที่กองทุนรวมรับมา โดยกองทุนรวมที่มีค่า Sharpe Ratio สูงกว่าจะเป็นกองทุนที่มีประสิทธิภาพในการบริหารจัดการลงทุนที่ดีกว่า เนื่องจากได้รับผลตอบแทนส่วนเพิ่มที่สูงกว่าภายใต้ระดับความเสี่ยงเดียวกัน                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| <b>Alpha</b>                                                                  | ผลตอบแทนส่วนเกินของกองทุนรวมเมื่อเปรียบเทียบกับดัชนีชี้วัด (benchmark) โดยค่า Alpha ที่สูง หมายถึง กองทุนสามารถสร้างผลตอบแทนได้สูงกว่าดัชนีชี้วัด ซึ่งเป็นผลจากประสิทธิภาพของผู้จัดการกองทุนในการคัดเลือกหรือหาจังหวะเข้าลงทุนในหลักทรัพย์ได้อย่างเหมาะสม                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
| <b>Beta</b>                                                                   | ระดับและทิศทางการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุน โดยเปรียบเทียบกับอัตราการเปลี่ยนแปลงของตลาด Beta น้อยกว่า 1 แสดงว่า หลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนน้อยกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด Beta มากกว่า 1 แสดงว่าหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนมากกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| <b>ความเสี่ยงจากความผันผวนของราคาหลักทรัพย์ (Market Risk)</b>                 | ความเสี่ยงที่มีมูลค่าของหลักทรัพย์ที่กองทุนรวมลงทุนจะเปลี่ยนแปลงเพิ่มขึ้นหรือลดลงจากปัจจัยภายนอก เช่น สภาวะเศรษฐกิจการลงทุน ปัจจัยทางการเมืองทั้งในและต่างประเทศ เป็นต้น ซึ่งพิจารณาได้จากค่า Standard deviation (SD) ของกองทุนรวม หากกองทุนรวมมีค่า SD สูงแสดงว่ากองทุนรวมมีความผันผวนจากการเปลี่ยนแปลงของราคาหลักทรัพย์สูง                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| <b>ความเสี่ยงจากการกระจุกตัว (High Concentration Risk)</b>                    | <p>1. ความเสี่ยงจากการกระจุกตัวลงทุนในผู้ออกรายใดรายหนึ่ง (High issuer concentration Risk) พิจารณาการลงทุนแบบกระจุกตัวในตราสารของผู้ออกตราสาร คู่สัญญา หรือบุคคลอื่นที่มีภาระผูกพันตามตราสารหรือสัญญาในรายใดรายหนึ่งมากกว่า 10% ของ NAV รวมกันทั้งนี้ การลงทุนแบบกระจุกตัวไม่รวมถึงกรณีการลงทุนในทรัพย์สินดังนี้</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1.ตราสารหนี้ภาครัฐไทย</li> <li>2.ตราสารภาครัฐต่างประเทศที่มีการจัดอันดับความน่าเชื่อถืออยู่ในอันดับที่สามารถลงทุนได้</li> <li>3.เงินฝากหรือตราสารเทียบเท่าเงินฝากที่ผู้รับฝากหรือผู้ออกตราสารที่มีการจัดอันดับความน่าเชื่อถืออยู่ในอันดับที่สามารถลงทุนได้</li> </ol> <p>2. ความเสี่ยงจากการลงทุนกระจุกตัวในหมวดอุตสาหกรรมใดอุตสาหกรรมหนึ่ง (Sector Concentration Risk) เกิดจากกองทุนลงทุนในบางหมวดอุตสาหกรรมมากกว่า 20% ของ NAV รวมกัน ซึ่งหากเกิดเหตุการณ์ที่ส่งผลกระทบต่ออุตสาหกรรมนั้น กองทุนดังกล่าวอาจมีผลการดำเนินงานที่ผันผวนมากกว่ากองทุนที่กระจายการลงทุนในหลายหมวดอุตสาหกรรม</p> |
| <b>อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุนของกองทุนรวม (Portfolio Turnover Ratio: PTR)</b> | คำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อขายทรัพย์สินกับผลรวมของมูลค่าการขายทรัพย์สินที่กองทุนรวมลงทุนในรอบระยะเวลาบัญชีที่ผ่านมาหารด้วยมูลค่าทรัพย์สินสุทธิเฉลี่ยของกองทุนรวมในรอบระยะเวลาบัญชีเดียวกัน เพื่อให้ผู้ลงทุนทราบถึงข้อมูลค่าการซื้อขายทรัพย์สินและสะท้อนกลยุทธ์การลงทุนของกองทุน 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](http://www.xspringam.com)

เลขที่ 59 สิริ แคมปัส อาคาร ดี ชั้น 2

ซอยริมคลองพระโขนง แขวงพระโขนงเหนือ เขตวัฒนา กรุงเทพมหานคร