

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

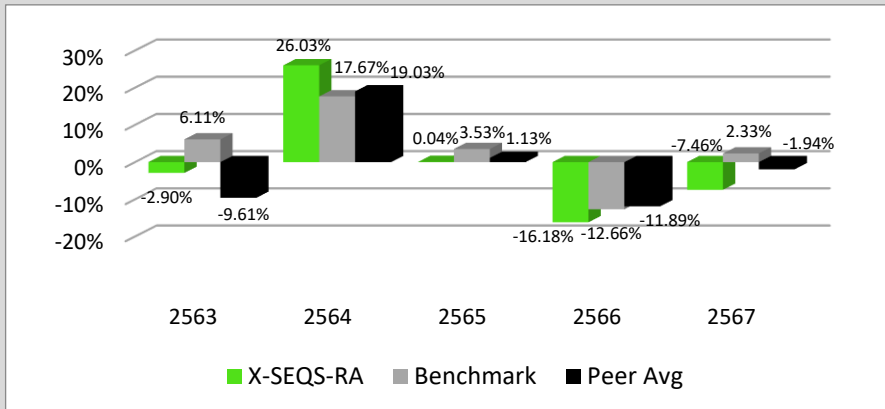
## ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- 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                | -8.84%  | -3.08%  | -6.13%  | -4.88%         |
| ดัชนีชี้วัด              | -8.63%  | 4.42%   | -2.68%  | -1.97%         |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน | -10.10% | 2.08%   | -4.74%  | -6.74%         |
| ความผันผวนกองทุน         | 14.97%  | 15.28%  | 15.51%  | 14.36%         |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด    | 20.25%  | 19.38%  | 21.13%  | 17.50%         |
|                          | 3 ปี    | 5 ปี    | 10 ปี   | ตั้งแต่จัดตั้ง |
| X-SEQS-RA                | -9.33%  | -2.29%  | -       | -2.83%         |
| ดัชนีชี้วัด              | -4.38%  | 1.81%   | -       | 1.08%          |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน | -6.66%  | -0.59%  | -       | -              |
| ความผันผวนกองทุน         | 13.09%  | 13.22%  | -       | 13.24%         |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด    | 13.38%  | 13.59%  | -       | 13.61%         |

## 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 พอลเลิศ     | 1 กันยายน 2567          |
| นาย เมธวัฒน์ ว่องกิจ | 1 กันยายน 2567          |

## ดัชนีชี้วัด

SET TRI สัดส่วน 100%

## คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวมมิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

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)

## ข้อมูลเชิงสถิติ

|                            |         |
|----------------------------|---------|
| Maximum drawdown           | -38.63% |
| Recovering Period          | -       |
| FX Hedging                 | -       |
| อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน | 0.27    |
| Sharpe ratio               | -1.05   |
| Alpha                      | -6.56   |
| Beta                       | 0.84    |
| Tracking Error             | -       |

## 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               |
| ▪ กรณีซื้อกองทุนนี้โดยตรง   |               |                      |
| การรับซื้อคืน               | 0.5350        | ปัจจุบันไม่เรียกเก็บ |
| ▪ กรณีซื้อกองทุนนี้โดยตรง   |               |                      |
| การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า | 1.0700        | 1.0700               |
| การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก  | 0.5350        | ปัจจุบันไม่เรียกเก็บ |
| การโอนหน่วย                 | ไม่มี         | ไม่มี                |

ค่าธรรมเนียมดังกล่าวเป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะ หรือภาษีอื่นใดแล้ว  
หมายเหตุ:

บริษัทจัดการขอสงวนสิทธิเรียกเก็บค่าธรรมเนียมการขาย การรับซื้อคืน การสับเปลี่ยน ค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายเกี่ยวกับหน่วยลงทุนกับผู้ลงทุน แต่ละชนิดไม่เท่ากัน

## สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน

| ชื่อทรัพย์สิน           | %NAV  |
|-------------------------|-------|
| ตราสารทุน               | 97.79 |
| เงินฝากธนาคาร           | 2.21  |
| ทรัพย์สินและหนี้สินอื่น | 0.00  |

## ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก

| ชื่อทรัพย์สิน                               | %NAV |
|---------------------------------------------|------|
| ธนาคารเกียรตินาคินภัทร จำกัด (มหาชน)        | 8.69 |
| บริษัท กรุงเทพดุสิตเวชการ จำกัด (มหาชน)     | 8.53 |
| บริษัท ทีเอสไอไฟแนนเชียลกรุ๊ป จำกัด (มหาชน) | 8.28 |
| ธนาคาร กสิกรไทย จำกัด (มหาชน)               | 8.23 |
| บริษัท เมก้า โลฟโซแอนด์ จำกัด (มหาชน)       | 7.27 |

## การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม

| ชื่อทรัพย์สิน                  | %NAV  |
|--------------------------------|-------|
| ธนาคาร                         | 25.20 |
| การแพทย์                       | 18.84 |
| พาณิชย์                        | 12.61 |
| ทรัพยากร/พลังงานและสาธารณูปโภค | 11.58 |
| พัฒนาอสังหาริมทรัพย์           | 9.88  |

## คำอธิบาย

|                                                                        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
|------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 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                                                                   | ระดับและทิศทาง การเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุน โดยเปรียบเทียบกับอัตราผลตอบแทนของการเปลี่ยนแปลงของตลาด 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 หรือบุคคลอื่นที่มีการผูกพันตามตราสารหรือสัญญานั้นรายใดรายหนึ่งมากกว่า 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> |
| อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุนของกองทุนรวม (Portfolio Turnover Ratio: PTR) | คำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์กับผลรวมของมูลค่าการขายหลักทรัพย์ที่กองทุนรวมลงทุนในรอบระยะเวลาบัญชีที่ผ่านมาหารด้วยมูลค่าทรัพย์สินสุทธิเฉลี่ยของกองทุนรวมในรอบระยะเวลาบัญชีเดียวกัน เพื่อให้ผู้ลงทุนทราบถึงข้อมูลการซื้อขายหลักทรัพย์และสะท้อนกลยุทธ์การลงทุนของกองทุน 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