

กองทุนเปิดเอ็กซ์สปริง หุ้นไทยยั่งยืนซิสเทมาติก

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

ชนิดผู้ลงทุนเพื่อการออม (แบบสะสมมูลค่า)

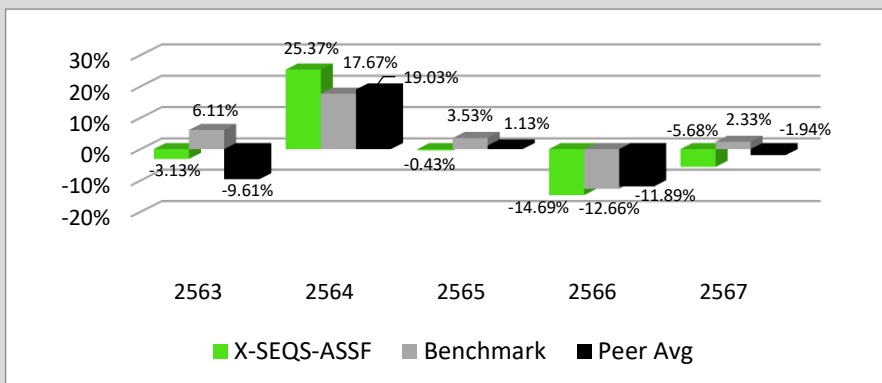
ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- 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	-7.48%	-1.98%	-5.20%	-3.08%
ดัชนีชี้วัด	-8.63%	4.42%	-2.68%	-1.97%
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	-10.10%	2.08%	-4.74%	-6.74%
ความผันผวนกองทุน	14.91%	15.08%	15.42%	14.36%
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	20.25%	19.38%	21.13%	17.50%
	3 ปี	5 ปี	10 ปี	ตั้งแต่จัดตั้ง
X-SEQS- ASSF	-7.81%	-1.52%	-	-2.07%
ดัชนีชี้วัด	-4.38%	1.81%	-	1.08%
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	-6.66%	-0.59%	-	-
ความผันผวนกองทุน	12.78%	13.03%	-	13.06%
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 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 กรณีซื้อกองทุนน้อยอย่างเดียว	1.0700	ปัจจุบันไม่เรียกเก็บ
การรับซื้อคืน กรณีซื้อกองทุนน้อยอย่างเดียว	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	-0.91
Alpha	-4.94
Beta	0.84
Tracking Error	-

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 โลไฟไซแอนซ์ 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 เป็นข้อมูลที่จะช่วยให้ทราบถึงความเสี่ยงที่อาจเกิดขึ้นจากกองทุนรวม
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 สูงกว่าจะเป็นกองทุนที่มีประสิทธิภาพในการบริหารจัดการการลงทุนที่ดีกว่า 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)	1. ความเสี่ยงจากการกระจุกตัวลงทุนในผู้ออกตราสารใดรายหนึ่ง (High issuer concentration Risk) พิจารณาการลงทุนแบบกระจุกตัวในตราสารของผู้ออกตราสาร คู่สัญญา หรือบุคคลอื่นที่มีภาระผูกพันตามตราสารหรือสัญญาในรายใดรายหนึ่งมากกว่า 10% ของ NAV รวมกันทั้งนี้ การลงทุนแบบกระจุกตัวไม่รวมถึงกรณีการลงทุนในทรัพย์สินดังนี้ 1.ตราสารหนี้ภาครัฐไทย 2.ตราสารภาครัฐต่างประเทศที่มีการจัดอันดับความน่าเชื่อถืออยู่ในอันดับที่สามารถลงทุนได้ 3.เงินฝากหรือตราสารเทียบเท่าเงินฝากที่ผู้รับฝากหรือผู้ออกตราสารที่มีการจัดอันดับความน่าเชื่อถืออยู่ในอันดับที่สามารถลงทุนได้ 2. ความเสี่ยงจากการลงทุนกระจุกตัวในหมวดอุตสาหกรรมใดอุตสาหกรรมหนึ่ง (Sector Concentration Risk) เกิดจากกองทุนลงทุนในบางหมวดอุตสาหกรรมมากกว่า 20% ของ NAV รวมกัน ซึ่งหากเกิดเหตุการณ์ที่ส่งผลกระทบต่ออุตสาหกรรมนั้น กองทุนดังกล่าวอาจมีผลการดำเนินงานที่ผันผวนมากกว่ากองทุนที่กระจายการลงทุนในหลายหมวดอุตสาหกรรม
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุนของกองทุนรวม (Portfolio Turnover Ratio: PTR)	คำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์กับผลรวมของมูลค่าการขายทรัพย์สินที่กองทุนรวมลงทุนในรอบระยะเวลาบัญชีที่ผ่านมาหารด้วยมูลค่าทรัพย์สินสุทธิเฉลี่ยของกองทุนรวมในรอบระยะเวลาบัญชีเดียวกัน 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

เลขที่ 59 สิริ แคมปัส อาคาร ดี ชั้น 2

ซอยริมคลองพระโขนง แขวงพระโขนงเหนือ เขตวัฒนา กรุงเทพมหานคร