

# กองทุนเปิด เอ็กซ์สปริง หุ้นไทยยั่งยืนซิสเทมาติก XSpringam Sustainable Thai Equity Systematic Fund (X-SEQS-RD) ชนิดผู้ลงทุนทั่วไป (แบบจ่ายเงินปันผล)

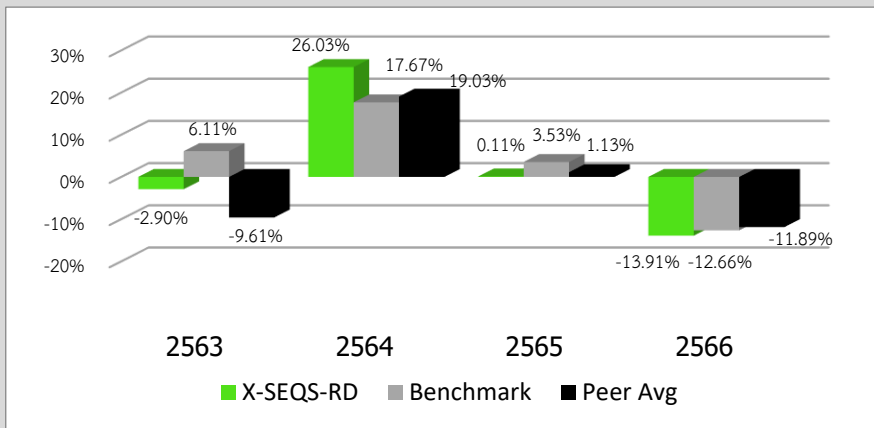
## ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- 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-RD	-6.74%	-2.05%	-4.66%	-11.61%
ดัชนีชี้วัด	-2.86%	-0.32%	-0.27%	-9.34%
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	-3.30%	-0.69%	-0.56%	-9.05%
ความผันผวนกองทุน	12.30%	12.49%	12.11%	12.85%
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	10.40%	10.61%	10.26%	11.30%
	3 ปี	5 ปี	10 ปี	ตั้งแต่จัดตั้ง
X-SEQS-RD	-6.55%	-	-	-0.43%
ดัชนีชี้วัด	-2.61%	-	-	2.42%
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	-3.24%	-	-	-
ความผันผวนกองทุน	12.27%	-	-	12.76%
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	11.12%	-	-	12.60%

## ระดับความเสี่ยง



6 : เสี่ยงสูง

ลงทุนในตราสารทุนเป็นหลักโดยเฉลี่ย  
ในรอบปีไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV

## ข้อมูลกองทุนรวม

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

## ผู้จัดการกองทุนรวม

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

## ดัชนีชี้วัด

SET TRI สัดส่วน 100%

## คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวมมิได้เป็นที่ยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

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	-23.47%
Recovering Period	-
FX Hedging	-
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน	0.00
Sharpe ratio	-0.70
Alpha	-4.16
Beta	0.97
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
▪ กรณีซื้อกองทุนนี้โดยตรง		
การรับซื้อคืน	0.5350	ปัจจุบันไม่เรียกเก็บ
▪ กรณีซื้อกองทุนนี้โดยตรง		
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า	1.0700	1.0700
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก	0.5350	ปัจจุบันไม่เรียกเก็บ
การโอนหน่วย	ไม่มี	ไม่มี

ค่าธรรมเนียมดังกล่าวเป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะ หรือภาษีอื่นใดแล้ว  
หมายเหตุ:

บริษัทจัดการขอสงวนสิทธิ์เรียกเก็บค่าธรรมเนียมการขาย การรับซื้อคืน การสับเปลี่ยน ค่าธรรมเนียม และค่าใช้จ่ายที่เกี่ยวข้องกับหน่วยลงทุนกับผู้ลงทุน แต่ละชนิดไม่เท่ากัน

### สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน

ชื่อทรัพย์สิน	%NAV
ตราสารทุน	97.49
เงินฝากธนาคาร	2.51
ทรัพย์สินและหนี้สินอื่น	0.00

### ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก

ชื่อทรัพย์สิน	%NAV
บริษัท ท่าอากาศยานไทย จำกัด (มหาชน)	9.11
บริษัท ซีพี แอ็กซ์ตรา จำกัด (มหาชน)	6.27
บริษัท ปตท.สำรวจและผลิตปิโตรเลียม จำกัด (มหาชน)	6.24
บริษัท ซีเค พาวเวอร์ จำกัด (มหาชน)	5.26
บริษัท ซีพี ออลล์ จำกัด (มหาชน)	4.99

### การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม

ชื่อทรัพย์สิน	%NAV
ทรัพยากร/พลังงานและสาธารณูปโภค	25.32
ธนาคาร	15.27
พาณิชย์	11.36
ขนส่งและโลจิสติกส์	9.11
การแพทย์	7.86

<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 หรือบุคคลอื่นที่มีภาระผูกพันตามตราสารหรือสัญญานั้นรายใดรายหนึ่งมากกว่า 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>	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 ลีรี แคมปัส อาคาร ดี ชั้น 2

ซอยริมคลองพระโขนง แขวงพระโขนงเหนือ เขตวัฒนา กรุงเทพมหานคร