

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน
อีเอสทีเอสบริง (ประเทศไทย) จำกัด

ข้อมูล ณ วันที่ 31 พฤษภาคม 2567

ชนิดสะสมมูลค่า

SRI Fund

Class ES-SETESG-A

ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- ▶ กองทุนรวมตราสารทุน (Equity Fund)
- ▶ กองทุนรวมดัชนี (Index Fund)
- ▶ กองทุนรวมเพื่อความยั่งยืน (SRI Fund)
- ▶ กลุ่ม Equity Large Cap

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- ▶ กองทุนมีนโยบายที่จะเน้นลงทุนในหุ้นที่เป็นองค์ประกอบของดัชนีผลตอบแทนรวม SETESG Index (SETESG TRI) เพื่อสร้างผลตอบแทนให้ใกล้เคียงกับดัชนีดังกล่าวโดยจะลงทุนโดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินของกองทุน โดยจะเลือกลงทุนเฉพาะในหุ้นที่เป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยบนกระดานหลัก หรือ กระดานเอ็มเอไอ ที่มีความโดดเด่นด้านความยั่งยืน โดยจะพยายามดำรงค่าความผันผวนของส่วนต่างของผลตอบแทนเฉลี่ยของกองทุนรวมและผลตอบแทนของดัชนีชี้วัด (tracking error : ไม่เกิน 1.00% ต่อปี)
- ▶ กลยุทธ์การลงทุน : มุ่งหวังให้ได้รับผลประกอบการเคลื่อนไหวตามดัชนีชี้วัด

ระดับความเสี่ยง

ต่ำ 1 2 3 4 5 6 7 8 สูง

คำอธิบาย

ลงทุนในตราสารทุนเป็นหลัก โดยเฉลี่ยในรอบปีไม่น้อยกว่า 80%
ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน	20 ธ.ค. 2566
วันเริ่มต้น class	17 พ.ค. 2567
นโยบายการจ่ายเงินปันผล	ไม่มีนโยบายจ่ายเงินปันผล
การรับซื้อคืนหน่วยลงทุนอัตโนมัติ	-
อายุกองทุน	ไม่กำหนด

ดัชนีชี้วัด :

- SET ESG Total Return Index สัดส่วน 100%
สำหรับผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปึกทหมด ผลการดำเนินงานน้อยกว่า 1 ปี คำนวณตามระยะเวลาจริง

คำเตือน :

- ▶ การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ▶ ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวม มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต: มีบริษัทแม่ดูแลให้ทำตามกฎหมาย

การซื้อขายหน่วยลงทุน

วันทำการซื้อ: ทุกวันทำการ

เวลาทำการ: 08:30 น. -15:30 น.

การซื้อขายครั้งแรกขั้นต่ำ: 1 บาท

การซื้อขายครั้งถัดไปขั้นต่ำ: 1 บาท

Remark: ปัจจุบัน และในภาวะปกติจะชำระเงินภายใน 2 วันทำการหลังจากวันทำการขายคืน

การขายคืนหน่วยลงทุน

วันทำการขายคืน: ทุกวันทำการ

เวลาทำการ: 08:30 น. -15:30 น.

การขายคืนขั้นต่ำ: 1 บาท

ยอดคงเหลือขั้นต่ำ: ไม่กำหนด

ระยะเวลาชำระเงินค่าขายคืน: T+2

การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม

กลุ่มอุตสาหกรรม	% NAV
พลังงานและสาธารณูปโภค	25.38
ธนาคาร	14.74
พาณิชย์	10.01
ขนส่งและโลจิสติกส์	8.14
เทคโนโลยีสารสนเทศและการสื่อสาร	7.93

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	1.6050	0.5000
รวมค่าใช้จ่าย	2.4075	0.6693

หมายเหตุ: บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าหน่วยลงทุน)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การขาย	1.5000	ยกเว้น
การรับซื้อคืน	ไม่มี	ไม่มี
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า	1.5000	ยกเว้น
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก	ไม่มี	ไม่มี
การโอนหน่วย	5	5

หมายเหตุ: ส่วนต่างมูลค่าหน่วยลงทุน (Spread) ที่เรียกเก็บจากผู้ทำรายการนี้ เพื่อนำไปชำระเป็นค่าใช้จ่ายในการซื้อขายหลักทรัพย์ของกองทุน ไม่เกินร้อยละ 0.25 ของมูลค่าหน่วยลงทุน เก็บจริงร้อยละ 0.10 ของมูลค่าหน่วยลงทุน

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน

ชื่อประเภททรัพย์สิน	% NAV
หุ้นสามัญ	99.36
เงินฝากธนาคารประเภทออมทรัพย์	0.87
ประเภทรายการค้างรับอื่นๆ	0.03
ใบสำคัญแสดงสิทธิที่จะซื้อหุ้น	0.01
รายการอื่นๆ	-0.27

ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก

ชื่อหลักทรัพย์	% NAV
บริษัท ปตท.สำรวจและผลิตปิโตรเลียม จำกัด (มหาชน)	5.24
บริษัท ท่าอากาศยานไทย จำกัด (มหาชน)	5.11
บริษัท ซีพี ออลล์ จำกัด (มหาชน)	5.09
บริษัท แอดวานซ์ อินโฟร์ เซอร์วิส จำกัด (มหาชน)	5.08
บริษัท ปตท. จำกัด (มหาชน)	5.00

ผู้จัดการกองทุนรวม

น.ส. พัชรภามา มหัทธอนกุล	(ตั้งแต่ 17 พ.ค. 2567)
นาย สมสิทธิ์ ศักดิ์กำจร	(ตั้งแต่ 17 พ.ค. 2567)
นาย วีรชัย จันเป็ง	(ตั้งแต่ 17 พ.ค. 2567)
นาย ศตวรรษ ทัน	(ตั้งแต่ 17 พ.ค. 2567)
น.ส. เซาวณี แก้วมณีเยี่ยม	(ตั้งแต่ 17 พ.ค. 2567)
น.ส. นันทรา ลายจุด	(ตั้งแต่ 17 พ.ค. 2567)
นาย ธีระศันส์ ทุติยะโพธิ์	(ตั้งแต่ 17 พ.ค. 2567)

ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือบริหารความเสี่ยง
ด้านสภาพคล่องได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



www.eastspring.co.th

คำอธิบาย

Maximum Drawdown เปรอ์เซ็นต์ผลขาดทุนสูงสุดของกองทุนรวมในระยะเวลา 5 ปีย้อนหลัง (หรือตั้งแต่จัดตั้งกองทุนกรณีที่ยังไม่ครบ 5 ปี) โดยวัดจากระดับ NAV ต่อหน่วยที่จุดสูงสุดไปจนถึงจุดต่ำสุดในช่วงที่ NAV ต่อหน่วยปรับตัวลดลง ค่า Maximum Drawdown เป็นข้อมูลที่จะช่วยให้ทราบถึงความเสี่ยงที่อาจจะขาดทุนจากการลงทุนในกองทุนรวม

Recovering Period ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาตั้งแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลาสั้นเท่าใด

FX Hedging เปรอ์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตกองทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลาหนึ่ง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อหลักทรัพย์กับผลรวมของมูลค่าการขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 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 แสดงว่า หลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนมากกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด

Tracking Error อัตราผลตอบแทนของกองทุนมีประสิทธิภาพในการเลียนแบบดัชนีชี้วัด โดยหาก tracking error ต่ำ หมายถึงกองทุนรวมมีประสิทธิภาพในการสร้างผลตอบแทนให้ใกล้เคียงกับดัชนีชี้วัด กองทุนรวมที่มีค่า tracking error สูง จะมีอัตราผลตอบแทนโดยเฉลี่ยห่างจากดัชนีชี้วัดมากขึ้น

Yield to Maturity อัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในตราสารหนี้โดยถือจนครบกำหนดอายุ ซึ่งคำนวณจากดอกเบี้ยที่จะได้รับในอนาคตตลอดอายุตราสารและเงินต้นที่จะได้รับคืน นำมาคิดลดเป็นมูลค่าปัจจุบัน โดยใช้วัดอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมตราสารหนี้ คำนวณจากค่าเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักของ Yield to Maturity ของตราสารหนี้แต่ละตัวที่กองทุนมีการลงทุน และเนื่องจาก Yield to Maturity มีหน่วยมาตรฐานเป็นเปอร์เซ็นต์ต่อปี จึงสามารถนำไปใช้เปรียบเทียบอัตราผลตอบแทนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีนโยบายถือครองตราสารหนี้จนครบกำหนดอายุและมีลักษณะการลงทุนที่ใกล้เคียงกันได้



www.eastspring.co.th

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน อีสท์สปริง (ประเทศไทย) จำกัด
ชั้น 9 อาคาร มิตรทาวน์ ออฟฟิศ ทาวเวอร์ 944 ถนนพระราม 4
แขวงวังใหม่ เขตปทุมวัน กรุงเทพมหานคร 10330

| ศูนย์ที่ปรึกษาการลงทุน 1725 | ผู้สนับสนุนการขายและรับซื้อคืนหน่วยลงทุน ที่ได้รับการแต่งตั้ง

นโยบายการลงทุนเพิ่มเติม

1.1. วัตถุประสงค์การลงทุนที่เกี่ยวข้องกับความยั่งยืน

กองทุนมีนโยบายลงทุนในหุ้นที่มีความโดดเด่นในการบริหารจัดการด้านสิ่งแวดล้อม สังคม และธรรมาภิบาล (Environmental, Social and Governance: ESG) เพื่อสร้างผลตอบแทนที่ยั่งยืนในระยะยาวควบคู่ไปกับการช่วยสร้างผลกระทบเชิงบวกและลดผลกระทบเชิงลบต่อสังคมและสิ่งแวดล้อม

1.2. เป้าหมายที่กองทุนต้องการบรรลุ

เพื่อสร้างผลตอบแทนจากการลงทุนในบริษัทที่ได้รับการประเมินว่าการประกอบกิจการมีความยั่งยืนในด้าน ESG ให้กับผู้ถือหน่วยลงทุน รวมถึงเป็นแรงขับเคลื่อนให้กิจกรรมที่มุ่งเน้นการดำเนินงานที่คำนึงถึงปัจจัยด้าน ESG มากขึ้น ส่งเสริมให้เกิดระบบนิเวศที่ยั่งยืนต่อระบบเศรษฐกิจไทย และเป็นกลไกสนับสนุนให้บริษัทจดทะเบียนฯ สามารถบรรลุเป้าหมายการพัฒนาที่ยั่งยืนในระดับสากล

1.3. กรอบการลงทุน (Investment Universe)

กรอบนโยบายการลงทุนประกอบด้วยหลักทรัพย์ที่อยู่ในองค์ประกอบของดัชนีผลตอบแทนรวม SETESG Index (SETESG TRI) เป็นหลัก เนื่องจากกองทุนจะใช้กลยุทธ์การบริหารกองทุนเชิงรับ (Passive management strategy) เพื่อสร้างผลตอบแทนจากการลงทุนให้ใกล้เคียงกับผลตอบแทนของดัชนีผลตอบแทนรวม SETESG Index (SETESG TRI) โดยหลักทรัพย์ที่อยู่ในองค์ประกอบของดัชนีผลตอบแทนรวม SETESG Index (SETESG TRI) มีการกระจายการลงทุนในหลากหลายอุตสาหกรรมที่ผ่านการประเมินคุณสมบัติด้าน ESG ตามที่ตลาดหลักทรัพย์ฯ กำหนด

1.4 การอ้างอิงดัชนีชี้วัดที่เกี่ยวกับความยั่งยืน (Investment Benchmark)

ตัวชี้วัดของกองทุนนี้ ได้แก่ ดัชนีผลตอบแทนรวม SETESG Index (SETESG TRI) ในสัดส่วน 100%

ทั้งนี้ ดัชนีผลตอบแทนรวม SETESG Index (SETESG TRI) ประกอบด้วยบริษัทจดทะเบียนที่ได้รับการประเมิน SET ESG Ratings ตามหลักเกณฑ์ที่จัดทำโดยตลาดหลักทรัพย์ฯ ซึ่งประเมิน SET ESG Ratings จากบริษัทจดทะเบียนที่สมัครใจเข้าร่วมตอบแบบประเมินความยั่งยืน โดยจะครอบคลุมคำถามในมิติด้านสิ่งแวดล้อม สังคม และธรรมาภิบาล (Environmental, Social and Governance: ESG) ทั้งนี้ ตลาดหลักทรัพย์ฯ จะมีการทบทวนแบบประเมินอย่างต่อเนื่องให้สอดคล้องกับบริบทและแนวโน้มด้านความยั่งยืน (Sustainability Trends) ที่มีการเปลี่ยนแปลงทั้งในระดับสากลและระดับประเทศ โดยบริษัทจดทะเบียนที่อยู่ในดัชนีผลตอบแทนรวม SETESG Index (SETESG TRI) จะมีผลประเมินหุ้นยั่งยืน SET ESG Ratings และคุณสมบัติตามเกณฑ์ที่ตลาดหลักทรัพย์ฯ กำหนด

แนวทางการคัดเลือกหุ้นเพื่อเป็นองค์ประกอบของดัชนี

- เป็นบริษัทที่มีผลประเมินหุ้นยั่งยืน SET ESG Ratings ปีล่าสุดที่มีการซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ฯ ไม่น้อยกว่า 6 เดือน
- บริษัทที่ได้รับการประกาศผลประเมินหุ้นยั่งยืน SET ESG Ratings จะได้รับผลประเมินระดับ BBB ขึ้นไป หรือตามกระบวนการคัดเลือกที่ตลาดทุนประกาศกำหนด
- เป็นหลักทรัพย์ที่มีมูลค่าหลักทรัพย์ตามราคาตลาด (Market Capitalization) ไม่น้อยกว่า 5,000 ล้านบาท
- มีสัดส่วนผู้ถือหลักทรัพย์รายย่อย (Free float) ไม่น้อยกว่า 20% ของทุนชำระแล้ว
- จำนวนหุ้นซื้อขายไม่น้อยกว่า 0.5% ของจำนวนหุ้นจดทะเบียนของบริษัท เป็นเวลาไม่ต่ำกว่า 9 ใน 12 เดือน
- ไม่จำกัดจำนวนหลักทรัพย์ในดัชนี
- รอบในการพิจารณาปรับรายชื่อหลักทรัพย์ที่เป็นองค์ประกอบของดัชนี จะดำเนินการทุก 6 เดือน (เดือนมิถุนายนและเดือนธันวาคม)
- ผู้ลงทุนสามารถศึกษาวิธีการจัดทำดัชนี (Index Methodologies) ได้ที่

<https://www.set.or.th/th/market/index/setesg/profile> แหล่งข้อมูล: www.set.or.th