

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน อีเอสทีเอสบริง

(ประเทศไทย) จำกัด



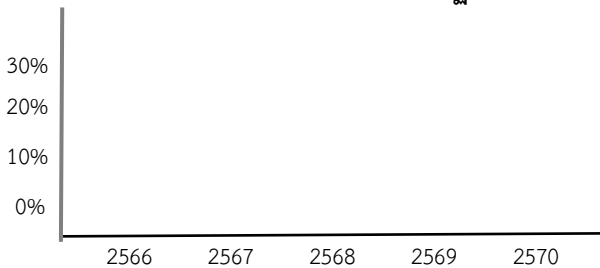
**ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม**

- กองทุนรวมตราสารทุน / กองทุนรวมดัชนี
- กองทุนรวมไทยเพื่อความยั่งยืน / กองทุนรวมเพื่อความยั่งยืน (SRI Fund)
- กลุ่ม Equity Large Cap

**นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน**

- กองทุนมีนโยบายที่จะเน้นลงทุนในหุ้นที่เป็นองค์ประกอบของดัชนีผลตอบแทนรวม SETESG Index (SETESG TRI) เพื่อสร้างผลตอบแทนให้ใกล้เคียงกับดัชนีดังกล่าว โดยจะลงทุนโดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินของกองทุน
  - ทั้งนี้ กองทุนจะใช้กลยุทธ์การบริหารกองทุนเชิงรับ (Passive management strategy) โดยจะเลือกลงทุนเฉพาะในหุ้นที่เป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (“SET”) บนกระดานหลัก หรือกระดานเอ็มเอไอ (mai) ที่ได้รับการคัดเลือกจาก SET หรือองค์กรหรือสถาบันอื่นที่ สำนักงาน ก.ล.ต. ยอมรับว่ามีความโดดเด่นด้านความยั่งยืน (Environmental Social and Governance: ESG) ในสัดส่วนที่เท่าหรือใกล้เคียงกับน้ำหนักที่เป็นส่วนประกอบของดัชนีดังกล่าว โดยจะพยายามดำรงค่าความผันผวนของส่วนต่างของผลตอบแทนเฉลี่ยของกองทุนรวมและผลตอบแทนของดัชนีชี้วัด (tracking error : “TE” ไม่เกิน 1.00% ต่อปี)
  - กองทุนจะไม่ลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) และกองทุนจะไม่ลงทุนในตราสารที่มีสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแฝง (Structured Note) รวมถึงตราสารหนี้ที่ไม่ได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือที่ตัวตราสารและที่ผู้ออกตราสาร (Unrated Securities) และตราสารแห่งทุนของบริษัทที่ไม่ได้จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ (Unlisted Securities)
  - กลยุทธ์การลงทุน กองทุนมุ่งหวังให้ผลประกอบการเคลื่อนไหวตามดัชนีชี้วัด (passive management / index tracking)
- หมายเหตุ : รายละเอียดเกี่ยวกับ SRI Fund อยู่ที่เอกสารฉบับนี้

**ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (%ต่อปี)**



**ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด (%ต่อปี)**

	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี
ES-SETESG-ThaiESG-D	N/A	N/A	N/A	N/A
ดัชนีชี้วัด (THB)	N/A	N/A	N/A	N/A
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	N/A	N/A	N/A	N/A
ความผันผวนกองทุน	N/A	N/A	N/A	N/A
ความผันผวนดัชนีชี้วัด (THB)	N/A	N/A	N/A	N/A

	3 ปี	5 ปี	10 ปี	ตั้งแต่จัดตั้ง
ES-SETESG-ThaiESG-D	N/A	N/A	N/A	N/A
ดัชนีชี้วัด (THB)	N/A	N/A	N/A	N/A
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	N/A	N/A	N/A	N/A
ความผันผวนกองทุน	N/A	N/A	N/A	N/A
ความผันผวนดัชนีชี้วัด (THB)	N/A	N/A	N/A	N/A

ระดับความเสี่ยง									
ต่ำ	1	2	3	4	5	6	7	8	สูง
คำอธิบาย									
ลงทุนในตราสารทุนเป็นหลัก โดยเฉลี่ยในรอบปีไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV									

ข้อมูลกองทุนรวม	
วันจดทะเบียนกองทุน	-
วันเริ่มต้น class	- 20 ธันวาคม 2566
นโยบายการจ่ายเงินปันผล	จ่าย
อายุกองทุน	ไม่กำหนด
ผู้ถือหุ้นรายลงทุนจะได้รับสิทธิประโยชน์ทางภาษี เฉพาะการลงทุนก่อนปี พ.ศ. 2576 เท่านั้น หรือที่จะมีการเปลี่ยนแปลงในอนาคต	

**ผู้จัดการกองทุน :**

1. คุณพัชรภา มัทธกุล (ตั้งแต่วันจดทะเบียนกองทุน)
2. คุณสมิทธิ์ ศักดิ์กำจร (ตั้งแต่วันจดทะเบียนกองทุน)

**ดัชนีชี้วัด :** ดัชนีผลตอบแทนรวม SETESG Index (SETESGTRI Index) ในสัดส่วน 100%

**คำเตือน :**

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวม มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต: มีบริษัทแม่ดูแลให้ทำตามกฎหมาย

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



www.eastspring.co.th

ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเรื่องเครื่องมือบริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่องได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

การซื้อขายหน่วยลงทุน ช่วง IPO	การขายคืนหน่วยลงทุน
วันทำการซื้อช่วง IPO : วันที่ 8-18 ธันวาคม 2566	วันทำการขายคืน :
เสนอขายหลัง IPO วันที่ 21 ธันวาคม 2566 เป็นต้นไป	กรณีรับซื้อคืนแบบปกติ : ทุกวันทำการ
เวลาทำการ : 08:30 น.-15:30 น. การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ : ไม่กำหนด การซื้อครั้งถัดไปขั้นต่ำ : ไม่กำหนด	เวลาทำการ : 08:30 น.-15:30 น. การขายคืนขั้นต่ำ : 1 บาท ยอดคงเหลือขั้นต่ำ : ไม่กำหนด
	ระยะเวลาได้รับเงินค่าขายคืน : T+2

หมายเหตุ ภายใน 5 วันทำการนับแต่วันรับซื้อคืนหน่วยลงทุน (ในภาวะปกติ บลจ.อีสท์สปริงสามารถชำระเงินค่าขายคืนหน่วยลงทุนได้ภายใน 2 วันทำการนับแต่วันรับซื้อคืนหน่วยลงทุน)

### ช่องทางซื้อ

- ซื้อผ่านบริษัทจัดการหรือผู้สนับสนุนการขายหรือรับซื้อคืน
- หักเงินค่าซื้อหน่วยลงทุนผ่านบริการธุรกรรมทางอิเล็กทรอนิกส์ผ่านบัญชี ดังนี้  
ช.ทหารไทยธนชาติ ช.ไทยพาณิชย์ ช.กรุงศรีอยุธยา ช.กรุงเทพ ช.กรุงไทย ช.กสิกรไทย ช.ยูโอบี  
ช.แลนด์แอนด์ เฮาส์ ช.เกียรตินาคินภัทร ช.ซีไอเอ็มบีไทย  
รับชำระเงินค่าซื้อหน่วยลงทุนด้วยเช็ค หรือตราพด ได้ถึงวันที่ 18 ธันวาคม 2566

### 1.3 รายชื่อกองทุนต้นทางที่สามารถสับเปลี่ยนเข้ากองทุนนี้ได้ถึงวันที่ 18 ธันวาคม 2566

ทหารไทยธนชาติ	ทหารไทยธนรัฐ	ชออร์ทเทอม อินคัม พลัส
ธนาชาติบริหารเงิน	ธนาชาติธีรสมบัติ	ทีเอ็มบี ธนาชาติ อีสท์สปริง อินคัม พลัส

### ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	1.6050	0.5000
รวมค่าใช้จ่าย	2.4075	0.6693

หมายเหตุ: บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ

### ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การขาย / การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า	1.50	ปัจจุบันไม่เรียกเก็บ
การรับซื้อคืน / การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก	ไม่มี	ไม่มี
การโอนหน่วย	5 บาทต่อ 1,000 หน่วย	5 บาทต่อ 1,000 หน่วย

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

### สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุนของ

ชื่อประเภททรัพย์สิน	% NAV
xx	xx
xx	xx
xx	xx
xx	xx

### ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรกของกองทุน

ชื่อหลักทรัพย์	% NAV
xx	xx
xx	xx
xx	xx
xx	xx
xx	xx

### ข้อมูลเชิงสถิติ

Maximum Drawdown	-
Recovering Period	-
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน	-
Sharpe Ratio	-
Alpha	-
Beta	-
Tracking error	-

### การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม/ทรัพย์สินของ

#### กองทุน

Sector / Assets	% NAV
xx	xx
xx	xx
xx	xx
xx	xx
xx	xx

## นโยบายการลงทุนเพิ่มเติม

### 1.1. วัตถุประสงค์การลงทุนที่เกี่ยวข้องกับความยั่งยืน

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

### 1.2. เป้าหมายที่กองทุนต้องการบรรลุ

เพื่อสร้างผลตอบแทนจากการลงทุนในบริษัทที่ได้รับการประเมินว่าการประกอบกิจการมีความยั่งยืนในด้าน ESG ให้กับผู้ถือหน่วยลงทุน รวมถึงเป็นแรงขับเคลื่อนให้กิจกรรมที่มุ่งเน้นการดำเนินงานที่คำนึงถึงปัจจัยด้าน ESG มากขึ้น ส่งเสริมให้เกิดระบบนิเวศที่ยั่งยืนต่อระบบเศรษฐกิจไทย และเป็นกลไกสนับสนุนให้บริษัทจดทะเบียนสามารถบรรลุเป้าหมายการพัฒนาที่ยั่งยืนในระดับสากล

### 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) มีการกระจายการลงทุนในหลากหลายอุตสาหกรรม ที่ผ่านการประเมินคุณสมบัติด้าน ESG ตามที่ตลาดหลักทรัพย์ฯ กำหนด

### 1.4 การอ้างอิงดัชนีชี้วัดที่เกี่ยวข้องกับความยั่งยืน (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](http://www.set.or.th)

## คำอธิบาย

**Maximum Drawdown** เปรียบเทียบผลขาดทุนสูงสุดของกองทุนรวมในระยะเวลา 5 ปีย้อนหลัง (หรือตั้งแต่จัดตั้งกองทุนกรณีที่ยังไม่ครบ 5 ปี) โดยวัดจากระดับ NAV ต่อหน่วยที่จุดสูงสุดไปจนถึงจุดต่ำสุดในช่วงที่ NAV ต่อหน่วยปรับตัวลดลง ค่า Maximum Drawdown เป็นข้อมูลที่จะช่วยให้ทราบถึงความเสี่ยงที่อาจขาดทุนจากการลงทุนในกองทุนรวม

**Recovering Period** ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาตั้งแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลาสั้นเท่าใด

**FX Hedging** เปรียบเทียบของกองทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

**อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน** ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตกองทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลาหนึ่ง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์กับผลรวมของมูลค่าการขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 1 ปีหารด้วยมูลค่า NAV ของกองทุนรวมเฉลี่ยในรอบระยะเวลาเดียวกัน กองทุนรวมที่มีค่า portfolio turnover สูง บ่งชี้ถึงการซื้อขายหลักทรัพย์บ่อยครั้งของผู้จัดการกองทุนและทำให้มีต้นทุนการซื้อขายหลักทรัพย์ที่สูง จึงต้องพิจารณาเปรียบเทียบกับผลการดำเนินงานของกองทุนรวมเพื่อประเมิน ความคุ้มค่าของการซื้อขายหลักทรัพย์ดังกล่าว

**Sharpe Ratio** อัตราส่วนระหว่างผลตอบแทนส่วนเพิ่มของกองทุนรวมเปรียบเทียบกับความเสี่ยงจากการลงทุน โดยคำนวณจากผลต่างระหว่างอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมกับ อัตราผลตอบแทนที่ปราศจากความเสี่ยง (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** ระดับและทิศทางของการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุน 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 โดยใช้วิธีอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมตราสารหนี้ คำนวณจากค่าเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักของ Yield to Maturity ของตราสารหนี้แต่ละตัวที่กองทุนมี การลงทุน และเนื่องจาก Yield to Maturity มีหน่วยมาตรฐานเป็นเปอร์เซ็นต์ต่อปี จึงสามารถนำไปใช้เปรียบเทียบอัตราผลตอบแทนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีนโยบายถือครองตราสารหนี้จนครบกำหนดอายุและมีลักษณะการลงทุนที่ใกล้เคียงกันได้



[www.eastspring.co.th](http://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

Expert in Asia. Invest in Your Future.