

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน
อีส์ทสปริง (ประเทศไทย) จำกัด

ข้อมูล ณ วันที่ 10 กรกฎาคม 2569

ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมตราสารทุน (Equity Fund)
- กองทุนรวมฟีดเดอร์ (Feeder Fund)
- กลุ่ม Global Equity

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- กองทุนจะเน้นลงทุนใน Man Systematic Equity Alternative (กองทุนหลัก) ในหน่วยลงทุนชนิด Class IN USD ที่จดทะเบียนซื้อขายในประเทศไอร์แลนด์ (Ireland) โดยอยู่ภายใต้การกำกับดูแลของ Central Bank of Ireland ซึ่งเป็นสมาชิกของ IOSCO ดำเนินงานตามระเบียบของ UCITS ในอัตราส่วนโดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน กองทุนหลักดังกล่าวบริหารจัดการโดย Man Asset Management (Ireland) Limited และลงทุนในรูปสกุลเงินดอลลาร์สหรัฐ กองทุนหลักมีวัตถุประสงค์เพื่อมุ่งสร้างผลตอบแทนที่เป็นบวก (Absolute Return) ให้กับผู้ลงทุนผ่านกลยุทธ์การลงทุนแบบ Long / Short Equity Strategy (โดยกองทุนจะเข้าลงทุนสถานะซื้อ (Long) ในหลักทรัพย์ที่แบบจำลองเชิงปริมาณระบุว่ามีแนวโน้มให้ผลตอบแทนดีกว่ากลุ่มเปรียบเทียบกับและเข้าลงทุนสถานะขาย (Short) ในหลักทรัพย์ที่มีแนวโน้มให้ผลตอบแทนด้อยกว่ากลุ่มเปรียบเทียบกับโดยกองทุนหลักเน้นลงทุนในหลักทรัพย์ประเภทตราสารทุนของผู้ประกอบการทั่วโลก รวมถึงอาจลงทุนในตลาดเกิดใหม่ (Emerging Markets) ได้ไม่เกินร้อยละ 50 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุนหลัก และมีการลงทุนใน derivative เพื่อเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน (EPM) กลยุทธ์การลงทุน : กองทุนหลักจะลงทุนทั้งโดยตรงหรือโดยอ้อม (สำหรับการลงทุนโดยอ้อมดังกล่าวจะเป็นการลงทุนผ่านตราสารอนุพันธ์ (FDIs)) ในตราสารทุนทั่วโลก ซึ่งคัดเลือกโดยใช้แบบจำลองเชิงปริมาณในการคัดเลือกหลักทรัพย์ กองทุนหลักมุ่งใช้ กลยุทธ์การลงทุนแบบ Long/Short โดยมีเจตนาในการลงทุนผ่านตราสารอนุพันธ์ (FDIs) เพื่อสร้างสถานะการลงทุนทั้งสถานะซื้อ (Long) และสถานะขายเชิงสังเคราะห์ (Synthetic Short) สามารถดูรายละเอียดกลยุทธ์การลงทุนเพิ่มเติมตามเอกสารแนบท้าย กองทุนจะไม่ลงทุนใน derivative เพื่อเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน (EPM) และจะไม่ลงทุนในตราสารที่มีสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแบบ (Structured Note)
- กลยุทธ์การลงทุน : มุ่งหวังให้ผลประโยชน์จากการเคลื่อนไหวตามกองทุนหลัก โดยกองทุนหลักมุ่งหวังให้ผลประโยชน์จากการเคลื่อนไหวสูงกว่าดัชนีชี้วัด

ระดับความเสี่ยง									
ต่ำ	1	2	3	4	5	6	7	8	สูง
คำอธิบาย									
ลงทุนในตราสารทุนเป็นหลักโดยเฉลี่ยในรอบปีไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV									
ข้อมูลกองทุนรวม									
วันจดทะเบียนกองทุน						30 ก.ค. 2569			
วันเริ่มต้น class						-			
นโยบายการจ่ายเงินปันผล						ไม่มีนโยบายจ่ายเงินปันผล			
การรับซื้อคืนหน่วยลงทุนอัตโนมัติ						-			
อายุกองทุน						ไม่กำหนด			
การป้องกันความเสี่ยง FX						ตามดุลพินิจของผู้จัดการกองทุน			
การเรียกเก็บค่าธรรมเนียมตามผลการดำเนินงาน						ไม่มี			

ผู้จัดการกองทุนรวม

น.ส. ธีรนาถ ธรรมภูมิวัฒนา (ตั้งแต่ 30 ก.ค. 2569)

ดัชนีชี้วัด :

1. ผลการดำเนินงานของกองทุนรวมหลัก สัดส่วน 100 %

หมายเหตุ : ปรับด้วยต้นทุนการป้องกันความเสี่ยงด้านอัตราแลกเปลี่ยนเพื่อเทียบเท่ากับค่าสกุลเงินบาท ณ วันที่คำนวณผลตอบแทน ประมาณ 95% และปรับด้วยอัตราแลกเปลี่ยนเพื่อเทียบเท่ากับค่าสกุลเงินบาท ณ วันที่คำนวณผลตอบแทนประมาณ 5%

สำหรับผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปกติ ผลการดำเนินงานน้อยกว่า 1 ปี คำนวณตามระยะเวลาจริง

คำเตือน :

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
 - ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวม มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต
- การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต: มีบริษัทแม่ดูแลให้ทำตามกฎหมาย

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือ
บริหารความเสี่ยงด้านสภาพ
คล่องได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

www.eastspring.co.th

การซื้อขายหน่วยลงทุน

วันทำการซื้อ : เสนอขายครั้งแรกระหว่างวันที่ 20-24 กรกฎาคม 2569
เสนอขายครั้งต่อไป 31 กรกฎาคม 2569

เวลาทำการ : 08:30 น. -15:30 น.

การซื้อขายครั้งแรกขั้นต่ำ : 1 บาท

การซื้อขายครั้งถัดไปขั้นต่ำ : 1 บาท

การขายคืนหน่วยลงทุน

วันทำการขายคืน : ทุกวันทำการ
เวลาทำการ : 08:30 น. - 15:30 น.
การขายคืนขั้นต่ำ : 1 บาท
ยอดคงเหลือขั้นต่ำ : ไม่กำหนด
ระยะเวลาได้รับเงินค่าขายคืน : T+4

Remark: ตามโครงการระบุไว้ว่า จะชำระเงินค่าขายคืนหน่วยลงทุนภายใน 7 วันทำการซื้อขายนับแต่วันทำการซื้อขาย ปัจจุบันและในภาวะปกติจะชำระเงินค่าขายคืนหน่วยลงทุนภายใน 4 วันทำการซื้อขายนับแต่วันทำการซื้อขาย ช่องทางซื้อ 1. ซื้อผ่านบริษัทจัดการหรือผู้สนับสนุนการขายหรือรับซื้อคืน 2. หักเงินค่าซื้อหน่วยลงทุนผ่านบริการธุรกรรมทางอิเล็กทรอนิกส์ผ่านบัญชี ดังนี้ ธ.ทหารไทยธนชาติ ธ.ไทยพาณิชย์ ธ.กรุงศรีอยุธยา ธ.กรุงเทพ ธ.กรุงไทย ธ.กสิกรไทย ธ.ยูโอบี ธ.แลนด์แอนด์ เฮาส์ ธ.เกียรตินาคินภัทร ธ.ซีไอเอ็มบีไทย รับชำระเงินค่าซื้อหน่วยลงทุนด้วยเช็ค หรือตราพด ได้ถึงวันที่ 24 กรกฎาคม 2569 3. รายชื่อกองทุนต้นทางที่สามารถสับเปลี่ยนเข้ากองทุนนี้ได้ถึงวันที่ 24 กรกฎาคม 2569 อีสท์สปริง ธนบดี อีสท์สปริง ธนรัฐ อีสท์สปริง ซอร์ทเทอม อินคัม พลัส อีสท์สปริง บริหารเงิน อีสท์สปริง อีรสมบัติ อีสท์สปริง Income Plus

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)

ค่าธรรมเนียมต่อไปนี้จะส่งผลกระทบต่อผู้ลงทุน เนื่องจากจะทำให้ผลตอบแทนจากการลงทุนลดลง ดังนั้นผู้ลงทุนควรตรวจสอบทุกครั้งก่อนตัดสินใจลงทุน

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	2.1400	1.3375
ค่าตอบแทนแก่ผู้สนับสนุนการขายหรือรับซื้อคืนหน่วยลงทุนของกองทุนรวม : มี		
รวมค่าใช้จ่าย*	3.7450	1.5206

หมายเหตุ : 1.บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ 2.เนื่องจากกองทุนนี้เพิ่งจะเริ่มเปิดเสนอขาย IPO เมื่อวันที่ 20 กรกฎาคม 2569 จึงยังไม่มีระบุค่าใช้จ่ายอื่นๆ ที่เรียกเก็บจริง

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าหน่วยลงทุน)

ผู้ลงทุนจะถูกเรียกเก็บค่าธรรมเนียมต่อไปนี้โดยตรงทุกครั้งเมื่อทำการซื้อขายหรือสับเปลี่ยนหน่วยลงทุน

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การขาย	1.50	1.35
การรับซื้อคืน	ไม่มี	ไม่มี
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า	1.50	1.35
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก	ไม่มี	ไม่มี
การโอนหน่วย	5 บาท ต่อ 1,000 หน่วย	5 บาท ต่อ 1,000 หน่วย

หมายเหตุ : 1.ส่วนต่างมูลค่าหน่วยลงทุน (Spread) ที่เรียกเก็บจากผู้ทำรายการนี้ เพื่อนำไปชำระเป็นค่าใช้จ่ายในการซื้อขายหลักทรัพย์ของกองทุน ไม่เกินร้อยละ 0.25 ของมูลค่าหน่วยลงทุน (ปัจจุบัน ไม่เรียกเก็บ) 2.ค่าธรรมเนียมการขายและสับเปลี่ยนเข้าเฉพาะช่วง IPO เท่านั้น เรียกเก็บ 1.35% หลังจาก IPO จะเรียกเก็บ 1.50%

ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก

ชื่อหลักทรัพย์	% NAV
หน่วยลงทุนของ Man Systematic Equity Alternative	100.00

ข้อมูลกองทุนหลัก

ชื่อหลักทรัพย์	% NAV
SANOFI	2.26
CENTRICA PLC	2.25
EDP, S.A.	2.23
DSM-FIRMENICH AG	2.20
AGEAS SA/NV	2.19

การจัดสรรการลงทุนในต่างประเทศของกองทุนหลัก

ชื่อประเทศ	% NAV
สหรัฐอเมริกา	11.34
ฝรั่งเศส	3.98
ญี่ปุ่น	1.57
เยอรมนี	1.14
แคนาดา	-0.35

การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรมของกองทุนหลัก

กลุ่มอุตสาหกรรม	% NAV
Communication Services	3.54
Consumer Discretionary	1.76
Consumer Staples	0.99
Energy	-1.09
Financials	-0.61

การลงทุนในกองทุนอื่นเกินกว่า 20% (กองในประเทศ และหรือกองต่างประเทศ)

ชื่อกองทุน : Man Systematic Equity Alternative

ISIN code : IE0005COA451

Bloomberg code : MNREINU ID

คำอธิบาย

Maximum Drawdown เพอร์เซ็นต์ผลขาดทุนสูงสุดของกองทุนรวมในระยะเวลา 5 ปีย้อนหลัง (หรือตั้งแต่จัดตั้งกองทุนกรณีที่ยังไม่ครบ 5 ปี) โดยวัดจากระดับ NAV ต่อหน่วยที่จุดสูงสุดไปจนถึงจุดต่ำสุดในช่วงที่ NAV ต่อหน่วยปรับตัวลดลง ค่า Maximum Drawdown เป็นข้อมูลที่ช่วยให้ทราบถึงความเสี่ยงที่อาจจะขาดทุนจากการลงทุนในกองทุนรวม

Recovering Period ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาดังแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลานานเท่าใด

FX Hedging เพอร์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตกองทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลาหนึ่ง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์กับผลรวมของมูลค่าการขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 1 ปีหารด้วยมูลค่า NAV ของกองทุนรวมเฉลี่ยในรอบระยะเวลาเดียวกัน กองทุนรวมที่มีค่า portfolio turnover สูง บ่งชี้ถึงการซื้อขายหลักทรัพย์บ่อยครั้งของผู้จัดการกองทุนและทำให้มีต้นทุนการซื้อขายหลักทรัพย์ที่สูง จึงต้องพิจารณาเปรียบเทียบกับผลการดำเนินงานของกองทุนรวม เพื่อประเมินความคุ้มค่าของการซื้อขายหลักทรัพย์ดังกล่าว

Sharpe Ratio อัตราส่วนระหว่างผลตอบแทนส่วนเพิ่มของกองทุนรวมเปรียบเทียบกับความเสี่ยงจากการลงทุน โดยคำนวณจากผลต่างระหว่างอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมกับอัตราผลตอบแทนที่ปราศจากความเสี่ยง (risk-free rate) เปรียบเทียบกับค่าเบี่ยงเบนมาตรฐาน (standard deviation) ของกองทุนรวม ค่า Sharpe Ratio สะท้อนถึงอัตราผลตอบแทนที่กองทุนรวมควรได้รับเพิ่มขึ้นเพื่อชดเชยกับความเสี่ยงที่กองทุนรวมรับมา โดยกองทุนรวมที่มีค่า Sharpe Ratio สูงกว่าจะเป็นกองทุนที่มีประสิทธิภาพในการบริหารจัดการการลงทุนที่ดีกว่า เนื่องจากได้รับผลตอบแทนส่วนเพิ่มที่สูงกว่าภายใต้ระดับความเสี่ยงเดียวกัน

Alpha ผลตอบแทนส่วนเพิ่มของกองทุนรวมเมื่อเปรียบเทียบกับดัชนีชี้วัด (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 โดยใช้ตัวอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมตราสารหนี้ คำนวณจากค่าเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักของ Yield to Maturity ของตราสารหนี้แต่ละตัวที่กองทุนมีการลงทุน และเนื่องจาก Yield to Maturity มีหน่วยมาตรฐานเป็นเปอร์เซ็นต์ต่อปี จึงสามารถนำไปใช้เปรียบเทียบอัตราผลตอบแทนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีนโยบายถือครองตราสารหนี้จนครบกำหนดอายุและมีลักษณะการลงทุนที่ใกล้เคียงกันได้

บริษัทจัดการขอสิทธิในการเรียกเก็บค่าธรรมเนียมการขายหน่วยลงทุน และหรือการรับซื้อคืนหน่วยลงทุน และหรือสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนกับผู้ลงทุนแต่ละกลุ่มไม่เท่ากัน โดยบริษัทจัดการจะขอ ยกเว้นการเรียกเก็บค่าธรรมเนียมดังกล่าวสำหรับผู้ลงทุนประเภทสถาบันที่เปิดบัญชีซื้อขายหน่วยลงทุนกับบริษัทจัดการโดยตรง ได้แก่ ผู้ลงทุนสถาบันที่ไม่แสวงหาผลกำไร ซึ่งจัดตั้งขึ้นโดยพระราชบัญญัติ หลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ.2535 ผู้ลงทุนสถาบันที่จัดตั้งขึ้นตามพระราชบัญญัติประกันสังคม พ.ศ. 2533 ธุรกิจประกันชีวิตและประกันภัย ธนาकरเฉพาะกิจ กองทุนสำรองเลี้ยงชีพภายใต้การจัดการของ บลจ.อีสท์สปริง บัญชีหน่วยลงทุนควบคุมธรรมประกันชีวิต หรือที่เรียกว่า ธรรมธรรมประกันชีวิตควบหน่วยลงทุน (Unit-linked) ของบริษัทประกันชีวิต ที่ บลจ.อีสท์สปริง มอบหมายให้เป็น ผู้สนับสนุนการขายหรือรับซื้อคืน

กรณีปรากฏเหตุว่า บริษัทจัดการไม่สามารถนำส่งเงินให้ผู้ถือหน่วยลงทุนได้ตามช่องทางที่ผู้ถือหน่วยลงทุนแจ้งความประสงค์ไว้ บริษัทจัดการขอสงวนสิทธิที่จะดำเนินการโอนเงิน (นำส่งเงิน) ให้กับผู้ถือหน่วยลงทุนโดยช่องทางอื่นๆ เช่น การโอนเงินผ่านระบบ PromptPay (หมายเลขบัตรประชาชน) เป็นต้น หรือวิธีการอื่นใดที่บริษัทจัดการเห็นสมควร โดยยึดประโยชน์ของผู้ถือหน่วยลงทุนเป็นสำคัญ เพื่อให้ผู้ถือหน่วยลงทุนได้รับเงินคืนตามสิทธิที่ควรจะได้รับ



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

ข้อมูลกลยุทธ์การลงทุนของกองทุนหลักเพิ่มเติม

กลยุทธ์การลงทุนของกองทุนหลัก	กองทุนหลักจะลงทุนทั้งโดยตรงหรือโดยอ้อม (สำหรับการลงทุนโดยอ้อมดังกล่าวจะเป็นการลงทุนผ่านตราสารอนุพันธ์ (FDIs)) ในตราสารทุนทั่วโลก ซึ่งคัดเลือกโดยใช้แบบจำลองเชิงปริมาณในการคัดเลือกหลักทรัพย์ กองทุนหลักมุ่งใช้กลยุทธ์การลงทุนแบบ Long/Short โดยมีเจตนาลงทุนผ่านตราสารอนุพันธ์ (FDIs) เพื่อสร้างสถานะการลงทุนทั้งสถานะซื้อ (Long) และสถานะขายเชิงสังเคราะห์ (“Synthetic Short”) โดยแนวทางการลงทุนที่นำมาใช้คือ Fundamental Investment Themes ซึ่งเป็นแนวทางการลงทุนแบบกระจายความเสี่ยง โดยใช้แบบจำลองหลายประเภท ได้แก่ ด้านมูลค่า (Value) ด้านโมเมนตัม (Momentum) ด้านคุณภาพ (Quality) ข้อมูลจากนักลงทุนที่มีความรู้เชิงลึก (Informed Investor) และการคัดเลือกปัจจัยการลงทุน (Factor Selection) เพื่อผสานแนวคิดการวิเคราะห์พื้นฐาน เช่น มูลค่าและคุณภาพของกิจการ เข้ากับพฤติกรรมของผู้ลงทุนในตลาด (เช่น นักวิเคราะห์ ผู้บริหารบริษัท และนักลงทุนที่มีข้อมูลเชิงลึก) รวมถึงปัจจัยอื่นที่ไม่สัมพันธ์กันในการขับเคลื่อนผลตอบแทนของหุ้น (เช่น sentiment ของนักลงทุน และสัญญาณจาก machine learning) แบบจำลองดังกล่าวมีวัตถุประสงค์เพื่อช่วยคาดการณ์แนวโน้มการดำเนินงานของบริษัท ทิศทางและการเปลี่ยนแปลงของกำไร รวมถึง sentiment ของนักลงทุน นอกจากนี้ ยังมุ่งใช้ประโยชน์จากพฤติกรรมที่มีอคติของนักลงทุน เช่น การตอบสนองต่อข่าวสารมากเกินไปหรือน้อยเกินไป ซึ่งอาจก่อให้เกิดโอกาสในการประเมินมูลค่าที่คลาดเคลื่อน สัญญาณที่ใช้ในแบบจำลองประกอบด้วยข้อมูลทั้งจากแหล่งข้อมูลดั้งเดิม (traditional data) และข้อมูลทางเลือก (alternative data)
รายละเอียดเพิ่มเติมของการทำกลยุทธ์ Long-Short Strategy	กองทุนหลักมุ่งใช้กลยุทธ์การลงทุนแบบ Long/Short และมีเจตนาใช้ประโยชน์จากความสามารถในการลงทุนผ่านตราสารอนุพันธ์ (FDIs) เพื่อสร้างสถานะการลงทุนทั้งสถานะซื้อ (Long) และสถานะขายเชิงสังเคราะห์ (“Synthetic Short”) ผ่านการใช้เครื่องมือ เช่น สัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Forwards และ Futures) สัญญาออปชัน (Options) และสัญญาแลกเปลี่ยน (Swaps) ระดับการเปิดรับความเสี่ยงต่อการลงทุน (market exposure) ของกองทุนหลักอาจเปลี่ยนแปลงได้ตามช่วงเวลา โดยทั่วไปอาจอยู่ในช่วงประมาณร้อยละ 200–400 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุนสำหรับสถานะซื้อ (Long) และร้อยละ 200–400 สำหรับสถานะขาย (Short) ทั้งนี้ ขึ้นอยู่กับการวิเคราะห์สภาวะตลาดในขณะนั้นโดยผู้จัดการกองทุน และพิจารณาควบคู่กับวัตถุประสงค์การลงทุนของกองทุน ช่วงดังกล่าวเป็นเพียงการประมาณการเท่านั้น มิได้เป็นข้อจำกัด และในบางช่วงเวลา ระดับการเปิดรับความเสี่ยงจริงอาจอยู่นอกเหนือช่วงที่ระบุไว้ข้างต้นได้ อย่างไรก็ตาม สถานะสุทธิระหว่างสถานะซื้อ (Long) และสถานะขาย (Short) จะไม่เกินร้อยละ 25 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน นอกจากนี้ กองทุนหลักจะนำเกณฑ์การพิจารณาขเว้นการลงทุน (exclusion) ตามแนวทางของ Paris Aligned Benchmark มาใช้กับสถานะการลงทุนสถานะซื้อ (Long positions) ของกองทุนหลัก โดยเกณฑ์ดังกล่าวมุ่งขเว้นการลงทุนในหลักทรัพย์ของผู้ออกตราสารที่ไม่สอดคล้องกับเป้าหมายการลดการปล่อยก๊าซเรือนกระจก และการเปลี่ยนผ่านสู่เศรษฐกิจคาร์บอนต่ำ ทั้งนี้ เกณฑ์ดังกล่าวครอบคลุมถึงการไม่ลงทุนในธุรกิจที่เกี่ยวข้องกับอาวุธต้องห้าม รวมถึงการผลิตผลิตภัณฑ์ยาสูบ และผู้ออกตราสารที่ไม่เป็นไปตามหลักการด้านความรับผิดชอบต่อสังคมตามกรอบสากล (UNGC และ OECD) ตลอดจนบริษัทที่มีรายได้ อย่างมีนัยสำคัญจากกิจกรรมที่เกี่ยวข้องกับเชื้อเพลิงฟอสซิล หรือกิจกรรมที่มีความเข้มข้นในการปล่อยก๊าซเรือนกระจกในระดับสูง

แบบลงนามรับทราบความเสี่ยง

ข้าพเจ้าได้รับทราบและมีความเข้าใจเกี่ยวกับลักษณะนโยบายการลงทุนที่มีกลยุทธ์แบบซับซ้อน (complex strategic investment) รวมถึงความเสี่ยงและผลกระทบที่อาจเกิดขึ้นจากการลงทุนในกองทุนเปิดอีส์ทสปริง Quantitative Absolute Return Equity (ES-QUANTABS) เป็นอย่างดีแล้วว่า

1. นโยบายการลงทุน

กองทุนจะเน้นลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมต่างประเทศเพียงกองเดียว คือ Man Systematic Equity Alternative (กองทุนหลัก) ในหน่วยลงทุนชนิด Class IN USD ที่จดทะเบียนซื้อขายในประเทศไอร์แลนด์ (Ireland) โดยอยู่ภายใต้การกำกับดูแลของ Central Bank of Ireland ซึ่งเป็นสมาชิกของ IOSCO ดำเนินงานตามระเบียบของ UCITS ในอัตราส่วนโดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน กองทุนหลักดังกล่าวบริหารจัดการโดย Man Asset Management (Ireland) Limited และลงทุนในรูปแบบสกุลเงินดอลลาร์สหรัฐ

กองทุนหลักมีวัตถุประสงค์เพื่อมุ่งสร้างผลตอบแทนที่เป็นบวก (Absolute Return) ให้กับผู้ลงทุนผ่านกลยุทธ์การลงทุนแบบ Long / Short Equity Strategy (โดยกองทุนจะเข้าลงทุนสถานะซื้อ (Long) ในหลักทรัพย์ที่แบบจำลองเชิงปริมาณระบุว่ามีแนวโน้มให้ผลตอบแทนดีกว่ากลุ่มเปรียบเทียบ และเข้าลงทุนสถานะขาย (Short) ในหลักทรัพย์ที่มีแนวโน้มให้ผลตอบแทนด้อยกว่ากลุ่มเปรียบเทียบ) โดยกองทุนหลักเน้นลงทุนในหลักทรัพย์ประเภทตราสารทุนในตลาดทั่วโลก รวมถึงอาจลงทุนในตลาดเกิดใหม่ (Emerging Markets) ได้ไม่เกินร้อยละ 50 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุนหลัก

2. กลยุทธ์การลงทุนของกองทุนหลัก

กองทุนหลักจะลงทุนทั้งโดยตรงหรือโดยอ้อม (โดยการลงทุนโดยอ้อมดังกล่าวจะเป็นการลงทุนผ่านตราสารอนุพันธ์ (FDIs)) ในตราสารทุนในตลาดทั่วโลก ซึ่งคัดเลือกโดยใช้แบบจำลองเชิงปริมาณในการคัดเลือกหลักทรัพย์ กองทุนหลักมุ่งใช้กลยุทธ์การลงทุนแบบ Long/Short โดยมีเจตนาในการลงทุนผ่านตราสารอนุพันธ์ (FDIs) เพื่อสร้างสถานะการลงทุนทั้งสถานะซื้อ (Long) และสถานะขายเชิงสังเคราะห์ (“Synthetic Short”)

โดยแนวทางการลงทุนที่นำมาใช้คือ Fundamental Investment Themes ซึ่งเป็นแนวทางการลงทุนแบบกระจายความเสี่ยง โดยใช้แบบจำลองหลายประเภท ได้แก่ ด้านมูลค่า (Value) ด้านโมเมนตัม (Momentum) ด้านคุณภาพ (Quality) ข้อมูลจากนักลงทุนที่มีความรู้เชิงลึก (Informed Investor) และการคัดเลือกปัจจัยการลงทุน (Factor Selection) เพื่อผสมผสานแนวคิดการวิเคราะห์พื้นฐาน เช่น มูลค่าและคุณภาพของกิจการ เข้ากับพฤติกรรมของผู้ลงทุนในตลาด (เช่น นักวิเคราะห์ ผู้บริหารบริษัท และนักลงทุนที่มีข้อมูลเชิงลึก) รวมถึงปัจจัยอื่นที่ไม่สัมพันธ์กันในการขับเคลื่อนผลตอบแทนของหุ้น (เช่น sentiment ของนักลงทุน และสัญญาณจาก machine learning) แบบจำลองดังกล่าวมีวัตถุประสงค์เพื่อช่วยคาดการณ์แนวโน้มการดำเนินงานของบริษัท ทิศทางและการเปลี่ยนแปลงของกำไร รวมถึง sentiment ของนักลงทุน นอกจากนี้ ยังมุ่งใช้ประโยชน์จากพฤติกรรมที่มีอคติของนักลงทุน เช่น การตอบสนองต่อข่าวสารมากเกินไปหรือน้อยเกินไป ซึ่งอาจก่อให้เกิดโอกาสในการประเมินมูลค่าที่คลาดเคลื่อน สัญญาณที่ใช้ในแบบจำลองประกอบด้วยข้อมูลทั้งจากแหล่งข้อมูลดั้งเดิม (traditional data) และข้อมูลทางเลือก (alternative data)

รายละเอียดเพิ่มเติมของการทำกลยุทธ์ Long-Short Strategy

กองทุนหลักมุ่งใช้กลยุทธ์การลงทุนแบบ Long/Short และมีเจตนาใช้ประโยชน์จากความสามารถในการลงทุนผ่านตราสารอนุพันธ์ (FDIs) เพื่อสร้างสถานะการลงทุนทั้งสถานะซื้อ (Long) และสถานะขายเชิงสังเคราะห์ (“Synthetic Short”) ผ่านการใช้เครื่องมือ เช่น สัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Forwards และ Futures) สัญญาออปชัน (Options) และสัญญาแลกเปลี่ยน (Swaps) ระดับการเปิดรับความเสี่ยงต่อการลงทุน (market exposure) ของกองทุนหลักอาจเปลี่ยนแปลงได้ตามช่วงเวลา โดยทั่วไปอาจอยู่ในช่วงประมาณร้อยละ 200–400 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุนสำหรับสถานะซื้อ (Long) และร้อยละ 200–400 สำหรับสถานะขาย (Short) ทั้งนี้ ขึ้นอยู่กับการวิเคราะห์สถานะตลาดในขณะนั้นโดยผู้จัดการกองทุน และพิจารณาควบคู่กับวัตถุประสงค์การลงทุนของกองทุน ช่วงดังกล่าวเป็นเพียงการประมาณการเท่านั้น มิได้เป็นข้อจำกัด และในบางช่วงเวลา ระดับการเปิดรับความเสี่ยงจริงอาจอยู่นอกเหนือช่วงที่ระบุไว้ข้างต้นได้ อย่างไรก็ตาม สถานะสุทธิระหว่างสถานะซื้อ (Long) และสถานะขาย (Short) จะไม่เกินร้อยละ 25 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน นอกจากนี้ กองทุนหลักจะนำเกณฑ์การพิจารณาขเว้นการลงทุน (exclusion) ตามแนวทางของ Paris Aligned Benchmark มาใช้กับสถานะการลงทุนสถานะซื้อ (Long positions) ของกองทุนหลัก โดยเกณฑ์ดังกล่าวมุ่งขเว้นการลงทุนในหลักทรัพย์ของผู้ออกตราสารที่ไม่สอดคล้องกับเป้าหมายการลดการปล่อยก๊าซเรือนกระจกและการเปลี่ยนผ่านสู่เศรษฐกิจคาร์บอนต่ำ

ทั้งนี้ เกณฑ์ดังกล่าวครอบคลุมถึงการไม่ลงทุนในธุรกิจที่เกี่ยวข้องกับอาวุธต้องห้าม รวมถึงการผลิตผลิตภัณฑ์ยาสูบ และผู้ออกตราสารที่ไม่เป็นไปตามหลักการด้านความรับผิดชอบต่อสังคมตามกรอบสากล (UNGC และ OECD) ตลอดจนบริษัทที่มีรายได้ อย่างมีนัยสำคัญจากกิจกรรมที่เกี่ยวข้องกับเชื้อเพลิงฟอสซิล หรือกิจกรรมที่มีความเข้มข้นในการปล่อยก๊าซเรือนกระจกในระดับสูง

ดังนั้นผู้ลงทุนมีความเสี่ยงที่จะสูญเสียเงินต้นทั้งหมดและ/หรือได้รับเงินต้นคืนไม่เต็มจำนวนและ/หรือผลตอบแทนไม่เป็นไปตามที่คาดไว้ อันเกิดจากสาเหตุเช่นมูลค่าของสินทรัพย์ที่ลงทุนเคลื่อนไหวไปในทิศทางตรงข้ามกับที่คาดการณ์เป็นต้น กองทุนนี้จึงเหมาะกับผู้ลงทุนที่เข้าใจกลยุทธดังกล่าวและมีฐานะการเงินที่สามารถรับความเสี่ยงได้

ข้าพเจ้าชื่อ..... เลขประจำตัวประชาชน / ทะเบียนนิติบุคคลเลขที่
ขอยืนยันต่อบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน อีสท์สปริง (ประเทศไทย) จำกัด (“บริษัทจัดการ”) ว่าข้าพเจ้าได้รับและได้ศึกษาหนังสือชี้ชวน ข้อมูลของกองทุน และเอกสารอื่นใดที่ใช้ในการเสนอขายหน่วยลงทุนที่บริษัทจัดการได้จัดทำขึ้น รวมทั้งข้าพเจ้าได้รับทราบค่าเตือนและการเปิดเผยในเรื่องต่างๆ (เช่น ความเสี่ยงที่สำคัญของกองทุน เป็นต้น) เป็นอย่างดีแล้ว

สำหรับเจ้าหน้าที่

ผู้ดูแลบัญชีลูกค้าได้ตรวจสอบความถูกต้องแล้ว

ชื่อตัวแทน

สาขา รหัสตัวแทน

ลงชื่อผู้ถือหน่วยลงทุน
()

Date:.....

การลงทุนในหน่วยลงทุนกองทุนที่มีความเสี่ยงสูงหรือมีความซับซ้อน มีความแตกต่างจากการลงทุนในกองทุนรวมทั่วไป แม้ว่าจะเคยมีประสบการณ์ในการลงทุนในหน่วยลงทุนอื่นมาก่อน ลูกค้าควรทำความเข้าใจถึงลักษณะความเสี่ยงและ เงื่อนไขกองทุน และควรขอคำแนะนำเพิ่มเติมจากผู้แนะนำการลงทุน ก่อนตัดสินใจลงทุน

แบบประเมินความรู้ความสามารถสำหรับการลงทุนในผลิตภัณฑ์ที่มีความเสี่ยงสูงหรือมีความซับซ้อน
(Knowledge Assessment for Complex Fund)

ข้าพเจ้า (“ผู้ลงทุน”) บัตรประจำตัวประชาชนเลขที่

เลขที่ผู้ถือหน่วยลงทุน
ขอความกรุณาให้ผู้ลงทุนตอบคำถามในแบบประเมินความรู้ความสามารถสำหรับการลงทุนในผลิตภัณฑ์ที่มีความเสี่ยงสูงหรือมีความซับซ้อนให้ครบทุกข้อ และตรงตามความเป็นจริง โดยเลือกตอบข้อละ 1 คำตอบ

คำถามเพื่อประเมินความรู้ความสามารถ

- สาขาวิชาที่ท่านสำเร็จการศึกษา/ใบประกาศวิชาชีพที่ท่านได้รับ เกี่ยวข้องกับการเงินการลงทุนหรือไม่ (เช่น การเงิน, การบัญชี, คณิตศาสตร์ประกันภัย, เศรษฐศาสตร์, ตลาดทุน, พาณิชยศาสตร์ บริหารธุรกิจ, วิศวกรรมทางการเงิน, วางแผนการเงิน, คอมพิวเตอร์ประยุกต์เพื่อการจัดการทางการเงิน, CFA, CISA, CFP, FRM, หรือคุณวุฒิทางการเงินอื่น ๆ)
☐ เกี่ยวข้องกับการเงินการลงทุน
☐ ไม่เกี่ยวข้องกับการเงินการลงทุน
- ประสบการณ์ทำงานที่ท่านเคยทำหรือทำอยู่ในปัจจุบันเป็นระยะเวลา 3 ปี ติดต่อกันในช่วงระยะเวลา 10 ปีที่ผ่านมา เกี่ยวข้องกับการลงทุนหรือไม่ (เช่น บริหารจัดการการลงทุน, พัฒนาผลิตภัณฑ์การลงทุน, ขายผลิตภัณฑ์การลงทุน, บริหารความเสี่ยงทางการเงิน, วิเคราะห์การลงทุน, ด้านประกันภัย, ด้านบัญชี, ให้คำปรึกษาด้านกฎหมาย, ด้านการเงินการคลัง)
☐ เกี่ยวข้องกับการลงทุน
☐ ไม่เกี่ยวข้องกับการลงทุน
- ท่านมีประสบการณ์การลงทุนในผลิตภัณฑ์ที่มีความเสี่ยงสูงหรือมีความซับซ้อนเป็นระยะเวลา 3 ปี ติดต่อกันในช่วงระยะเวลา 10 ปีที่ผ่านมา หรือไม่ (เช่น กองทุนรวมน้ำมัน/ทองคำ ที่ไม่ได้ track sport , กองทุนรวมที่มีการลงทุนในอนุพันธ์ที่มีกลยุทธ์แบบซับซ้อน, กองทุนรวม complex return, hedge fund, กองทุนรวมที่ลงทุนในตราสารหนี้ non-investment grade มากกว่า 60%, hybrid securities, perpetual bond, unrated bond, structure notes, Basel III, derivatives)
☐ มีประสบการณ์ลงทุน
☐ ไม่มีประสบการณ์ลงทุน

โดยแบบประเมินฉบับนี้ ข้าพเจ้าขอรับรองว่าข้อมูลดังกล่าวข้างต้นถูกต้องตรงตามความจริงทุกประการ และขอยืนยันคำตอบเพื่อประเมินความรู้ความสามารถสำหรับการลงทุนในผลิตภัณฑ์ที่มีความเสี่ยงสูงหรือมีความซับซ้อน สำหรับทุกบัญชีกองทุนรวมที่ข้าพเจ้ามีกับบลจ.อีสสปริง (ประเทศไทย)

.....
ผู้ถือหน่วยลงทุน

.....
ลงวันที่

สำหรับเจ้าหน้าที่

ลงนาม.....ผู้แนะนำการลงทุน เลขที่ใบอนุญาต

OBJTCOMPLEX

OBJTCOMPLEX