

31 ตุลาคม 2566

เรื่อง แจ้งวันครบกำหนดอายุกองทุน และนำเสนอรายงานการลงทุนในหลักทรัพย์และทรัพย์สินอื่นของ  
กองทุนเปิดอีสปริง US Double Structured Complex Return 1YC

เรียน ท่านผู้ถือหน่วยลงทุน  
กองทุนเปิดอีสปริง US Double Structured Complex Return 1YC

สิ่งที่ส่งมาด้วย รายงานการลงทุนในหลักทรัพย์และทรัพย์สินอื่น

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน อีสปริง (ประเทศไทย) จำกัด (บลจ.อีสปริง) ไคร่ขอขอบคุณท่านผู้ถือหน่วย  
ลงทุนทุกท่านที่ให้ความไว้วางใจเข้าร่วมลงทุนในกองทุนเปิดอีสปริง US Double Structured Complex Return 1YC  
(ES-USDCR1YC) ซึ่งมีสรุปสาระสำคัญ ดังนี้

กองทุน ES-USDCR1YC	สรุปสาระสำคัญ
อายุกองทุน	ประมาณ 1 ปี
วันที่เสนอขาย	วันที่ 25 - 29 กันยายน 2566
วันที่จดทะเบียนกองทุนรวม	วันที่ 3 ตุลาคม 2566

ในการนี้ บลจ.อีสปริง ไคร่ขอแจ้งวันครบกำหนดอายุกองทุน และข้อมูลอื่นๆ ของกองทุน ดังนี้

1. วันครบอายุกองทุนและวันเลิกกองทุน วันที่ 18 ตุลาคม 2567
2. ในวันที่ 17 ตุลาคม 2567 \* ซึ่งเป็นวันทำการก่อนวันสิ้นสุดอายุโครงการ บริษัทจัดการจะดำเนินการให้มีการรับซื้อคืน  
หน่วยลงทุนโดยทำการสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนอัตโนมัติไปยังกองทุนเปิดทหารไทยธนรัฐ

หมายเหตุ : \* ในกรณีที่วันดังกล่าวเป็นวันหยุดจะใช้วันทำการถัดไป ทั้งนี้ สำหรับวันครบกำหนดอายุกองทุน บริษัทจัดการจะดำเนินการให้มีการ  
รับซื้อคืนหน่วยลงทุนโดยทำการสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนอัตโนมัติของกองทุนเปิดอีสปริง US Double Structured Complex  
Return 1YC ทั้งจำนวนของผู้ถือหน่วยลงทุนทุกราย ไปยังกองทุนเปิดทหารไทยธนรัฐ (หรือกองทุนรวมตลาดเงินอื่นใดที่บริษัท  
จัดการเปิดให้บริการสับเปลี่ยนหน่วยลงทุน) ซึ่งเป็นกองทุนรวมภายใต้การจัดการของบริษัทจัดการ ในวันทำการก่อนวันสิ้นสุดอายุ  
โครงการ ตามที่ระบุไว้ในหนังสือชี้ชวนเสนอขายหน่วยลงทุน ดังนั้น ในวันครบกำหนดอายุกองทุน ผู้ถือหน่วยลงทุนสามารถ  
ดำเนินการขายคืน หรือสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนของกองทุนเปิดทหารไทยธนรัฐไปยังกองทุนอื่นได้

1. กองทุนมีนโยบายลงทุนในตราสารหนี้และ/หรือเงินฝากและ/หรือตราสารเทียบเท่าเงินฝากทั้งในประเทศและ/หรือต่างประเทศ  
ที่มีอันดับความน่าเชื่อถืออยู่ในอันดับที่สามารถลงทุนได้ (Investment Grade) ประมาณร้อยละ 97.00 – 99.00 ของมูลค่า  
ทรัพย์สินสุทธิของกองทุน โดยมีเป้าหมายเพื่อให้เงินลงทุนเติบโตเป็นร้อยละ 100 ของเงินลงทุนทั้งหมดเมื่อครบอายุโครงการ  
โดยมีการป้องกันความเสี่ยงด้านอัตราแลกเปลี่ยน (Hedging) สำหรับการลงทุนในตราสารหนี้และ/หรือเงินฝากและ/หรือตรา  
สารเทียบเท่าเงินฝากต่างประเทศทั้งจำนวน
2. กองทุนจะลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) ประเภทสัญญาออปชั่น (Option) หรือสัญญาวอร์แรนท์ (Warrant)  
ที่มีการจ่ายผลตอบแทนอ้างอิงกับกองทุน SPDR S&P500 ETF Trust (SPY) ตามเงื่อนไขการจ่ายผลตอบแทนเพื่อเปิดโอกาส  
ให้กองทุนสามารถสามารถแสวงหาผลตอบแทนส่วนเพิ่มจากการเปลี่ยนแปลงของกองทุน SPDR S&P500 ETF Trust (SPY)  
โดยจะลงทุนประมาณร้อยละ 1.00 – 3.00 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน ทั้งนี้ กองทุนจะไม่ป้องกันความเสี่ยงด้านอัตรา  
แลกเปลี่ยนสำหรับการลงทุนในสัญญาออปชั่นหรือสัญญาวอร์แรนท์

	เงื่อนไข	เงินที่ผู้ลงทุนจะได้รับเมื่อครบอายุโครงการ
กรณีที่ 1	ราคาของสินทรัพย์อ้างอิง ณ วันทำการใดวันทำการหนึ่งที่อยู่ ในช่วงระหว่างอายุสัญญาออพชั่นหรือสัญญาวอร์เรนท (ก่อนวัน พิจารณาสินทรัพย์อ้างอิง) ปรับลดลงมากกว่า 15% หรือปรับ เพิ่มขึ้น มากกว่า 15% เมื่อเทียบกับราคาของสินทรัพย์อ้างอิง ณ วันเริ่มต้นสัญญา	ผู้ลงทุนได้รับเงินต้น 100% + ผลตอบแทนขาดเสียจาก สัญญาออพชั่นหรือสัญญาวอร์เรนท 0.25%
กรณีที่ 2	ราคาของสินทรัพย์อ้างอิง ณ วันพิจารณา สินทรัพย์อ้างอิงปรับลดลงมากกว่า 15% หรือ ปรับเพิ่มขึ้นมากกว่า 15% เมื่อเทียบกับราคา ของสินทรัพย์อ้างอิง ณ วันเริ่มต้นสัญญา	ผู้ลงทุนได้รับเงินต้น 100% + ผลตอบแทนขาดเสียจาก สัญญาออพชั่นหรือสัญญา วอร์เรนท 0.25%
กรณีที่ 3	ราคาของสินทรัพย์อ้างอิง ณ วันพิจารณาสินทรัพย์อ้างอิงปรับ ลดลงมากกว่า 0.50% แต่ไม่เกิน 15% เมื่อเทียบกับราคาของ สินทรัพย์อ้างอิง ณ วันเริ่มต้นสัญญา	ผู้ลงทุนได้รับเงินต้น 100% + ผลตอบแทนจากสัญญา ออพชั่นหรือสัญญาวอร์เรนท ผลตอบแทนจากการลงทุนในสัญญาออพชั่นหรือ สัญญาวอร์เรนท = $(PR \times  ค่าการเปลี่ยนแปลงของ สินทรัพย์อ้างอิง  \times เงินต้น) \times ค่าการเปลี่ยนแปลงของ อัตราแลกเปลี่ยน$
กรณีที่ 4	ราคาสินทรัพย์อ้างอิง ณ วันพิจารณาสินทรัพย์อ้างอิงปรับเพิ่มขึ้น มากกว่า 0.50% แต่ไม่เกิน 15% เมื่อเทียบกับราคาสินทรัพย์ อ้างอิง ณ วันเริ่มต้นสัญญา	ผู้ลงทุนได้รับเงินต้น 100% + ผลตอบแทนจากสัญญา ออพชั่นหรือสัญญาวอร์เรนท ผลตอบแทนจากการลงทุนในสัญญาออพชั่นหรือ สัญญาวอร์เรนท = $(PR \times ค่าการเปลี่ยนแปลงของ สินทรัพย์อ้างอิง \times เงินต้น) \times ค่าการเปลี่ยนแปลงของ อัตราแลกเปลี่ยน$
กรณีที่ 5	ราคาสินทรัพย์อ้างอิง ณ วันพิจารณาสินทรัพย์อ้างอิงอยู่ในกรอบ ลดลงไม่เกิน 0.50% หรือเพิ่มขึ้นไม่เกิน 0.50% เมื่อเทียบกับ ราคาสินทรัพย์อ้างอิง ณ วันเริ่มต้นสัญญา	ผู้ลงทุนได้รับเงินต้น 100% + ผลตอบแทนขาดเสียจาก สัญญาออพชั่น หรือ สัญญาวอร์เรนท 0.25%

\* กรณีอัตราแลกเปลี่ยนระหว่าง USD/THB ไม่เปลี่ยนแปลงเมื่อเปรียบเทียบกับวันเริ่มต้นสัญญาวอร์เรนทและวันที่พิจารณาดัชนีอ้างอิง และไม่มีกรณีที่ตราสารหนี้และ/หรือเงินฝากได้มีการผิดนัดชำระ

ในการพิจารณาว่าเข้าเงื่อนไขการได้รับผลตอบแทนตามกรณีใด กองทุนจะพิจารณาอัตราค่าการเปลี่ยนแปลงของดัชนีอ้างอิงทุกสิ้นวันทำการของดัชนี อ้างอิง

วันเริ่มต้นสัญญาวอร์เรนท (Warrant)	3 ตุลาคม 2566
ระดับของดัชนีอ้างอิง ณ วันเริ่มต้นสัญญาวอร์เรนท (Warrant)	421.59
ระดับของดัชนีอ้างอิง -15% (Put Knock Out)	484.8285
ระดับของดัชนีอ้างอิง +15% (Call Knock Out)	358.3515
อัตราแลกเปลี่ยน USD/THB ณ วันเริ่มต้นสัญญาวอร์เรนท (Warrant)	37.1295
วันพิจารณาสินทรัพย์อ้างอิง	7 ตุลาคม 2567
วันครบอายุสัญญาวอร์เรนท (Warrant)	9 ตุลาคม 2567

\* อายุสัญญาวอร์เรนท คือ วันเริ่มต้นสัญญาวอร์เรนท ถึงวันพิจารณาค่าการเปลี่ยนแปลงของดัชนีอ้างอิง

**พอร์ตการลงทุนของกองทุนช่วงเวลาเสนอขายหน่วยลงทุนครั้งแรก (แหล่งที่มาของข้อมูล : จากผู้ขาย ณ วันที่ 13 กันยายน 2566)**

ตราสารที่คาดว่าจะลงทุน*	อันดับความน่าเชื่อถือของตราสาร/ผู้ออกตราสาร	สัดส่วนการลงทุนโดยประมาณ	อัตราผลตอบแทนของตราสารโดยประมาณ (ต่อปี) (ในรูปสกุลเงินบาท)	ประมาณการเงินต้นและผลตอบแทนที่ได้รับจากการลงทุนในรูปสกุลเงินบาท (ต่อปี)
ตัวเงินคลัง หรือพันธบัตรรัฐบาลไทย หรือพันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย	รัฐบาลไทย	98.58%	2.19%	100.7389%
ประมาณการค่าใช้จ่ายกองทุน**				(0.7389%)
ประมาณการเงินต้นและผลตอบแทนที่ได้รับจากการลงทุน ในส่วนที่ 1 หลังจากหักค่าใช้จ่ายของกองทุนโดยประมาณ				100.00%

**สถานะการลงทุนจริงของกองทุน ES-USDCR1YC ณ วันที่ 19 ตุลาคม 2566**

ตราสารที่คาดว่าจะลงทุน*	อันดับความน่าเชื่อถือของตราสาร/ผู้ออกตราสาร	สัดส่วนการลงทุนโดยประมาณ	อัตราผลตอบแทนของตราสารโดยประมาณ (ต่อปี) (ในรูปสกุลเงินบาท)	ประมาณการเงินต้นและผลตอบแทนที่ได้รับจากการลงทุน ในรูปสกุลเงินบาท (ต่อปี)
ตัวเงินคลัง หรือพันธบัตรรัฐบาลไทย หรือพันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย	รัฐบาลไทย	97.68%	2.42%	99.72%
เงินฝากธนาคาร - ประเภทออมทรัพย์ ธนาคารกสิกรไทย จำกัด (มหาชน)		1.28%	0.63%	1.28%
รวม		98.64%		101.00%
ประมาณการค่าใช้จ่ายกองทุน**				(1.00%)
ประมาณการเงินต้นและผลตอบแทนที่ได้รับจากการลงทุน ใน ส่วนที่ 1 หลังจากหักค่าใช้จ่ายของกองทุนโดยประมาณ				100.00%

ผู้ลงทุนไม่สามารถขายคืนหน่วยลงทุนนี้ในช่วงเวลา 1 ปีได้ ดังนั้น หากมีปัจจัยลบที่ส่งผลกระทบต่อการลงทุนดังกล่าวผู้ลงทุนอาจสูญเสียเงินลงทุนได้

บริษัทฯ ใคร่ขอขอบพระคุณท่านที่ให้ความไว้วางใจ และใช้บริการด้วยดีเสมอมา หากท่านมีข้อสงสัย หรือต้องการสอบถามข้อมูลเพิ่มเติมกรุณาติดต่อศูนย์ที่ปรึกษาการลงทุน โทร.1725 ในวันทำการเวลา 8.30 -17.00 น.

จึงเรียนมาเพื่อโปรดทราบ

ขอแสดงความนับถือ

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน อีสสปริง (ประเทศไทย) จำกัด

**ทำความเข้าใจลักษณะสินค้า เงื่อนไขผลตอบแทนและความเสี่ยง ก่อนตัดสินใจลงทุน**