

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน
อีสท์สปริง (ประเทศไทย) จำกัด

ข้อมูล ณ วันที่ 31 สิงหาคม 2566

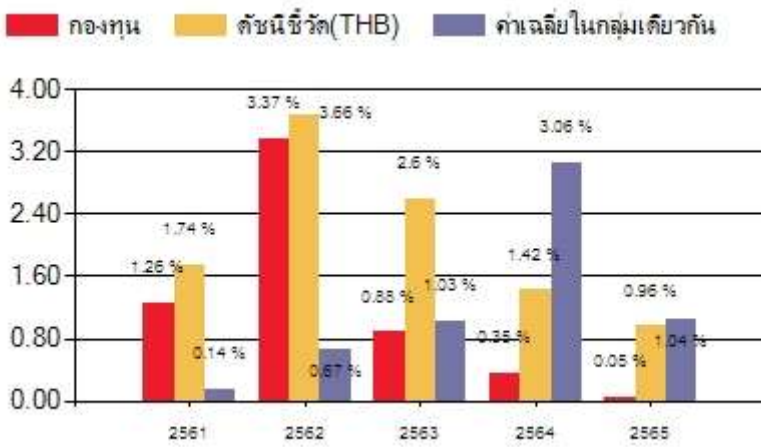
ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมตราสารหนี้ (Fixed Income Fund)
- กองทุนรวมเพื่อการเลี้ยงชีพ (Retirement Mutual Fund)
- กลุ่ม Mid Term Government Bond

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- ลงทุนในหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินที่เกี่ยวข้องกับตราสารแห่งหนี้ เงินฝาก และ/หรือตราสารทางการเงินต่างๆ ของทั้งภาครัฐและเอกชนที่มีความมั่นคงและให้ผลตอบแทนที่ดี
- มุ่งหวังให้ได้รับผลประโยชน์การเคลื่อนไหวสูงกว่าดัชนีชี้วัด

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (% ต่อปี)



ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด (% ต่อปี)

| | YTD | 3 เดือน | 6 เดือน | 1 ปี |
|-----------------------------|------|---------|---------|------|
| กองทุน | 0.82 | 0.32 | 0.77 | 1.40 |
| ดัชนีชี้วัด (THB) | 0.70 | 0.40 | 0.78 | 1.59 |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน | 0.63 | 0.24 | 0.59 | 1.20 |
| ความผันผวนกองทุน | 0.30 | 0.21 | 0.28 | 0.37 |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด (THB) | 0.39 | 0.29 | 0.36 | 0.50 |

| | 3 ปี | 5 ปี | 10 ปี | ตั้งแต่จัดตั้ง |
|-----------------------------|------|------|-------|----------------|
| กองทุน | 0.88 | 1.19 | 2.03 | 2.62 |
| ดัชนีชี้วัด (THB) | 1.38 | 2.18 | 2.95 | 2.83 |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน | 0.79 | 1.21 | 1.80 | - |
| ความผันผวนกองทุน | 0.58 | 0.75 | 0.63 | 2.17 |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด (THB) | 0.54 | 0.60 | 1.09 | 1.47 |

ระดับความเสี่ยง

| | | | | | | | | | |
|-----|---|---|---|---|---|---|---|---|-----|
| ต่ำ | 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | สูง |
|-----|---|---|---|---|---|---|---|---|-----|

คำอธิบาย

ลงทุนในตราสารหนี้เอกชน โดยมีตราสาร non-investment grade / unrated ไม่เกิน 20% ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม

| | |
|----------------------------------|--------------------------|
| วันจดทะเบียนกองทุน | 26 ธ.ค. 2545 |
| วันเริ่มต้น class | - |
| นโยบายการจ่ายเงินปันผล | ไม่มีนโยบายจ่ายเงินปันผล |
| การรับซื้อคืนหน่วยลงทุนอัตโนมัติ | - |
| อายุกองทุน | ไม่กำหนด |

ดัชนีชี้วัด :

1. ผลตอบแทนรวมของดัชนีชี้วัดที่คิดคำนวณจากข้อมูล Mark-to-Market ที่มีอันดับความน่าเชื่อถือในระดับน่าลงทุน (BBB ขึ้นไป) ของสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย สัดส่วน 50%
2. ดัชนีพันธบัตรรัฐบาลของสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย สัดส่วน 50%

สำหรับการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด ผลการดำเนินงานน้อยกว่า 1 ปี คำนวณตามระยะเวลาจริง

คำเตือน :

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวม มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต: มีบริษัทแม่ดูแลให้ทำตามกฎหมาย
จัดอันดับกองทุน Morningstar ★★★★★

การซื้อขายหน่วยลงทุน

วันทำการซื้อ : ทุกวันทำการ

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

ระยะเวลาปรับเงินค่าขายคืน : T+1

Remark : ปัจจุบันและในภาวะปกติจะชำระภายใน 1 วันทำการนับถัดจากวันที่คำสั่งขายสามารถดำเนินการได้

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)

| ค่าธรรมเนียม | สูงสุดไม่เกิน | เก็บจริง |
|---------------|---------------|----------|
| การจัดการ | 0.803 | 0.535 |
| รวมค่าใช้จ่าย | 2.140 | 0.708 |

หมายเหตุ : รวมค่าใช้จ่าย ของรอบปีบัญชี วันที่ 1 พย. 64 - 31 ต.ค 65

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)

| ค่าธรรมเนียม | สูงสุดไม่เกิน | เก็บจริง |
|-----------------------------|---------------|----------|
| การขาย | 3.210 | ยกเว้น |
| การรับซื้อคืน | 3.210 | ยกเว้น |
| การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า | 3.210 | ยกเว้น |
| การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก | 3.210 | ยกเว้น |
| การโอนหน่วย | ไม่มี | ยกเว้น |

หมายเหตุ : ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน

| ชื่อประเภททรัพย์สิน | % NAV |
|----------------------------|-------|
| หุ้นกู้ | 80.57 |
| พันธบัตร | 17.70 |
| ตัวแลกเงิน+ตัวสัญญาใช้เงิน | 1.14 |
| ตัวเงินคลัง | 0.49 |
| เงินฝากและอื่นๆ | 0.10 |

ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก

| ชื่อหลักทรัพย์สิน | % NAV |
|---|-------|
| พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย (CB24704A) | 3.93 |
| บริษัท ซีพีออลล์ จำกัด (มหาชน) (CPALL243B) | 3.90 |
| บริษัท ไมเนอร์ อินเตอร์เนชั่นแนล จำกัด (มหาชน) (MINT255A) | 2.69 |
| พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย (CB23928A) | 2.69 |
| บริษัท ทุนธนชาติ จำกัด (มหาชน) (TCAP230A) | 2.50 |

ข้อมูลเชิงสถิติ

| | |
|----------------------------|---------------------|
| Maximum Drawdown | -2.40% |
| Recovering Period | 2 ปี 10 เดือน |
| อายุเฉลี่ยของตราสารหนี้ | 1 ปี 5 เดือน 23 วัน |
| อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน | 39.17% |
| Yield to Maturity | 2.88% |

การจัดสรรการลงทุนในผู้ออกตราสาร 5 อันดับแรก

| ชื่อผู้ออกตราสาร | % NAV |
|--|-------|
| ธนาคารแห่งประเทศไทย | 15.63 |
| บริษัท ซีพี ออลล์ จำกัด (มหาชน) | 6.08 |
| บริษัท ลีสซิ่งไอซีบีซี (ไทย) จำกัด | 5.90 |
| บริษัท ไทยเบฟเวอเรจ จำกัด (มหาชน) | 4.25 |
| บริษัท เมืองไทย แคปปิตอล จำกัด (มหาชน) | 3.83 |

การจัดสรรการลงทุนตามอันดับความน่าเชื่อถือ (%)

| ผู้ออก | ในประเทศ | national | international |
|----------------|----------|----------|---------------|
| Gov bond / AAA | 25.68 | | |
| AA | 10.42 | | |
| A | 56.61 | | |
| BBB | 7.20 | | |
| ต่ำกว่า BBB | | | |
| Unrated / non | 0.00 | | |

ผู้จัดการกองทุนรวม

นาย วิศิษฐ์ ชื่นรัตนกุล (ตั้งแต่ 31 พ.ค. 2554)

น.ส. วิภาสิริ เกษมสุข (ตั้งแต่ 26 ธ.ค. 2545)

นาง รัชนิภา พรรคพานิช (ตั้งแต่ 08 มิ.ย. 2548)

ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือบริหารความเสี่ยง

ด้านสภาพคล่องได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



www.eastspring.co.th

คำอธิบาย

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

Recovering Period ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาตั้งแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้เวลานานเท่าใด

FX Hedging เปรอ์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตกองทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลานึง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์กับผลรวมของมูลค่าการขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 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

Expert in Asia. Invest in Your Future.