

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน
อีสท์สปริง (ประเทศไทย) จำกัด

ข้อมูล ณ วันที่ 29 มีนาคม 2567

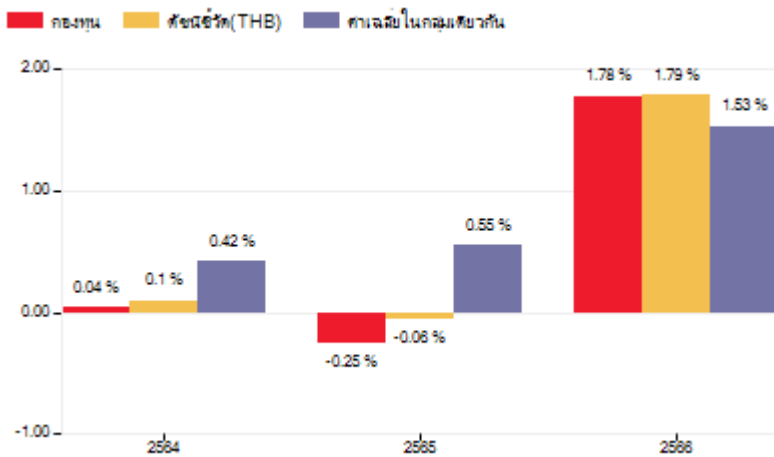
ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- ▶ กองทุนรวมตราสารหนี้ (Fixed Income Fund)
- ▶ กลุ่ม Short Term General Bond

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- ▶ กองทุนมีนโยบายการลงทุนทั้งในและต่างประเทศ ในเงินฝากหรือตราสารเทียบเท่าเงินฝาก ตราสารหนี้ (ภาคเอกชน และ/หรือภาครัฐ และ/หรือรัฐวิสาหกิจ) ตราสารด้อยสิทธิ สูง เป็นต้น
- ▶ มุ่งหวังให้ได้รับผลประโยชน์การเคลื่อนไหวสูงกว่าดัชนีชี้วัด

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (% ต่อปี)



ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด (% ต่อปี)

	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี
กองทุน	0.65	0.65	1.27	2.11
ดัชนีชี้วัด (THB)	0.57	0.57	1.53	1.96
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	0.62	0.62	1.27	1.87
ความผันผวนกองทุน	0.15	0.15	0.18	0.22
ความผันผวนดัชนีชี้วัด (THB)	0.26	0.26	0.31	0.33

	3 ปี	5 ปี	10 ปี	ตั้งแต่จัดตั้ง
กองทุน	-	-	-	0.87
ดัชนีชี้วัด (THB)	-	-	-	0.94
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	-	-	-	-
ความผันผวนกองทุน	-	-	-	0.25
ความผันผวนดัชนีชี้วัด (THB)	-	-	-	0.38

ระดับความเสี่ยง

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

คำอธิบาย

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

ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน	14 ก.ย. 2564
วันเริ่มต้น class	-
นโยบายการจ่ายเงินปันผล	ไม่มีนโยบายจ่ายเงินปันผล
การรับซื้อคืนหน่วยลงทุนอัตโนมัติ	-
อายุกองทุน	ไม่กำหนด

ดัชนีชี้วัด :

1. ผลตอบแทนรวมของดัชนีพันธบัตรรัฐบาลระยะสั้นของสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย สัดส่วน 30%
2. ผลตอบแทนรวมสุทธิของดัชนีตราสารหนี้ภาคเอกชน Mark-to-Market ที่มีอันดับความน่าเชื่อถือของผู้ออกตราสารอยู่ในระดับ BBB ขึ้นไป อายุ 1 - 3 ปี ของสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย สัดส่วน 25%
3. ดัชนีตราสารหนี้ภาคเอกชนระยะสั้น (ThaiBMA Commercial Paper Index) ที่มีอันดับความน่าเชื่อถือของผู้ออกตราสารอยู่ในระดับ A- ขึ้นไป ของสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย สัดส่วน 20%
4. ดัชนี Bloomberg Barclays 1-3 Year U.S. Government/Credit Bond Hedged USD สัดส่วน 15%

หมายเหตุ: ปรับด้วยต้นทุนการป้องกันความเสี่ยงด้านอัตราแลกเปลี่ยนเพื่อเทียบเท่าค่าสกุลเงินบาท ณ วันที่คำนวณผลตอบแทน

5. ดัชนี Bloomberg 12 Month Short Term Bank Yield Hedged USD สัดส่วน 10%

หมายเหตุ: ปรับด้วยต้นทุนการป้องกันความเสี่ยงด้านอัตราแลกเปลี่ยนเพื่อเทียบเท่าค่าสกุลเงินบาท ณ วันที่คำนวณผลตอบแทน

สำหรับผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด 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: ปัจจุบันและในภาวะปกติจะชำระภายใน 1 วันทำการนับถัดจากวันที่คำสั่งขายสามารถดำเนินการได้

การขายคืนหน่วยลงทุน

วันทำการขายคืน: ทุกวันทำการ

เวลาทำการ: 08:30 น. -15:30 น.

การขายคืนขั้นต่ำ: 1 บาท

ยอดคงเหลือขั้นต่ำ: ไม่กำหนด

ระยะเวลาชำระเงินค่าขายคืน: T+1

ข้อมูลเชิงสถิติ

Maximum Drawdown	-0.59%
Recovering Period	5 เดือน
FX Hedging	96.04%
อายุเฉลี่ยของตราสารหนี้	9 เดือน 13 วัน
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน	97.92%
Yield to Maturity	2.80%

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	0.5000	0.0500
รวมค่าใช้จ่าย	0.7100	0.1651

หมายเหตุ: รวมค่าใช้จ่ายของรอบปีบัญชี 1 ก.ย. 65 ถึง 31 ส.ค. 66

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าหน่วยลงทุน)

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

หมายเหตุ: ค่าโอน 5 บาทต่อ 1,000 หน่วย

การจัดสรรการลงทุนในผู้ออกตราสาร 5 อันดับแรก

ชื่อผู้ออกตราสาร	% NAV
ธนาคารแห่งประเทศไทย	21.59
บริษัท เอพี (ไทยแลนด์) จำกัด (มหาชน)	5.70
Berkshire Hathaway Inc	5.23
บริษัท เบอริลลี่ ยูคเกอร์ จำกัด (มหาชน)	5.03
บริษัท น้ำตาลมิตรผล จำกัด	4.97

การจัดสรรการลงทุนตามอันดับความน่าเชื่อถือ (%)

ผู้ออก	ในประเทศ	national	international
Gov bond / AAA	21.59		
AA	6.25		
A	34.88		27.95
BBB			7.89
ต่ำกว่า BBB			
Unrated / non			

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน

ชื่อประเภททรัพย์สิน	% NAV
หุ้นกู้	68.44
พันธบัตร	26.86
ตั๋วแลกเงินแบบมีระยะเวลา (BE Term)	3.26
เงินฝากธนาคารประเภทออมทรัพย์	1.82
รายการอื่นๆ	-0.38

ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก

ชื่อหลักทรัพย์สิน	% NAV
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย 8/FRB364/66	18.85
หุ้นกู้ไม่ด้อยสิทธิ และไม่มีประกันของบริษัท เอพี (ไทยแลนด์) จำกัด (มหาชน)	5.70
Berkshire Hathaway Inc	5.23
หุ้นกู้ของบริษัท เบอริลลี่ ยูคเกอร์ จำกัด (มหาชน)	5.03
Shinhan Bank Co Ltd	4.18

ผู้จัดการกองทุนรวม

นาย ธีระศักดิ์ ทุติยะโพธิ์	(ตั้งแต่ 14 ก.ย. 2564)
นาย วิศิษฐ์ ชื่นรัตนกุล	(ตั้งแต่ 11 ก.ค. 2565)
น.ส. วิภาสิริ เกษมสุข	(ตั้งแต่ 11 ก.ค. 2565)
นาง รัชนิกา พรรคพานิช	(ตั้งแต่ 11 ก.ค. 2565)
นาง สุวัลลี ศิริสมมติยีนยง	(ตั้งแต่ 14 พ.ย. 2564)
นาย สิทธิ ธีรกุลชน	(ตั้งแต่ 11 ก.ค. 2565)
นาย ธารดร เขียวมีส่วน	(ตั้งแต่ 17 ก.ค. 2566)

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 เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาตั้งแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลาเวลานานเท่าใด

FX Hedging เปรอ์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลานึง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์กับผลรวมของมูลค่าการขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 1 ปีหารด้วยมูลค่า NAV ของกองทุนรวมเฉลี่ยในรอบระยะเวลาเดียวกัน กองทุนรวมที่มีค่า portfolio turnover สูง บ่งชี้ถึงการซื้อขายหลักทรัพย์บ่อยครั้งของผู้จัดการกองทุนและทำให้มีต้นทุนการซื้อขายหลักทรัพย์ที่สูง จึงต้องพิจารณาเปรียบเทียบ กับผลการดำเนินงานของกองทุนรวมเพื่อ ประเมินความคุ้มค่าของการซื้อขายหลักทรัพย์ดังกล่าว

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