

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน
อีสท์สปริง (ประเทศไทย) จำกัด

ข้อมูล ณ วันที่ 29 กุมภาพันธ์ 2567

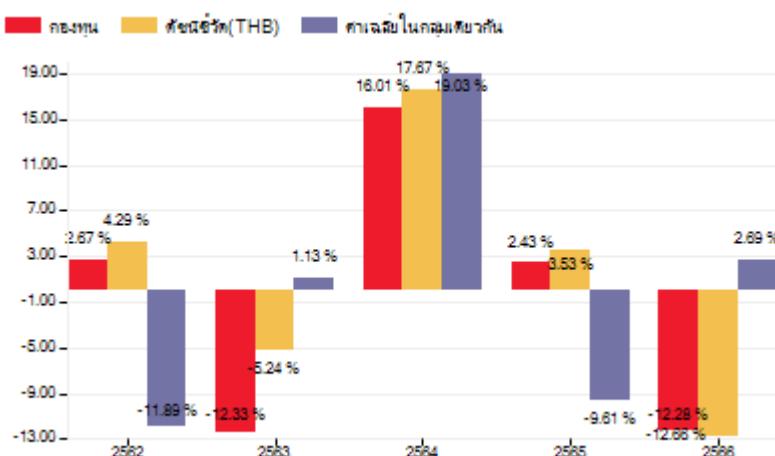
ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- ▶ กองทุนรวมตราสารทุน (Equity Fund)
- ▶ กองทุนรวมหุ้นระยะยาว (Long Term Equity Fund)
- ▶ กลุ่ม Equity General

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- ▶ ลงทุนในหุ้นสามัญของบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย โดยเฉลี่ยในรอบปี บัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 65 ของ NAV โดยจะมุ่งเน้นลงทุนในหุ้นสามัญที่มีปัจจัยพื้นฐานดี และ/หรือมีศักยภาพในการเจริญเติบโตดี และมีมูลค่าหลักทรัพย์ตามราคาตลาด (Market Capitalization) สูง ทั้งนี้ กองทุนอาจลงทุนในตราสารหนี้ที่มีการจ่ายผลตอบแทนอ้างอิงกับตัวแปร
- ▶ มองหวังให้ได้รับผลประกอบการเคลื่อนไหวสูงกว่าดัชนีชี้วัด

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (%) ต่อไป



ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบบวกหมุด (%) ต่อปี)

	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี
กองทุน	-1.20	1.15	-10.88	-9.72
ดัชนีชี้วัด (THB)	-2.54	0.05	-11.35	-12.75
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	-2.59	0.14	-10.54	-11.74
ความผันผวนกองทุน	10.82	10.32	10.89	11.52
ความผันผวนดัชนีชี้วัด (THB)	10.41	10.08	11.60	12.07
	3 ปี	5 ปี	10 ปี	ตั้งแต่จัดตั้ง
กองทุน	-0.91	-2.27	0.86	6.09
ดัชนีชี้วัด (THB)	0.05	-0.68	3.52	7.72
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	-1.09	-1.77	1.86	-
ความผันผวนกองทุน	11.13	16.22	14.43	18.36
ความผันผวนดัชนีชี้วัด (THB)	11.32	16.65	14.38	18.42

ลำดับความเสี่ยง	1	2	3	4	5	6	7	8	สูง
คำอธิบาย									
ลงทุนในตราสารทุน โดยเฉลี่ยในรอบปีไม่น้อยกว่า 65% ของ NAV									

ข้อมูลกองทุนรวม	
วันจดทะเบียนกองทุน	20 ต.ค. 2547
วันเริ่มต้น class	-
นโยบายการจ่ายเงินบันผล	ไม่ระบุนโยบายจ่ายเงินบันผล
การรับซื้อคืนหน่วยลงทุนอัตโนมัติ	-
อาชญากรรม	ไม่กำหนด

ดัชนีชี้วัด :

- ดัชนีผลตอบแทนรวมตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET TRI) สัดส่วน 100%
- สำหรับผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบบวกหมุด ผลการดำเนินงานน้อยกว่า 1 ปี คำนวณตามระยะเวลาจริง

คำเตือน :

- ▶ การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ▶ ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวม วิธีได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต: มีบริษัทแม่ดูแลให้ทำตามกฎหมาย
จัดอันดับกองทุน Morningstar ★★★

การซื้อหน่วยลงทุน

วันทำการซื้อ : ทุกวันทำการ

เวลาทำการ : 08:30 น. -15:30 น.

การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ : 1 บาท

การซื้อครั้งต่อไปขั้นต่ำ : 1 บาท

การขายคืนหน่วยลงทุน

วันทำการขายคืน : ทุกวันทำการ

เวลาทำการ : 08:30 น. -15:30 น.

การขายคืนขั้นต่ำ : 1 บาท

ยอดคงเหลือขั้นต่ำ : ไม่กำหนด

ระยะเวลาจับเงินค่าขายคืน : T+2

Remark : 1.ปัจจุบันและในภาวะปกติจะชำระภายใน 2 วันทำการนับตั้งจากวันที่คำสั่งขายสามารถ

ดำเนินการได้ 2.การลงทุนใน LTF ตั้งแต่วันที่ 1 ม.ค. 2563 เป็นต้นไป จะไม่มีสิทธิได้รับสิทธิประโยชน์

ทางภาษี

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	1.685	1.685
รวมค่าใช้จ่าย	3.210	1.856

หมายเหตุ : รวมค่าใช้จ่ายของรอบปีบัญชี วันที่ 1 ม.ค. 65 - 31 ธ.ค. 66

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าหน่วยลงทุน)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การขาย	0.268	ยกเว้น
การรับซื้อคืน	0.268	ยกเว้น
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า	0.268	ยกเว้น
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก	0.268	ยกเว้น
การโอนหน่วย	ไม่มี	ยกเว้น

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน

ชื่อประเภททรัพย์สิน	% NAV
หุ้นสามัญ	90.56
เงินฝากและอื่นๆ	9.44

ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก

ชื่องลักษณ์	% NAV
บริษัท ซี.พี. ออลล์ จำกัด (มหาชน) (CPALL)	6.83
บริษัท เอดวานซ์ อินฟอร์เมชัน โซลูชันส์ จำกัด (มหาชน) (ADVANC)	5.17
บริษัท กรุงเทพคุณิตเวชกร จำกัด (มหาชน) (BDMS)	4.68
บริษัท ปตท.สำรวจและผลิต ปิโตรเลียม จำกัด (มหาชน) (PTTEP)	4.17
ธนาคารกรุงเทพ จำกัด (มหาชน) (BBL)	4.02

ข้อมูลเชิงสถิติ

Maximum Drawdown	-37.07%
Sharpe Ratio	-0.17
Alpha	-0.96
Beta	0.87%
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน	123.81%

การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม

กลุ่มอุตสาหกรรม	% NAV
พลังงานและสาธารณูปโภค	14.76
พาณิชย์	13.57
ธนาคาร	12.13
ขนส่งและโลจิสติกส์	8.57
อาหารและเครื่องดื่ม	6.49

ผู้จัดการกองทุนรวม

น.ส. พัชราภา นหัทธนกุล

(ตั้งแต่ 28 มิ.ย. 2564)

นาย ศศตันธ์ พันธ์

(ตั้งแต่ 18 เม.ย. 2560)

ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือบริหารความเสี่ยง

ด้านสภาพคล่องได้ในหนังสือชีวันฉบับเต็ม



www.eastspring.co.th

คำอธิบาย

Maximum Drawdown เปอร์เซ็นต์ผลขาดทุนสูงสุดของกองทุนรวมในระยะเวลา 5 ปีข้อนหลัง (หรือตั้งแต่จัดตั้งกองทุนกรณีที่ยังไม่ครบ 5 ปี) โดยวัดจากระดับ NAV ต่อหน่วยที่จุดสูงสุดไปจนถึงจุดต่ำสุดในช่วงที่ NAV ต่อหน่วยปรับตัวลดลง ค่า Maximum Drawdown เป็นข้อมูลที่ช่วยให้ทราบถึงความเสี่ยงที่อาจขาดทุนจากการลงทุนในกองทุนรวม

Recovering Period ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาตั้งแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลาเท่าไร

FX Hedging เปอร์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตกองทุนในช่วงเวลาหนึ่ง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ากว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 1 ปีหารด้วยมูลค่า NAV ของกองทุนรวมเฉลี่ยในรอบระยะเวลาเดียวกัน กองทุนรวมที่มีค่า portfolio turnover สูง บ่งชี้ถึงการซื้อขายหลักทรัพย์บ่อยครั้งของผู้จัดการกองทุนและทำให้มีต้นทุนการซื้อขายหลักทรัพย์ที่สูง จึงต้องพิจารณาเปรียบเทียบกับผลการดำเนินงานของกองทุนรวมเพื่อประเมินความคุ้มค่าของการซื้อขายหลักทรัพย์ดังกล่าว

Sharpe Ratio อัตราส่วนระหว่างผลตอบแทนส่วนเพิ่มของกองทุนรวมเบรียบเทียบกับความเสี่ยงจากการลงทุน โดยคำนวณจากผลต่างระหว่างอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมกับอัตราผลตอบแทนที่ปราศจากความเสี่ยง (risk-free rate) เบรียบเทียบกับค่าเบี่ยงเบนมาตรฐาน (standard deviation) ของกองทุนรวม ค่า Sharpe Ratio สะท้อนถึงอัตราผลตอบแทนที่กองทุนรวมควรได้รับเพิ่มขึ้นเพื่อทดเชิงกับความเสี่ยงที่กองทุนรวมรับมา โดยกองทุนรวมที่มีค่า Sharpe Ratio สูงกว่าจะเป็นกองทุนที่มีประสิทธิภาพในการบริหารจัดการลงทุนที่ดีกว่า เนื่องจากได้รับผลตอบแทนส่วนเพิ่มที่สูงกว่าภายในระยะเวลาที่เทียบกัน

Alpha ผลตอบแทนส่วนเกินของกองทุนรวมเมื่อเบรียบเทียบกับดัชนีชี้วัด (benchmark) โดยค่า Alpha ที่สูง หมายถึง กองทุนสามารถสร้างผลตอบแทนได้สูงกว่าดัชนีชี้วัด ซึ่งเป็นผลจากประสิทธิภาพของผู้จัดการกองทุนในการคัดเลือกหุ้นที่เหมาะสม

Beta ระดับและทิศทางการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุน โดยเบรียบเทียบกับอัตราการเปลี่ยนแปลงของตลาด Beta น้อยกว่า 1 แสดงว่า หลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนมากกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด Beta มากกว่า 1 แสดงว่า หลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนมากกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด

Tracking Error อัตราผลตอบแทนของกองทุนเมื่อประสิทธิภาพในการเลี้ยงแบบดัชนีชี้วัด โดยหาก tracking error ต่ำ หมายถึงกองทุนรวมมีประสิทธิภาพในการสร้างผลตอบแทนให้ใกล้เคียงกับดัชนีชี้วัด กองทุนรวมที่มีค่า tracking error สูง จะมีอัตราผลตอบแทนโดยเฉลี่ยห่างจากดัชนีชี้วัดมากขึ้น

Yield to Maturity อัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในตราสารหนี้โดยต้องครบกำหนดอยู่ ซึ่งคำนวณจากดอกเบี้ยที่จะได้รับในอนาคตตลอดอายุตราสารและเงินต้นที่จะได้รับคืน นำมาคิดผลเป็นมูลค่าปัจจุบัน โดยใช้วัดอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมตราสารหนี้ คำนวณจากค่าเฉลี่ยต่อวันหักของ Yield to Maturity ของตราสารหนี้แต่ละตัวที่กองทุนมีการลงทุน และเนื่องจาก Yield to Maturity มีหน่วยมาตราฐานเป็นเบอร์เซ็นต์ต่อปี จึงสามารถนำไปใช้เบรียบเทียบอัตราผลตอบแทนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีนโยบายอีโคครองตราสารหนี้จนครบกำหนดอยู่และมีลักษณะการลงทุนที่ใกล้เคียงกันได้



www.eastspring.co.th

บริษัทหลักทรัพย์จดการกองทุน อีสปอร์ตบิ๊ง (ประเทศไทย) จำกัด

ชั้น 9 อาคาร มิตราทาวน์ อพาร์ทเม้นท์ ทาวเวอร์ 944 ถนนพระราม 4

แขวงวังใหม่ เขตปทุมวัน กรุงเทพมหานคร 10330

| ศูนย์ที่ปรึกษาการลงทุน 1725 | ผู้สนับสนุนการขายและรับซื้อคืนหน่วยลงทุน ที่ได้รับการแต่งตั้ง