

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน
อีสท์สปริง (ประเทศไทย) จำกัด

ข้อมูล ณ วันที่ 29 มีนาคม 2567

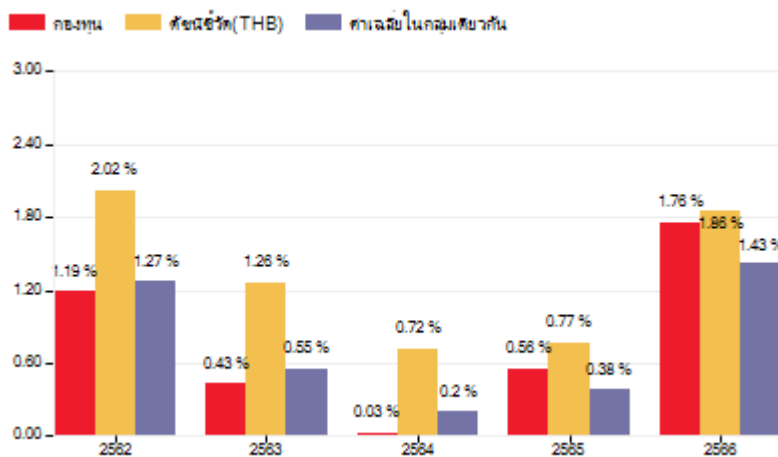
ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมตราสารหนี้ (Fixed Income Fund)
- กองทุนรวมตลาดเงิน (Money Market Fund)
- กองทุนรวมเพื่อการเลี้ยงชีพ (Retirement Mutual Fund)
- กลุ่ม Money Market Government

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- ลงทุนในเงินฝาก ตราสารแห่งหนึ่ง อุดหนุนทางการเงิน หรือตราสารทางการเงินอื่นใดที่มีกำหนดวันชำระหนี้ตาม ตราสารเมื่อทวงถามหรือเมื่อได้เห็น หรือไม่เกิน 397 วัน นับแต่วันที่ลงทุนในทรัพย์สินหรือเข้าทำสัญญา โดยกองทุนกำหนดอายุถ่วงเฉลี่ยแบบถ่วงน้ำหนักของกระแสเงินที่จะได้รับจากทรัพย์สินที่กองทุนรวมลงทุนหรือมีไว้ (Portfolio Duration) ในขณะใด ๆ น้อยกว่าหรือเท่ากับ 92 วัน
- มุ่งหวังให้ได้รับผลประโยชน์การเคลื่อนไหวสูงกว่าดัชนีชี้วัด

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (% ต่อปี)



ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด (% ต่อปี)

| | YTD | 3 เดือน | 6 เดือน | 1 ปี |
|-----------------------------|------|---------|---------|------|
| กองทุน | 0.55 | 0.55 | 1.13 | 2.03 |
| ดัชนีชี้วัด (THB) | 0.65 | 0.65 | 1.30 | 2.22 |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน | 0.50 | 0.50 | 0.99 | 1.72 |
| ความผันผวนกองทุน | 0.09 | 0.09 | 0.10 | 0.09 |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด (THB) | 0.10 | 0.10 | 0.11 | 0.10 |

| | 3 ปี | 5 ปี | 10 ปี | ตั้งแต่จัดตั้ง |
|-----------------------------|------|------|-------|----------------|
| กองทุน | 0.96 | 0.84 | 1.08 | 1.68 |
| ดัชนีชี้วัด (THB) | 1.28 | 1.37 | 1.27 | 1.36 |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน | 0.82 | 0.80 | 1.02 | - |
| ความผันผวนกองทุน | 0.08 | 0.08 | 0.07 | 0.13 |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด (THB) | 0.13 | 0.52 | 0.37 | 0.26 |

ระดับความเสี่ยง

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

คำอธิบาย

ลงทุนในเงินฝาก ตราสารเทียบเท่าเงินฝาก พันธบัตรรัฐบาล หรือ พันธบัตร รัฐบาล. ซึ่งมีอายุไม่เกิน 397 วัน โดยไม่มีความเสี่ยงต่างประเทศ

ข้อมูลกองทุนรวม

| | |
|----------------------------------|--------------------------|
| วันจดทะเบียนกองทุน | 12 ก.ค. 2545 |
| วันเริ่มต้น class | - |
| นโยบายการจ่ายเงินปันผล | ไม่มีนโยบายจ่ายเงินปันผล |
| การรับซื้อคืนหน่วยลงทุนอัตโนมัติ | - |
| อายุกองทุน | ไม่กำหนด |

ดัชนีชี้วัด :

1. ดัชนีตราสารหนี้ภาคเอกชนระยะสั้น (ThaiBMA Commercial Paper Index) ที่มีอันดับความน่าเชื่อถือของผู้ออกตราสารอยู่ในระดับ A- ขึ้นไป ของสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย สัดส่วน 50%
2. ดัชนีตราสารหนี้ภาครัฐระยะสั้น (Short-term Government Bond Index) สัดส่วน 50%

สำหรับผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด ผลการดำเนินงานน้อยกว่า 1 ปี คำนวณตามระยะเวลาจริง

คำเตือน :

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวม มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึง

ผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต: มีบริษัทแม่ดูแลให้ทำตามกฎหมาย

การซื้อขายหน่วยลงทุน

วันทำการซื้อ: ทุกวันทำการ

เวลาทำการ: 08:30 น. -15:30 น.

การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ: 1 บาท

การซื้อครั้งถัดไปขั้นต่ำ: 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 | 0.696 | 0.150 |
| รวมค่าใช้จ่าย | 2.140 | 0.281 |

หมายเหตุ: รวมค่าใช้จ่ายของรอบปีบัญชี วันที่ 16 ต.ค. 65 - 15 ต.ค. 66

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าหน่วยลงทุน)

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

หมายเหตุ: ค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายเป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม หรือภาษีอื่นใด (ถ้ามี)

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน

| ชื่อประเภททรัพย์สิน | % NAV |
|-------------------------------|-------|
| หุ้นกู้ | 44.87 |
| พันธบัตร | 36.65 |
| ตัวแลกเปลี่ยน+ตัวสัญญาใช้เงิน | 17.11 |
| เงินฝากและอื่นๆ | 1.38 |

ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก

| ชื่อหลักทรัพย์ | % NAV |
|--|-------|
| พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย (CBF24805A) | 10.37 |
| พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย (CB24425A) | 7.73 |
| บริษัท พญา โฮลดิ้ง จำกัด (มหาชน) (PSH245A) | 6.05 |
| บริษัท ทีเอสไอไฟแนนเชียลกรุ๊ป จำกัด (มหาชน) (TISCOG24530A) | 5.17 |
| บริษัท ทางด่วนและรถไฟฟ้ากรุงเทพ จำกัด (มหาชน) (BEM244A) | 4.85 |

ข้อมูลเชิงสถิติ

| | |
|----------------------------|----------------|
| Maximum Drawdown | -0.04% |
| Recovering Period | 2 เดือน |
| อายุเฉลี่ยของตราสารหนี้ | 1 เดือน 18 วัน |
| อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน | 113.79% |
| Yield to Maturity | 2.55% |

การจัดสรรการลงทุนในผู้ออกตราสาร 5 อันดับแรก

| ชื่อผู้ออกตราสาร | % NAV |
|---|-------|
| ธนาคารแห่งประเทศไทย | 36.65 |
| บริษัท เอก-ชัย ดีสทริบิวชั่น ซิสเทม จำกัด | 6.10 |
| บริษัท พญา โฮลดิ้ง จำกัด (มหาชน) | 6.05 |
| บริษัท ทีเอสไอไฟแนนเชียลกรุ๊ป จำกัด (มหาชน) | 5.17 |
| บริษัท ทางด่วนและรถไฟฟ้ากรุงเทพ จำกัด (มหาชน) | 4.85 |

การจัดสรรการลงทุนตามอันดับความน่าเชื่อถือ (%)

| ผู้ออก | ในประเทศ | national | international |
|----------------|----------|----------|---------------|
| Gov bond / AAA | 36.65 | | |
| AA | 8.61 | | |
| A | 53.38 | | |
| BBB | | | |
| ต่ำกว่า BBB | | | |
| Unrated / non | | | |

ผู้จัดการกองทุนรวม

| | |
|----------------------------|-------------------------|
| นาย ธีระศักดิ์ ทุติยะโพธิ์ | (ตั้งแต่ 11 ก.ค. 2565) |
| นาย วิศิษฐ์ ชื่นรัตนกุล | (ตั้งแต่ 31 พ.ค. 2554) |
| น.ส. วิภาสิริ เกษมสุข | (ตั้งแต่ 03 เม.ย. 2545) |
| นาง รัชนิภา พรรคพานิช | (ตั้งแต่ 08 มิ.ย. 2548) |
| นาง สุวัลลี ศิริสมมติยีนยง | (ตั้งแต่ 11 ก.ค. 2565) |
| นาย สิทธิ ธีรกุลชน | (ตั้งแต่ 27 ต.ค. 2564) |
| 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 เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาตั้งแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลาานเท่าใด

FX Hedging เปรอ์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตกองทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลานึง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์กับผลรวมของมูลค่าการขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 1 ปีหารด้วยมูลค่า NAV ของกองทุนรวมเฉลี่ยในรอบระยะเวลาเดียวกัน กองทุนรวมที่มีค่า portfolio turnover สูง บ่งชี้ถึงการซื้อขายหลักทรัพย์บ่อยครั้งของผู้จัดการกองทุนและทำให้มีต้นทุนการซื้อขายหลักทรัพย์ที่สูง จึงต้องพิจารณาเปรียบเทียบ กับผลการดำเนินงานของกองทุนรวมเพื่อประเมินความคุ้มค่าของการซื้อขายหลักทรัพย์ดังกล่าว

Sharpe Ratio อัตราส่วนระหว่างผลตอบแทนส่วนเพิ่มของกองทุนรวมเปรียบเทียบกับความเสี่ยงจากการลงทุน โดยคำนวณจากผลต่างระหว่างอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมกับอัตราผลตอบแทนที่ปราศจากความเสี่ยง (risk-free rate) หารด้วยค่าเบี่ยงเบนมาตรฐาน (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