

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน
อีสท์สปริง (ประเทศไทย) จำกัด

ข้อมูล ณ วันที่ 31 ตุลาคม 2565

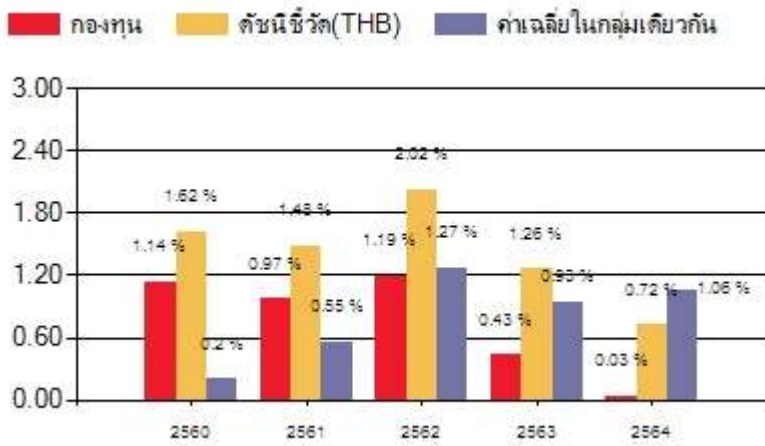
ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

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

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- ลงทุนในเงินฝาก ตราสารแห่งหนึ่ง หรือกรรมทางการเงิน 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	0.35	0.15	0.23	0.40
ดัชนีชี้วัด (THB)	0.56	0.21	0.35	0.68
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	0.25	0.10	0.17	0.30
ความผันผวนกองทุน	0.04	0.04	0.05	0.04
ความผันผวนดัชนีชี้วัด (THB)	0.05	0.05	0.06	0.05

	3 ปี	5 ปี	10 ปี	ตั้งแต่จัดตั้ง
กองทุน	0.33	0.63	1.16	1.67
ดัชนีชี้วัด (THB)	0.97	1.26	1.19	1.32
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	0.39	0.65	1.16	-
ความผันผวนกองทุน	0.05	0.06	0.08	0.13
ความผันผวนดัชนีชี้วัด (THB)	0.18	0.52	0.37	0.27

ระดับความเสี่ยง

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

คำอธิบาย

ลงทุนในเงินฝาก ตราสารเทียบเท่าเงินฝาก พันธบัตรรัฐบาล หรือ พันธบัตร รัฐบาล. ซึ่งมีอายุไม่เกิน 397 วัน โดยไม่มีความเสี่ยงต่างประเทศ

ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน	12 ก.ค. 2545
วันเริ่มต้น class	-
นโยบายการจ่ายเงินปันผล	ไม่มีนโยบายจ่ายเงินปันผล
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 มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต: ได้รับการรับรองจาก CAC

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	0.6960	0.1500
รวมค่าใช้จ่าย	2.1400	1.3650

หมายเหตุ: สามารถดูค่าธรรมเนียมอื่นๆ เพิ่มเติมได้ที่หนังสือชี้ชวนส่วนข้อมูลกองทุนรวม

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: ค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายเป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม หรือภาษีอื่นใด (ถ้ามี)

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน

ชื่อประเภททรัพย์สิน	% NAV
หุ้นกู้	63.86
พันธบัตร	20.73
ตัวแลกเปลี่ยน+ตัวสัญญาใช้เงิน	6.64
เงินฝากและอื่นๆ	5.99
ตัวเงินคลัง	2.77

ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก

ชื่อหลักทรัพย์	% NAV
บริษัท ควอลิตี้ เฮาส์ จำกัด (มหาชน) (QH22NA)	8.97
บริษัท แผ่นดินทอง พร็อพเพอร์ตี้ ดีเวลลอปเม้นท์ จำกัด (มหาชน) (GOLD22NA)	8.42
บริษัท ซีเคพาวเวอร์ จำกัด (มหาชน) (CKP22NA)	6.73
บริษัท เอพี (ไทยแลนด์) จำกัด (มหาชน) (AP235A)	6.67
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย (CB22D15A)	6.65

ข้อมูลเชิงสถิติ

Maximum Drawdown	-0.04%
Recovering Period	2 เดือน
อายุเฉลี่ยของตราสารหนี้	1 เดือน 19 วัน
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน	115.59%
Yield to Maturity	1.29%

การจัดสรรการลงทุนในผู้ออกตราสาร 5 อันดับแรก

ชื่อผู้ออกตราสาร	% NAV
ธนาคารแห่งประเทศไทย	20.73
บริษัท ควอลิตี้ เฮาส์ จำกัด (มหาชน)	8.97
บริษัท แผ่นดินทอง พร็อพเพอร์ตี้ ดีเวลลอปเม้นท์ จำกัด (มหาชน)	8.42
บริษัท พกษา โฮลดิ้ง จำกัด (มหาชน)	7.41
บริษัท ซีเค พาวเวอร์ จำกัด (มหาชน)	6.73

การจัดสรรการลงทุนตามอันดับความน่าเชื่อถือ (%)

ผู้ออก	ในประเทศ	national	international
Gov bond / AAA	62.57		
AA	4.63		
A	29.62		
BBB			
ต่ำกว่า BBB			
Unrated / non			

ผู้จัดการกองทุนรวม

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

น.ส. วิภาสิริ เกษมสุข (ตั้งแต่ 12 ก.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 เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาตั้งแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินลงทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลานานเท่าใด

FX Hedging เปรอ์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลานึง 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 สูงกว่าจะเป็นกองทุนที่มีประสิทธิภาพในการบริหารจัดการการลงทุนที่ดีกว่า เนื่องจากได้รับผลตอบแทนส่วนเพิ่มที่สูงกว่าภายใต้ระดับความเสี่ยงเดียวกัน

Alpha ผลตอบแทนส่วนเกินของกองทุนรวมเมื่อเปรียบเทียบกับดัชนีชี้วัด (benchmark) โดยค่า Alpha ที่สูง หมายถึง กองทุนสามารถสร้างผลตอบแทนได้สูงกว่าดัชนีชี้วัด ซึ่งเป็นผลจากประสิทธิภาพของผู้จัดการกองทุนในการคัดเลือกหรือหาจังหวะการลงทุนในหลักทรัพย์ได้อย่างเหมาะสม

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 จึงสามารถนำไปใช้เปรียบเทียบอัตราผลตอบแทนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีนโยบายถือครองตราสาร หนี้จนครบกำหนดอายุและมีลักษณะการลงทุนที่ใกล้เคียงกันได้



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.