

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน  
อีสท์สปริง (ประเทศไทย) จำกัด

ข้อมูล ณ วันที่ 31 ตุลาคม 2565

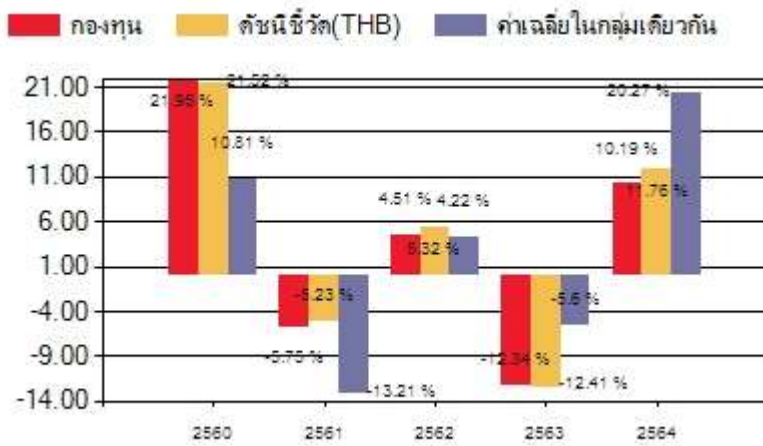
**ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม**

- กองทุนรวมตราสารทุน (Equity Fund)
- กองทุนรวมดัชนี (Index Fund)
- กลุ่ม SET 50 Index Fund

**นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน**

- ลงทุนในตราสารแห่งทุนของบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยที่เป็นส่วนประกอบของดัชนี SET50 เป็นหลัก โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของ NAV โดยบลจ.จะพยายามดำรงค่าความผันผวนของส่วนต่างของผลตอบแทนเฉลี่ยของกองทุนรวมและผลตอบแทนของดัชนีชี้วัด (tracking error : TE) : 3% ต่อปี
- มุ่งหวังให้ได้รับผลประโยชน์การเคลื่อนไหวตามดัชนีชี้วัด

**ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (% ต่อปี)**



**ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด (% ต่อปี)**

|                             | YTD   | 3 เดือน | 6 เดือน | 1 ปี  |
|-----------------------------|-------|---------|---------|-------|
| กองทุน                      | 2.50  | 3.19    | 0.75    | 4.20  |
| ดัชนีชี้วัด (THB)           | 1.47  | 3.26    | 0.80    | 3.19  |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน    | 2.20  | 3.09    | 0.50    | 3.77  |
| ความผันผวนกองทุน            | 11.14 | 9.48    | 11.14   | 11.45 |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด (THB) | 11.31 | 9.56    | 11.24   | 11.59 |

|                             | 3 ปี  | 5 ปี  | 10 ปี | ตั้งแต่จัดตั้ง |
|-----------------------------|-------|-------|-------|----------------|
| กองทุน                      | -0.47 | 0.22  | 3.77  | 4.12           |
| ดัชนีชี้วัด (THB)           | -0.30 | 0.58  | 4.18  | 4.58           |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน    | -0.74 | 0.09  | 3.63  | -              |
| ความผันผวนกองทุน            | 21.99 | 18.55 | 17.23 | 17.09          |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด (THB) | 22.27 | 18.78 | 17.40 | 17.26          |

**ระดับความเสี่ยง**

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

**คำอธิบาย**

ลงทุนในตราสารทุนเป็นหลักโดยเฉลี่ยในรอบปีไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV

**ข้อมูลกองทุนรวม**

|                        |                                   |
|------------------------|-----------------------------------|
| วันจดทะเบียนกองทุน     | 18 ก.ค. 2555                      |
| วันเริ่มต้น class      | -                                 |
| นโยบายการจ่ายเงินปันผล | จ่ายเงินปันผล ไม่เกินปีละ 2 ครั้ง |
| อายุกองทุน             | ไม่กำหนด                          |

**ดัชนีชี้วัด :**

1. ดัชนีผลตอบแทนรวม SET 50 (SET50 TRI) สัดส่วน 100% สำหรับผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด ผลการดำเนินงานน้อยกว่า 1 ปี คำนวณตามระยะเวลาจริง

**คำเตือน :**

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวม มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต: ได้รับการรับรองจาก CAC

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

ระยะเวลาชำระเงินค่าขายคืน: T+2

Remark : ปัจจุบันและในภาวะปกติจะชำระภายใน 2 วันทำการนับถัดจากวันที่คำสั่งขายสามารถดำเนินการได้

### ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)

| ค่าธรรมเนียม  | สูงสุดไม่เกิน | เก็บจริง |
|---------------|---------------|----------|
| การจัดการ     | 2.140         | 0.4280   |
| รวมค่าใช้จ่าย | 3.210         | 0.6500   |

หมายเหตุ: สามารถดูค่าธรรมเนียมอื่นๆ เพิ่มเติมได้ที่หนังสือชี้ชวนข้อมูลกองทุนรวม

### ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)

| ค่าธรรมเนียม                | สูงสุดไม่เกิน | เก็บจริง |
|-----------------------------|---------------|----------|
| การขาย                      | 1.070         | ยกเว้น   |
| การรับซื้อคืน               | 1.070         | ยกเว้น   |
| การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า | 1.070         | ยกเว้น   |
| การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก  | 1.070         | ยกเว้น   |
| การโอนหน่วย                 | 53.50         | 5        |

หมายเหตุ: 1. ค่าใช้จ่ายในการซื้อขายหลักทรัพย์ 0.15 ของมูลค่าที่สั่งซื้อขาย 2. ค่าโอน 5 บาท ต่อหน่วยลงทุน 1,000 หน่วย (คิดค่าธรรมเนียมขั้นต่ำ 100 บาท แต่ไม่เกิน 1,000 บาทต่อครั้ง) 3.

ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว (ถ้ามี)

### ข้อมูลเชิงสถิติ

|                            |         |
|----------------------------|---------|
| Maximum Drawdown           | -40.11% |
| Tracking Error             | 0.84%   |
| อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน | 27.27%  |

### การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม

| กลุ่มอุตสาหกรรม                | % NAV |
|--------------------------------|-------|
| พลังงานและสาธารณูปโภค          | 29.81 |
| ธนาคาร                         | 11.84 |
| ขนส่งและโลจิสติกส์             | 10.80 |
| เทคโนโลยีสารสนเทศและการสื่อสาร | 9.37  |
| พาณิชย์                        | 8.90  |

### สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน

| ชื่อประเภททรัพย์สิน | % NAV |
|---------------------|-------|
| หุ้นสามัญ           | 99.27 |
| เงินฝากและอื่นๆ     | 0.73  |

### ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก

| ชื่อหลักทรัพย์   | % NAV |
|--|-------|
| บริษัท ทำอากาศยานไทย จำกัด (มหาชน) (AOT)                     | 8.73  |
| บริษัท ปตท. จำกัด (มหาชน) (PTT)                              | 8.47  |
| บริษัท ปตท.สำรวจและผลิตปิโตรเลียม จำกัด (มหาชน) (PTTEP)      | 5.98  |
| บริษัท กัลฟ์ เอ็นเนอร์จี ดีเวลลอปเม้นท์ จำกัด (มหาชน) (GULF) | 4.93  |
| บริษัท แอดวานซ์ อินโฟร์ เซอร์วิส จำกัด (มหาชน) (ADVANC)      | 4.70  |

## ผู้จัดการกองทุนรวม

น.ส. พัชรภาภา มหัทธนนกุล ( ตั้งแต่ 28 มิ.ย. 2564 )

นาย ศตวรรษ ทัสน์ ( ตั้งแต่ 18 เม.ย. 2560 )

ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือบริหารความเสี่ยง

ด้านสภาพคล่องได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



[www.eastspring.co.th](http://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 สูงกว่าจะเป็นกองทุนที่มีประสิทธิภาพในการบริหารจัดการลงทุนที่ดีกว่า 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 จึงสามารถนำไปใช้เปรียบเทียบอัตราผลตอบแทนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีนโยบายถือครองตราสารหนี้จนครบกำหนดอายุและมีลักษณะการลงทุนที่ใกล้เคียงกันได้



[www.eastspring.co.th](http://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.