

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน  
อีสท์สปริง (ประเทศไทย) จำกัด

ข้อมูล ณ วันที่ 30 มิถุนายน 2022

ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- ▶ กองทุนรวมตราสารทุน (Equity Fund)
- ▶ กลุ่ม Equity Large Cap

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- ▶ ลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งหุ้นของบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์และ/หรือตลาดหลักทรัพย์เอ็ม เอไอ ที่มีปัจจัยพื้นฐานดี และ/หรือมีความมั่นคง และ/หรือมีแนวโน้มการเจริญเติบโตทางธุรกิจไม่เกิน 40 บริษัท โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของ NAV กองทุนอาจลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเพื่อเพิ่มประสิทธิภาพในการบริหารการลงทุน (EPM) รวมทั้งตราสารที่มีลักษณะของสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแบ่ง (Structured Note)
- ▶ มุ่งหวังให้ได้รับผลประโยชน์การเคลื่อนไหวสูงกว่าดัชนีชี้วัด

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (% ต่อปี)



ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบบัพทมูล (% ต่อปี)

|                             | YTD   | 3 เดือน | 6 เดือน | 1 ปี  |
|-----------------------------|-------|---------|---------|-------|
| กองทุน                      | -1.96 | -4.92   | -1.96   | 1.27  |
| ดัชนีชี้วัด (THB)           | -2.53 | -6.17   | -2.53   | 2.38  |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน    | -3.98 | -5.92   | -3.98   | 2.54  |
| ความผันผวนกองทุน            | 12.04 | 12.09   | 12.04   | 12.32 |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด (THB) | 12.40 | 12.78   | 12.40   | 12.29 |

  

|                             | 3 ปี  | 5 ปี | 10 ปี | ตั้งแต่จัดตั้ง |
|-----------------------------|-------|------|-------|----------------|
| กองทุน                      | -6.38 | -    | -     | -3.59          |
| ดัชนีชี้วัด (THB)           | -3.58 | -    | -     | 0.23           |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน    | -2.82 | -    | -     | -              |
| ความผันผวนกองทุน            | 20.11 | -    | -     | 17.33          |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด (THB) | 22.33 | -    | -     | 19.12          |

ระดับความเสี่ยง

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

คำอธิบาย

ลงทุนในตราสารทุนเป็นหลักโดยเฉลี่ยในรอบปีไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม

|                        |                                     |
|------------------------|-------------------------------------|
| วันจดทะเบียนกองทุน     | 27 ก.ย. 2560                        |
| วันเริ่มต้น class      | -                                   |
| นโยบายการจ่ายเงินปันผล | จ่ายเงินปันผล ไม่เกินปีละ 4 ครั้ง   |
| อายุกองทุน             | ไม่มีกำหนดระยะเวลาสิ้นสุดของโครงการ |

ดัชนีชี้วัด :

1. ดัชนีผลตอบแทนรวม SET 50 (SET50 TRI) สัดส่วน 100%

คำเตือน :

- ▶ การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ▶ ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวม มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต: ได้รับการรับรองจาก CAC

จัดอันดับกองทุน Morningstar ★

## การซื้อขายหน่วยลงทุน

วันทำการซื้อ:

เวลาทำการ: 08:30 น.-15:30 น.

การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ: 500000 บาท

การซื้อครั้งถัดไปขั้นต่ำ: 1000 บาท

## การขายคืนหน่วยลงทุน

วันทำการขายคืน:

เวลาทำการ: 08:30 น.-15:30 น.

การขายคืนขั้นต่ำ: 1000 บาท

ยอดคงเหลือขั้นต่ำ: ไม่กำหนด บาท

ระยะเวลาชำระเงินค่าขายคืน: T+2

หมายเหตุ: 1.T+2 คือ 2 วันทำการหลังจากวันทำการขายคืน 2.เปิดรับคำสั่งซื้อและขายคืน ทุก 5 วันทำการแรกของเดือนมกราคม เมษายน กรกฎาคม และตุลาคม

## ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)

| ค่าธรรมเนียม  | สูงสุดไม่เกิน | เก็บจริง |
|---------------|---------------|----------|
| การจัดการ     | 2.675         | 2.139    |
| รวมค่าใช้จ่าย | 5.350         | 2.699    |

หมายเหตุ: สามารถดูค่าธรรมเนียมอื่นๆ เพิ่มเติมได้ที่หนังสือชี้ชวนส่วนข้อมูลกองทุนรวม

## ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)

| ค่าธรรมเนียม                 | สูงสุดไม่เกิน   | เก็บจริง |
|------------------------------|---|----------|
| การขาย                       | 1.070   | 1.070%   |
| การรับซื้อคืน                | 0.535   | ยกเว้น   |
| การเปลี่ยนแปลงหน่วยลงทุนเข้า | กรณีกองทุนนี้เป็นกองทุนต้นทาง อัตราเดียวกับค่าธรรมเนียมการรับซื้อคืนหน่วยลงทุน กรณีกองทุนนี้เป็นกองทุนปลายทาง อัตราเดียวกับค่าธรรมเนียมการขายหน่วยลงทุน | ยกเว้น   |
| การเปลี่ยนแปลงหน่วยลงทุนออก  | ไม่มี   | ยกเว้น   |
| การโอนหน่วย                  | 53.50   | 5        |

หมายเหตุ: 1.ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว (ถ้ามี) 2. ค่าโอน 5 บาท ต่อหน่วยลงทุน 1,000 หน่วย (คิดค่าธรรมเนียมขั้นต่ำ 100 บาท แต่ไม่เกิน 1,000 บาท ต่อครั้ง)

## สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน

| ชื่อประเภททรัพย์สิน | % NAV |
|---------------------|-------|
| หุ้นสามัญ           | 95.59 |
| เงินฝากและอื่นๆ     | 4.42  |

## ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก

| ชื่อหลักทรัพย์  | % NAV |
|---|-------|
| บริษัท ท่าอากาศยานไทย จำกัด (มหาชน) (AOT)               | 8.92  |
| บริษัท ปตท. จำกัด (มหาชน) (PTT)                         | 8.46  |
| บริษัท ปตท.สำรวจและผลิตปิโตรเลียม จำกัด (มหาชน) (PTTEP) | 5.43  |
| บริษัท แอดวานซ์ อินโฟร์ เซอร์วิส จำกัด (มหาชน) (ADVANC) | 5.16  |
| บริษัท ซี.พี. ออลล์ จำกัด (มหาชน) (CPALL)               | 4.96  |

## ข้อมูลเชิงสถิติ

|                            |         |
|----------------------------|---------|
| Maximum Drawdown           | -42.98% |
| Sharpe Ratio               | -0.25   |
| Alpha                      | -2.80   |
| Beta                       | 0.90%   |
| อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน | 10.55%  |

## การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม

| กลุ่มอุตสาหกรรม                | % NAV |
|--------------------------------|-------|
| พลังงานและสาธารณูปโภค          | 27.97 |
| ธนาคาร                         | 11.32 |
| ขนส่งและโลจิสติกส์             | 11.10 |
| เทคโนโลยีสารสนเทศและการสื่อสาร | 9.26  |
| พาณิชย์                        | 9.12  |

## ผู้จัดการกองทุนรวม

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

นาย ศตวรรษ ทั่น ( ตั้งแต่ 27 ก.ย. 2560 )

ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือบริหารความเสี่ยง

ด้านสภาพคล่องได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



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

### คำอธิบาย

**Maximum Drawdown** เปรียบเทียบผลขาดทุนสูงสุดของกองทุนรวมในระยะเวลา 5 ปีย้อนหลัง (หรือตั้งแต่จัดตั้งกองทุนกรณีที่ยังไม่ครบ 5 ปี) โดยวัดจากระดับ NAV ต่อหน่วยที่จุดสูงสุดไปจนถึงจุดต่ำสุด ในช่วงที่ NAV ต่อหน่วยปรับตัวลดลง ค่า Maximum Drawdown เป็นข้อมูลที่จะช่วยให้ทราบถึงความเสี่ยงที่อาจขาดทุนจากการลงทุนในกองทุนรวม

**Recovering Period** ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาตั้งแต่ขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินลงทุนเริ่มต้นใช้เวลานานเท่าใด

**FX Hedging** เปรียบเทียบของกองทุนรวมในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

**อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน** ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลานึง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 1 ปีหารด้วยมูลค่า NAV ของกองทุนรวมเฉลี่ยในรอบระยะเวลาเดียวกัน กองทุนรวมที่มีค่า portfolio turnover สูง บ่งชี้ถึงการซื้อขายหลักทรัพย์บ่อยครั้งของผู้จัดการกองทุนและทำให้มีต้นทุนการซื้อขายหลักทรัพย์ที่สูง จึงต้องพิจารณาเปรียบเทียบกับผลการดำเนินงานของกองทุนรวมเพื่อประเมิน ความคุ้มค่าของการซื้อขายหลักทรัพย์ดังกล่าว

**Sharpe Ratio** อัตราส่วนระหว่างผลตอบแทนส่วนเพิ่มของกองทุนรวมเปรียบเทียบกับความเสี่ยงจากการลงทุน โดยคำนวณจากผลต่างระหว่างอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมกับ อัตราผลตอบแทนที่ปราศจากความเสี่ยง (risk-free rate) เปรียบเทียบกับค่าเบี่ยงเบนมาตรฐาน (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 ของตราสารหนี้แต่ละตัวที่กองทุนมี การลงทุน 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.