

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน
อีสท์สปริง (ประเทศไทย) จำกัด

ข้อมูล ณ วันที่ 30 มิถุนายน 2022

ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- ▶ กองทุนรวมผสม (Mixed Fund)
- ▶ กลุ่ม Moderate Allocation

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- ▶ กองทุนจะลงทุนในตราสารแห่งทุน ตราสารกึ่งหนี้กึ่งทุน ตราสารแห่งหนี้ และหรือเงินฝากรวมทั้งหลักทรัพย์และทรัพย์สินอื่น โดยมีสัดส่วนการลงทุนในตราสารแห่งทุนขึ้นอยู่กับความคิดเห็นของ บริษัทจัดการและตามความเหมาะสมกับสภาพการณ์และสภาพตลาด ในแต่ละขณะเพื่อให้สอดคล้องกับวัตถุประสงค์ของโครงการ
- ▶ มุ่งหวังให้ได้รับผลประโยชน์การเคลื่อนไหวสูงกว่าดัชนีชี้วัด

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (% ต่อปี)



ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด (% ต่อปี)

	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี
กองทุน	-2.35	-3.66	-2.35	-0.51
ดัชนีชี้วัด (THB)	-3.07	-4.26	-3.07	-0.55
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	-6.07	-4.77	-6.07	-4.48
ความผันผวนกองทุน	0.44	0.43	0.44	0.42
ความผันผวนดัชนีชี้วัด (THB)	0.44	0.45	0.44	0.42

	3 ปี	5 ปี	10 ปี	ตั้งแต่จัดตั้ง
กองทุน	-4.22	0.73	2.66	2.66
ดัชนีชี้วัด (THB)	0.29	2.31	4.34	4.37
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	-1.16	0.77	3.20	-
ความผันผวนกองทุน	13.31	11.22	10.59	10.61
ความผันผวนดัชนีชี้วัด (THB)	10.27	8.57	7.97	7.99

ระดับความเสี่ยง									
ต่ำ	1	2	3	4	5	6	7	8	สูง
คำอธิบาย									
ลงทุนในตราสารทุน ตราสารหนี้ และ/หรือทรัพย์สินทางเลือก โดยมีสัดส่วนการลงทุนในตราสารทุนน้อยกว่า 80% ของ NAV									
ข้อมูลกองทุนรวม									
วันจดทะเบียนกองทุน	10 เม.ย. 2555								
วันเริ่มต้น class	-								
นโยบายการจ่ายเงินปันผล	ไม่มีนโยบายจ่ายเงินปันผล								
อายุกองทุน	ไม่กำหนด								

ดัชนีชี้วัด :

1. ดัชนีผลตอบแทนรวมตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET TRI) สัดส่วน 50%
2. ดัชนีผลตอบแทนรวมของกองทุนรวมอสังหาริมทรัพย์และกองทุนทรัสต์เพื่อการลงทุนในอสังหาริมทรัพย์ (PF&REIT Total Return Index) สัดส่วน 15%
3. อัตราอ้างอิง THBFIX สำหรับรอบระยะเวลา 1 ปี สัดส่วน 15%
4. ผลตอบแทนรวมสุทธิของดัชนีตราสารหนี้ภาคเอกชน Mark-to-Market ที่มีอันดับความน่าเชื่อถือของผู้ออกตราสารอยู่ในระดับ BBB ขึ้นไป อายุ 1 - 3 ปี ของสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย สัดส่วน 10%
5. ผลตอบแทนรวมสุทธิของดัชนีพันธบัตรรัฐบาล Mark-to-Market อายุไม่ต่ำกว่าเท่ากับ 10 ปี ของสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย สัดส่วน 10%

คำเตือน :

- ▶ การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ▶ ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวม มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต: ได้รับการรับรองจาก CAC
จัดอันดับกองทุน Morningstar ★★ ★

การซื้อขายหน่วยลงทุน

วันทำการซื้อ: ทุกวันทำการ

เวลาทำการ: 08:30 น.-15:30 น.

การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ: 1 บาท

การซื้อครั้งถัดไปขั้นต่ำ: 1 บาท

หมายเหตุ: ปัจจุบันและในภาวะปกติจะชำระภายใน 2 วันทำการนับถัดจากวันที่คำสั่งขายสามารถดำเนินการได้

การขายคืนหน่วยลงทุน

วันทำการขายคืน: ทุกวันทำการ

เวลาทำการ: 08:30 น.-15:30 น.

การขายคืนขั้นต่ำ: 1 บาท

ยอดคงเหลือขั้นต่ำ: ไม่กำหนด บาท

ระยะเวลารับเงินค่าขายคืน: T+2

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	1.6050	1.3375
รวมค่าใช้จ่าย	1.9795	1.5599

หมายเหตุ: สามารถดูค่าธรรมเนียมอื่นๆ ได้ในหนังสือชี้ชวนส่วนข้อมูลกองทุนรวม

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การขาย	1.50	0.50
การรับซื้อคืน	ไม่มี	ไม่มี
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า	1.50	0.50
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก	ไม่มี	ไม่มี
การโอนหน่วย	5	5

หมายเหตุ: 1. ส่วนต่างมูลค่าหน่วยลงทุน (Spread) ไม่เกิน 0.75% ปัจจุบันไม่เรียกเก็บ 2. ค่าโอน 5 บาท ต่อหน่วยลงทุน 1,000 หน่วย (คิดค่าธรรมเนียมขั้นต่ำ 100 บาท แต่ไม่เกิน 1,000 บาทต่อครั้ง)

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน

ชื่อประเภททรัพย์สิน	% NAV
หุ้นสามัญ	48.96
หุ้นกู้	24.93
กองทรัสต์เพื่อการลงทุนในอสังหาริมทรัพย์	9.20
รายการอื่นๆ	9.09
พันธบัตร	7.82

ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก

ชื่อหลักทรัพย์สิน	% NAV
พันธบัตรรัฐบาลเพื่อการปรับโครงสร้างหนี้ (พ.ร.ก. ช่วยเหลือกองทุนฟื้นฟู ระยะที่ 2) ในปีงบประมาณ พ.ศ. 2560 ครั้งที่ 3	7.82
หุ้นกู้บริษัทปูนซิเมนต์ไทย จำกัด (มหาชน) ครั้งที่ 2/2560 ครบกำหนดได้ก่อน ปี พ.ศ. 2567	5.33
หุ้นกู้ของบริษัท น้ำตาลมิตรผล จำกัด ครั้งที่ 1/2556 ครบกำหนดได้ก่อนปี พ.ศ. 2566	4.53
บริษัท ท่าอากาศยานไทย จำกัด (มหาชน)	4.28
บริษัท ปตท. จำกัด (มหาชน)	4.09

ข้อมูลเชิงสถิติ

Maximum Drawdown	-28.61%
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน	17.28%

การจัดสรรการลงทุนในผู้ออกตราสาร 5 อันดับแรก

ชื่อผู้ออกตราสาร	% NAV
กระทรวงการคลัง	7.82
บริษัท ปูนซิเมนต์ไทย จำกัด (มหาชน)	5.33
บริษัท น้ำตาลมิตรผล จำกัด	4.53
บริษัท โฮม โปรดักส์ เซ็นเตอร์ จำกัด (มหาชน)	3.52
บริษัท เอพี (ไทยแลนด์) จำกัด (มหาชน)	3.20

การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม

กลุ่มอุตสาหกรรม	% NAV
พลังงานและสาธารณูปโภค	14.49
กองทุนรวมอสังหาริมทรัพย์และกองทรัสต์เพื่อการลงทุนในอสังหาริมทรัพย์	12.02
เทคโนโลยีสารสนเทศและการสื่อสาร	8.49
ธนาคาร	5.76
ขนส่งและโลจิสติกส์	5.67

ผู้จัดการกองทุนรวม

น.ส. ดารารัตน์ ประกายทิพย์ (ตั้งแต่ 18 พ.ค. 2564)

ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือบริหารความเสี่ยง

ด้านสภาพคล่องได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



www.eastspring.co.th

คำอธิบาย

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

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

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.