

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน  
อีสท์สปริง (ประเทศไทย) จำกัด

ข้อมูล ณ วันที่ 28 มีนาคม 2566

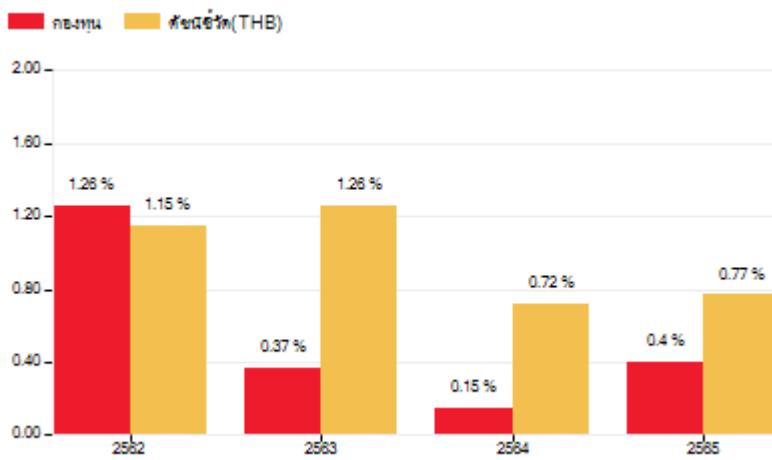
### ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- ▶ กองทุนรวมตราสารหนี้ (Fixed Income Fund)
- ▶ กองทุนรวมตลาดเงิน (Money Market Fund)
- ▶ กองลุ่ม Money Market Government

### นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- ▶ ลงทุนในเงินฝาก ตราสารหนี้ภาครัฐ และตราสารหนี้ภาคเอกชนชั้นดี ในประเทศไทย อันดับความน่าเชื่อถือระดับสูง อันดับแรก ในระดับ National Scale และ/หรือ มีอันดับความน่าเชื่อถือระดับสูง อันดับแรกในระดับ International Scale เป็นต้น
- ▶ มุ่งหวังให้ได้รับผลประกอบการเคลื่อนไหวสูงกว่าดัชนีชี้วัด

### ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (%) ต่อปี)



### ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบบวกหมุด (%)ต่อปี)

	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี
กองทุน	1.45	0.45	0.87	1.46
ดัชนีชี้วัด (THB)	1.86	0.64	1.13	1.87
ความผันผวนกองทุน	0.07	0.08	0.08	0.07
ความผันผวนดัชนีชี้วัด (THB)	0.11	0.12	0.11	0.11
	3 ปี	5 ปี	10 ปี	ตั้งแต่จัดตั้ง
กองทุน	0.67	0.73	0.99	3.09
ดัชนีชี้วัด (THB)	1.12	1.15	1.07	2.13
ความผันผวนกองทุน	0.06	0.05	0.06	0.35
ความผันผวนดัชนีชี้วัด (THB)	0.08	0.08	0.07	0.19

ระดับความเสี่ยง								
ต่ำ	1	2	3	4	5	6	7	สูง
คำอธิบาย								
ลงทุนในเงินฝาก ตราสารเตียบเท่าเงินฝาก พันธบัตรรัฐบาล หรือ พันธบัตร ธปท. โดยไม่มีความเสี่ยงต่างประเทศ								

### ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน	-
วันเริ่มต้น class	-
นโยบายการจ่ายเงินปันผล	ไม่มีนโยบายการจ่ายเงินปันผล
การรับซื้อด้วยหุ้นอัตโนมัติ	-
อายุกองทุน	ไม่กำหนด

### ดัชนีชี้วัด :

- ดัชนีตราสารหนี้ภาคเอกชนรายสัปดาห์ (ThaiBMA Commercial Paper Index) ที่มีอันดับความน่าเชื่อถือของผู้ออกตราสารอยู่ในระดับ A- ขึ้นไป ของสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย สัดส่วน 50%
  - ผลตอบแทนรวมของดัชนีพันธบัตรรัฐบาลรายสัปดาห์ของสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย สัดส่วน 50%
- สำหรับผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบบวกหมุด ผลการดำเนินงานน้อยกว่า 1 ปี คำนวณตามระยะเวลาจริง

### คำเตือน :

- ▶ การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ▶ ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวม มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต: มีบิรชัพแม่ค้าและให้กำกับกฎหมาย

## การซื้อขายหลักทรัพย์

วันทำการซื้อ : ทุกวันทำการ

เวลาทำการ : 08:30 น. - 15:30 น.

การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ : 1 บาท

การซื้อครั้งต่อไปขั้นต่ำ : 1 บาท

## การขายคืนหลักทรัพย์

วันทำการขายคืน : ทุกวันทำการ

เวลาทำการ : 08:30 น. - 15:30 น.

การขายคืนขั้นต่ำ : 1 บาท

ยอดคงเหลือขั้นต่ำ : ไม่กำหนด

ระยะเวลารับเงินค่าขายคืน : T+1

Remark : บัญชีและในภาวะปกติจะนำรายได้ 1 วันทำการนับตั้งจากวันที่คำสั่งขายสามารถดำเนินการได้

## ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	0.7500	0.0500
รวมค่าใช้จ่าย	0.9500	0.1810

หมายเหตุ : รวมค่าใช้จ่ายของรอบปีบัญชี 1 พ.ค. 65 ถึง 30 เม.ย. 66

## ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหุ้น (% ของมูลค่าซื้อขาย)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การขาย	ไม่มี	ยกเว้น
การรับคืน	ไม่มี	ยกเว้น
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า	ไม่มี	ยกเว้น
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก	ไม่มี	ยกเว้น
การโอนหน่วย	5	5

หมายเหตุ : ค่าโอน 5 บาท ต่อน่วยลงทุน 1,000 หน่วย

## สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน

ชื่อประเภททรัพย์สิน	% NAV
พันธบัตร	63.78
ตัวเลกเงินแบบมีระยะเวลา (BE Term)	18.81
เงินฝากธนาคารประจำกองทุนทรัพย์	6.69
เงินฝากธนาคารประจำ	5.94
รายการอื่นๆ	4.78

## ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก

ชื่อหลักทรัพย์	% NAV
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 44/91/66	14.94
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 47/91/66	10.21
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 50/91/66	6.73
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 9/FRB182/66	5.61
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 8/FRB182/66	4.55

## ข้อมูลเชิงสถิติ

Maximum Drawdown	0.00%
Recovering Period	1 เดือน
อายุเฉลี่ยของตราสารหนี้	2 เดือน 4 วัน
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน	40.69%
Yield to Maturity	2.27%

## การจัดสรรการลงทุนในผู้ออกตราสาร 5 อันดับแรก

ชื่อผู้ออกตราสาร	% NAV
ธนาคารแห่งประเทศไทย	63.78
บริษัท บีทีเอส กรุ๊ป โปรดิ้งส์ จำกัด (มหาชน)	7.28
ธนาคารอาคารสงเคราะห์	5.94
บริษัท ศีพีเอฟ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)	5.92
กระทรวงการคลัง	3.58

## การจัดสรรการลงทุนตามอันดับความน่าเชื่อถือ (%)

ผู้ออก	ในประเทศ	national	international
Gov bond / AAA	67.36		
AA	5.54		
A	15.44		
BBB			
ต่ำกว่า BBB			
Unrated / non			

## ผู้จัดการกองทุนรวม

นาย อีรัศศันส์ ทุติยบุตรพิธิ

( ตั้งแต่ 09 พ.ค. 2552 )

ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือบริหารความเสี่ยง  
ด้านสภาพคล่องได้ในหนังสือชี้ข้อบัญชีเต็ม



www.eastspring.co.th

### คำอธิบาย

Maximum Drawdown เปอร์เซ็นต์ผลขาดทุนสูงสุดของกองทุนรวมในระยะเวลา 5 ปีก่อนหลัง (หรือตั้งแต่จัดตั้งกองทุนกรณีที่ยังไม่ครบ 5 ปี) โดยวัดจากระดับ NAV ต่อหน่วยที่จุดสูงสุดไปจนถึงจุดต่ำสุดในช่วงที่ NAV ต่อหน่วยปรับตัวลดลง ค่า Maximum Drawdown เป็นข้อมูลที่ช่วยให้ทราบถึงความเสี่ยงที่อาจขาดทุนจากการลงทุนในกองทุนรวม

Recovering Period ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาตั้งแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลาเท่าไร

FX Hedging เปอร์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตกองทุนในช่วงเวลาหนึ่ง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ากว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 1 ปีหารด้วยมูลค่า NAV ของกองทุนรวมเฉลี่ยในรอบระยะเวลาเดียวกัน กองทุนรวมที่มีค่า portfolio turnover สูง บ่งชี้ถึงการซื้อขายหลักทรัพย์บ่อยครั้งของผู้จัดการกองทุนและทำให้มีต้นทุนการซื้อขายหลักทรัพย์ที่สูง จึงต้องพิจารณาเปรียบเทียบกับผลการดำเนินงานของกองทุนรวมเพื่อประเมินความคุ้มค่าของการซื้อขายหลักทรัพย์ดังกล่าว

Sharpe Ratio อัตราส่วนระหว่างผลตอบแทนส่วนเพิ่มของกองทุนรวมเปรียบเทียบกับความเสี่ยงจากการลงทุน โดยคำนวณจากผลต่างระหว่างอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมกับอัตราผลตอบแทนที่ปราศจากความเสี่ยง (risk-free rate) เปรียบเทียบกับค่าเบี่ยงเบนมาตรฐาน (standard deviation) ของกองทุนรวม ค่า Sharpe Ratio สะท้อนถึงอัตราผลตอบแทนที่กองทุนรวมควรได้รับเพิ่มขึ้นเพื่อทดเชิงกับความเสี่ยงที่กองทุนรวมรับมา โดยกองทุนรวมที่มีค่า Sharpe Ratio สูงกว่าจะเป็นกองทุนที่มีประสิทธิภาพในการบริหารจัดการลงทุนที่ดีกว่า เนื่องจากได้รับผลตอบแทนส่วนเพิ่มที่สูงกว่าภายในระยะเวลาที่เทียบกัน

Alpha ผลตอบแทนส่วนเกินของกองทุนรวมเมื่อเปรียบเทียบกับดัชนีชี้วัด (benchmark) โดยค่า Alpha ที่สูง หมายถึง กองทุนสามารถสร้างผลตอบแทนได้สูงกว่าดัชนีชี้วัด ซึ่งเป็นผลจากประสิทธิภาพของผู้จัดการกองทุนในการคัดเลือกหุ้นหรือห้างห้างขนาดใหญ่ที่ได้อย่างเหมาะสม

Beta ระดับและทิศทางการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุน โดยเปรียบเทียบกับอัตราการเปลี่ยนแปลงของตลาด Beta น้อยกว่า 1 แสดงว่า หลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนมากกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด Beta มากกว่า 1 แสดงว่า หลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนมากกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด

Tracking Error อัตราผลตอบแทนของกองทุนเมื่อเปรียบเทียบกับดัชนีชี้วัด โดยหาก tracking error ต่ำ หมายถึงกองทุนรวมมีประสิทธิภาพในการสร้างผลตอบแทนให้ใกล้เคียงกับดัชนีชี้วัด กองทุนรวมที่มีค่า tracking error สูง จะมีอัตราผลตอบแทนโดยเฉลี่ยห่างจากดัชนีชี้วัดมากขึ้น

Yield to Maturity อัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในตราสารหนี้โดยตีอัตราดอกเบี้ยที่จะได้รับในอนาคตลดลงตามคาดการณ์ นำมายกกำกับด้วยตัวที่อยู่ในสูตร  $y = \frac{C}{P} + \frac{(P - P_0)}{P} \cdot \frac{1}{n}$  ลักษณะของค่า YTD คือค่าเฉลี่ยต่อปี คำนวณจากค่าเฉลี่ยต่อปีของ YTD ของตราสารหนี้แต่ละตัวที่กองทุนมีการลงทุน และเนื่องจาก Yield to Maturity มีหน่วยมาตราฐานเป็นเปอร์เซ็นต์ต่อปี จึงสามารถนำไปใช้เปรียบเทียบอัตราผลตอบแทนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีนโยบายอีโคครองตราสารหนี้จันทร์ กำหนดอายุและมีลักษณะการลงทุนที่ใกล้เคียงกันได้



www.eastspring.co.th

บริษัทหลักทรัพย์จดการกองทุน อีสท์สปริง (ประเทศไทย) จำกัด  
ชั้น 9 อาคาร มิตราทาวน์ อพาร์ทเม้นท์ ทาวเวอร์ 944 ถนนพระราม 4  
แขวงวังใหม่ เขตปทุมวัน กรุงเทพมหานคร 10330

| ศูนย์ที่ปรึกษาการลงทุน 1725 | ผู้สนับสนุนการขายและรับซื้อคืนหน่วยลงทุน ที่ได้รับการแต่งตั้ง