

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน
อีสปริง (ประเทศไทย) จำกัด

ข้อมูล ณ วันที่ 31 พฤษภาคม 2567

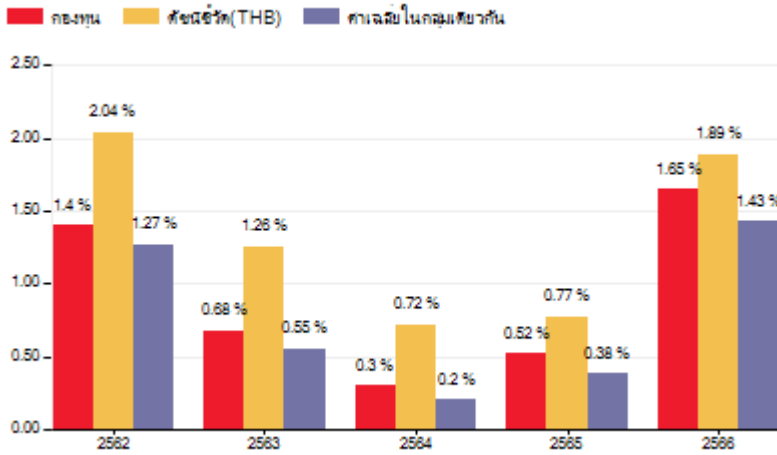
ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมตราสารหนี้ (Fixed Income Fund)
- กองทุนรวมตลาดเงิน (Money Market Fund)
- กลุ่ม Money Market General

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- ลงทุนในเงินฝาก ตราสารแห่งหนี้ รัฐกรรมทางการเงิน หรือตราสารทางการเงินอื่นใดที่มีกำหนดวันชำระหนี้ตาม ตราสารเมื่อทวงถามหรือเมื่อได้เห็น หรือไม่เกิน 397 วัน นับแต่วันที่ลงทุนในทรัพย์สินหรือเข้าทำสัญญา โดยกองทุนกำหนดอายุถ่วงเฉลี่ยแบบถ่วงน้ำหนักของกระแสเงินที่จะได้รับจากทรัพย์สินที่กองทุนรวมลงทุนหรือมีไว้ (Portfolio Duration) ในขณะใด ๆ น้อยกว่าหรือเท่ากับ 92 วัน
- กลยุทธ์การลงทุน : มุ่งหวังให้ได้รับผลประกอบการเคลื่อนไหวสูงกว่าดัชนีชี้วัด

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (% ต่อปี)



ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด (% ต่อปี)

	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี
กองทุน	0.93	0.56	1.08	2.10
ดัชนีชี้วัด (THB)	1.07	0.62	1.23	2.37
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	0.85	0.51	1.00	1.88
ความผันผวนกองทุน	0.10	0.10	0.10	0.09
ความผันผวนดัชนีชี้วัด (THB)	0.11	0.11	0.11	0.11

	3 ปี	5 ปี	10 ปี	ตั้งแต่จัดตั้ง
กองทุน	1.09	0.97	1.17	1.84
ดัชนีชี้วัด (THB)	1.37	1.39	1.30	1.42
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	0.94	0.83	1.02	-
ความผันผวนกองทุน	0.08	0.08	0.07	0.12
ความผันผวนดัชนีชี้วัด (THB)	0.12	0.50	0.37	0.28

ระดับความเสี่ยง

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

คำอธิบาย

ลงทุนในเงินฝาก ตราสารเทียบเท่าเงินฝาก พันธบัตรรัฐบาล หรือ พันธบัตร ธปท. ซึ่งมีอายุไม่เกิน 397 วัน โดยไม่มีความเสี่ยงต่างประเทศ

ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน	31 ส.ค. 2548
วันเริ่มต้น class	-
นโยบายการจ่ายเงินปันผล	ไม่มีนโยบายจ่ายเงินปันผล
การรับซื้อคืนหน่วยลงทุนอัตโนมัติ	-
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: มีบริษัทแม่ดูแลให้ทำตามกฎหมาย

ชื่อเดิม : กองทุนเปิดธนาชาติบริหารเงิน (T-CASH)

ชื่อใหม่ : กองทุนเปิดอีสปริง บริหารเงิน (ES-CASH)

เปลี่ยนแปลงชื่อกองทุนมีผลตั้งแต่วันที่ 17 มิถุนายน 2567 เป็นต้นไป

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	0.321	0.214
รวมค่าใช้จ่าย	1.605	0.326

หมายเหตุ: รวมค่าใช้จ่ายของรอบปีบัญชี วันที่ 1 ต.ค 64 - 30 ก.ย. 65

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าหน่วยลงทุน)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การขาย	ไม่มี	ไม่มี
การรับซื้อคืน	ไม่มี	ไม่มี
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า	ไม่มี	ไม่มี
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก	ไม่มี	ไม่มี
การโอนหน่วย	53.50	5

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน

ชื่อประเภททรัพย์สิน	% NAV
ตัวแลกเปลี่ยน+ตัวสัญญาใช้เงิน	66.13
พันธบัตร	33.68
หุ้นกู้	1.16
ตัวเงินคลัง	0.60
เงินฝากและอื่นๆ	-1.57

ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก

ชื่อหลักทรัพย์	% NAV
บริษัท บางจาก ศรีราชา จำกัด (มหาชน) (BSRC24604A)	7.74
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย (CB24620A)	7.33
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย (CB24808A)	6.38
บริษัท น้ำตาลมิตรผล จำกัด (MPSC24627A)	5.33
บริษัท แลนด์แอนด์เฮาส์ จำกัด (มหาชน) (LH24829A)	4.77

ข้อมูลเชิงสถิติ

Maximum Drawdown	-0.03%
Recovering Period	1 เดือน
อายุเฉลี่ยของตราสารหนี้	2 เดือน 1 วัน
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน	166.50%
Yield to Maturity	2.64%

การจัดสรรการลงทุนในผู้ออกตราสาร 5 อันดับแรก

ชื่อผู้ออกตราสาร	% NAV
ธนาคารแห่งประเทศไทย	33.68
บริษัท บางจาก ศรีราชา จำกัด (มหาชน)	7.74
บริษัท แลนด์ แอนด์ เฮาส์ จำกัด (มหาชน)	7.43
บริษัท หลักทรัพย์ เมย์แบงก์ จำกัด (มหาชน)	6.94
บริษัท เบทาโกร จำกัด (มหาชน)	6.92

การจัดสรรการลงทุนตามอันดับความน่าเชื่อถือ (%)

ผู้ออก	ในประเทศ	national	international
Gov bond / AAA	34.26		
AA	6.93		
A	56.07		
BBB	4.26		
ต่ำกว่า BBB			
Unrated/ non			

ผู้จัดการกองทุนรวม

นาย วิศิษฐ์ ชื่นรัตนกุล

(ตั้งแต่ 31 ส.ค. 2548)

น.ส. วิภาสิริ เกษมสุข

(ตั้งแต่ 31 ส.ค. 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 จึงต้องพิจารณาเปรียบเทียบกับการดำเนินงานของกองทุนรวมเพื่อประเมินความคุ้มค่าของการซื้อขายหลักทรัพย์ดังกล่าว

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 ระดับและทิศทางของการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุน 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

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน อีสท์สปริง (ประเทศไทย) จำกัด

ชั้น 9 อาคาร มิตรทาวน์ ออฟฟิศ ทาวเวอร์ 944 ถนนพระราม 4

แขวงวังใหม่ เขตปทุมวัน กรุงเทพมหานคร 10330

| ศูนย์ที่ปรึกษาการลงทุน 1725 | ผู้สนับสนุนการขายและรับซื้อคืนหน่วยลงทุน ที่ได้รับการแต่งตั้ง