

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน
อีส์ทีสปริง (ประเทศไทย) จำกัด

ข้อมูล ณ วันที่ 31 พฤษภาคม 2567

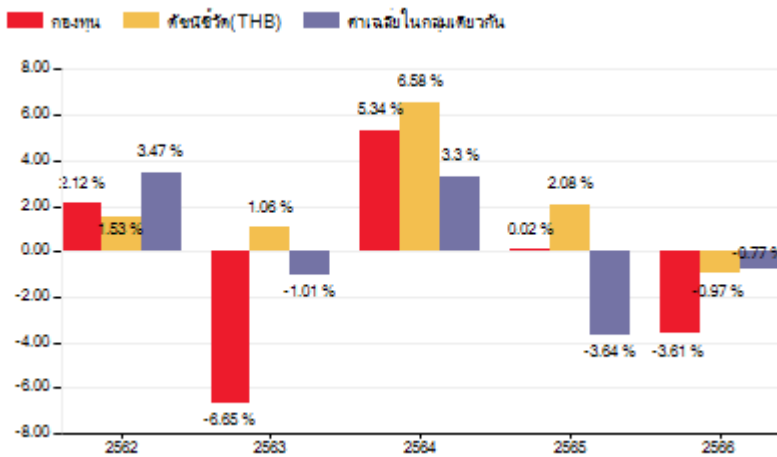
ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

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

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- ▶ ลงทุนในหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินได้หลายประเภท ได้แก่ ตราสารแห่งทุน ตราสารแห่งหนี้ ตราสารกึ่งหนี้กึ่งทุน หน่วยของกองโครงสร้างพื้นฐาน ซึ่งตราสารแห่งทุนจะพิจารณาลงทุนในขณะใด ๆ ไม่เกินร้อยละ 30 ของ NAV
- ▶ กลยุทธ์การลงทุน : มุ่งหวังให้ได้รับผลประกอบการเคลื่อนไหวสูงกว่าดัชนีชี้วัด

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (% ต่อปี)



ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปีกumul (% ต่อปี)

| | YTD | 3 เดือน | 6 เดือน | 1 ปี |
|-----------------------------|-------|---------|---------|-------|
| กองทุน | -0.36 | -0.08 | 0.48 | -1.88 |
| ดัชนีชี้วัด (THB) | 0.43 | 0.51 | 1.12 | 0.51 |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน | 0.41 | 0.18 | 1.54 | 0.34 |
| ความผันผวนกองทุน | 3.28 | 3.25 | 3.25 | 3.47 |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด (THB) | 2.10 | 2.12 | 2.07 | 2.30 |

| | 3 ปี | 5 ปี | 10 ปี | ตั้งแต่จัดตั้ง |
|-----------------------------|-------|-------|-------|----------------|
| กองทุน | -0.79 | -1.05 | - | 0.06 |
| ดัชนีชี้วัด (THB) | 1.45 | 1.80 | - | 2.14 |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน | -1.10 | 0.05 | - | - |
| ความผันผวนกองทุน | 3.19 | 4.63 | - | 4.22 |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด (THB) | 2.39 | 3.36 | - | 2.92 |

ระดับความเสี่ยง

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

คำอธิบาย

ลงทุนในตราสารทุน ตราสารหนี้ และกองทุนรวมโครงสร้างพื้นฐาน โดยมีสัดส่วนการลงทุนในตราสารทุนไม่เกิน 30% ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม

| | |
|----------------------------------|--------------------------|
| วันจดทะเบียนกองทุน | 03 พ.ค. 2559 |
| วันเริ่มต้น class | - |
| นโยบายการจ่ายเงินปันผล | ไม่มีนโยบายจ่ายเงินปันผล |
| การรับซื้อคืนหน่วยลงทุนอัตโนมัติ | ไม่เกินปีละ 2 ครั้ง |
| อายุกองทุน | ไม่กำหนด |

ดัชนีชี้วัด :

1. ดัชนีตราสารหนี้ภาครัฐระยะสั้น (Short-term Government Bond Index) สัดส่วน 40%
2. ดัชนีตราสารหนี้ภาคเอกชนที่มีอายุคงที่มีอันดับความน่าเชื่อถืออยู่ในระดับ A อายุ 1 ปี สัดส่วน 40%
3. ดัชนีผลตอบแทนรวมตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET TRI) สัดส่วน 20%

สำหรับผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปีกumul ผลการดำเนินงานน้อยกว่า 1 ปี คำนวณตามระยะเวลาจริง

คำเตือน :

- ▶ การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ▶ ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวม มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต: มีบริษัทแม่ดูแลให้ทำตามกฎหมาย

จัดอันดับกองทุน Morningstar ★★

ชื่อเดิม : กองทุนเปิดธนาชาตอพอพอร์ทูนิตี้ส์ มิกซ์ 70/30 (T-Mixed7030)

ชื่อใหม่ : กองทุนเปิดอีส์ทีสปริง Opportunities Mixed 70/30 (ES-MIXED7030)

เปลี่ยนแปลงชื่อกองทุนมีผลตั้งแต่วันที่ 17 มิถุนายน 2567 เป็นต้นไป

การซื้อขายหน่วยลงทุน

วันทำการซื้อ: ทุกวันทำการ

เวลาทำการ: 08:30 น. -15:30 น.

การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ: 1 บาท

การซื้อครั้งถัดไปขั้นต่ำ: 1 บาท

การขายคืนหน่วยลงทุน

วันทำการขายคืน: ทุกวันทำการ

เวลาทำการ: 08:30 น. -15:30 น.

การขายคืนขั้นต่ำ: 1 บาท

ยอดคงเหลือขั้นต่ำ: ไม่กำหนด

ระยะเวลาปรับเงินค่าขายคืน: T+2

Remark: ปัจจุบันและในภาวะปกติจะชำระภายใน 2 วันทำการนับถัดจากวันที่คำสั่งขายสามารถดำเนินการได้

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)

| ค่าธรรมเนียม | สูงสุดไม่เกิน | เก็บจริง |
|---------------|---------------|----------|
| การจัดการ | 2.140 | 1.070 |
| รวมค่าใช้จ่าย | 5.350 | 1.313 |

หมายเหตุ: รวมค่าใช้จ่ายของรอบปีบัญชี วันที่ 3 พ.ค 65 - 2 พ.ค 66

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าหน่วยลงทุน)

| ค่าธรรมเนียม | สูงสุดไม่เกิน | เก็บจริง |
|-----------------------------|---------------|----------|
| การขาย | 2.140 | 0.535 |
| การรับซื้อคืน | 2.140 | ยกเว้น |
| การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า | 2.140 | 0.535 |
| การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก | 2.140 | 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 |
|----------------------------|-------|
| พันธบัตร | 61.92 |
| หมวดอุตสาหกรรมของตราสารทุน | 28.42 |
| เงินฝากและอื่นๆ | 9.40 |
| ตราสารทุน | 0.26 |

ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก

| ชื่อหลักทรัพย์ | % NAV |
|--|-------|
| พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย (CB24808A) | 35.81 |
| พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย (CB24711A) | 13.05 |
| พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย (CB24620A) | 6.53 |
| พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย (CB24606A) | 3.27 |
| พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย (CB24725A) | 3.26 |

ข้อมูลเชิงสถิติ

| | |
|----------------------------|---------|
| Maximum Drawdown | -11.34% |
| อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน | 62.54% |

การจัดสรรการลงทุนในผู้ออกตราสาร 5 อันดับแรก

| ชื่อผู้ออกตราสาร | % NAV |
|--|-------|
| ธนาคารแห่งประเทศไทย | 61.92 |
| ธนาคารกสิกรไทย จำกัด (มหาชน) | 5.76 |
| บริษัท ซีพี ออลล์ จำกัด (มหาชน) | 1.71 |
| บริษัท ท่าอากาศยานไทย จำกัด (มหาชน) | 1.49 |
| บริษัท แอดวานซ์ อินโฟร์ เซอร์วิส จำกัด (มหาชน) | 1.19 |

การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม

| กลุ่มอุตสาหกรรม | % NAV |
|--------------------------------|-------|
| พลังงานและสาธารณูปโภค | 4.06 |
| ธนาคาร | 3.90 |
| พาณิชย์ | 3.44 |
| เทคโนโลยีสารสนเทศและการสื่อสาร | 2.89 |
| ขนส่งและโลจิสติกส์ | 2.48 |

การจัดสรรการลงทุนตามอันดับความน่าเชื่อถือ (%)

| ผู้ออก | ในประเทศ | national | international |
|----------------|----------|----------|---------------|
| Gov bond / AAA | 61.92 | | |
| AA | | | |
| A | | | |
| BBB | | | |
| ต่ำกว่า BBB | | | |
| Unrated / non | 0.00 | | |

ผู้จัดการกองทุนรวม

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

นาย วีรชัย จันเป็ง (ตั้งแต่ 29 เม.ย. 2565)

ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเรื่องมือบริหารความเสี่ยง

ด้านสภาพคล่องได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



www.eastspring.co.th

การลงทุนในกองทุนอื่นเกินกว่า 20% (กองในประเทศ และหรือกองต่างประเทศ)

ชื่อกองทุน : พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย

คำอธิบาย

Maximum Drawdown เปอร์เซ็นต์ผลขาดทุนสูงสุดของกองทุนรวมในระยะเวลา 5 ปีย้อนหลัง (หรือตั้งแต่จัดตั้งกองทุนกรณีที่ยังไม่ครบ 5 ปี) โดยวัดจากระดับ NAV ต่อหน่วยที่จุดสูงสุดไปจนถึงจุดต่ำสุดในช่วงที่ NAV ต่อหน่วยปรับตัวลดลง ค่า Maximum Drawdown เป็นข้อมูลที่ช่วยให้ทราบถึงความเสี่ยงที่อาจจะขาดทุนจากการลงทุนในกองทุนรวม

Recovering Period ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาดังแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินลงทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลานานเท่าใด

FX Hedging เปอร์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตกองทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลานึง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์กับผลรวมของมูลค่าการขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 1 ปีหารด้วยมูลค่า NAV ของกองทุนรวมเฉลี่ยในรอบระยะเวลาเดียวกัน กองทุนรวมที่มีค่า portfolio turnover สูง บ่งชี้ถึงการซื้อขายหลักทรัพย์บ่อยครั้งของผู้จัดการกองทุนและทำให้มีต้นทุนการซื้อขายหลักทรัพย์ที่สูง จึงต้องพิจารณาเปรียบเทียบ กับผลการดำเนินงานของกองทุนรวมเพื่อประเมินความคุ้มค่าของการซื้อขายหลักทรัพย์ดังกล่าว

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

Alpha ผลตอบแทนส่วนเกินของกองทุนรวมเมื่อเปรียบเทียบกับดัชนีชี้วัด (benchmark) โดยค่า Alpha ที่สูง หมายถึง กองทุนสามารถสร้างผลตอบแทนได้สูงกว่าดัชนีชี้วัด ซึ่งเป็นผลจากประสิทธิภาพของผู้จัดการกองทุนในการคัดเลือกหรือหาจังหวะเข้าลงทุนในหลักทรัพย์ได้อย่างเหมาะสม

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