

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน
อีส์พีริ่ง (ประเทศไทย) จำกัด

ข้อมูล ณ วันที่ 31 พฤษภาคม 2567

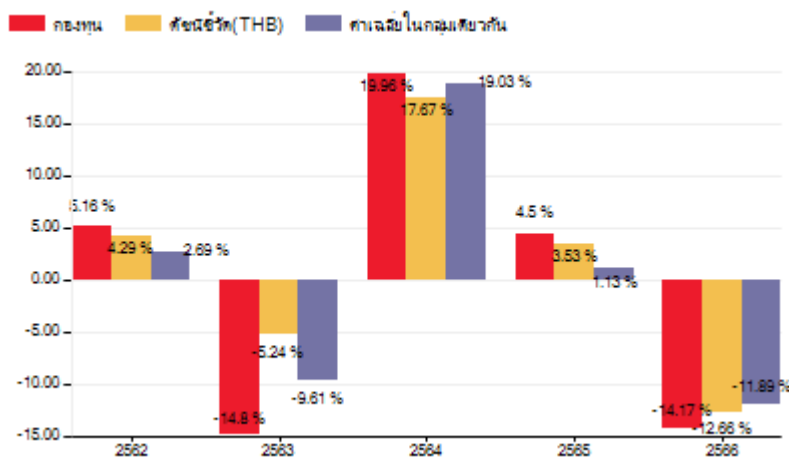
ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- ▶ กองทุนรวมตราสารทุน (Equity Fund)
- ▶ กลุ่ม Equity General

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- ▶ ลงทุนในตราสารแห่งทุนที่เป็นหลักทรัพย์ที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยหรือตลาดหลักทรัพย์ เอ็ม เอ ไอ ซึ่งมีการเคลื่อนไหวของราคาเมื่อเทียบกับดัชนีตลาดหลักทรัพย์ (SET Index) ค่อนข้างต่ำ (Low correlation to the SET Index (low beta)) โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของ NAV โดยมีหลักทรัพย์ที่มีค่า Beta เฉลี่ยย้อนหลัง 3 ปี ไม่เกิน 0.85 และหลักทรัพย์ที่มีค่า Beta เฉลี่ยย้อนหลัง 1 ปี ไม่เกิน 0.85 โดยลงทุนไม่น้อยกว่าร้อยละ 20 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน
- ▶ กลยุทธ์การลงทุน : มุ่งหวังให้ได้รับผลประกอบการเคลื่อนไหวสูงกว่าดัชนีชี้วัด

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (% ต่อปี)



ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด (% ต่อปี)

	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี
กองทุน	-1.47	-0.27	2.80	-6.67
ดัชนีชี้วัด (THB)	-2.86	-0.32	-0.27	-9.32
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	-3.30	-0.69	-0.56	-9.05
ความผันผวนกองทุน	8.66	8.38	8.53	10.01
ความผันผวนดัชนีชี้วัด (THB)	10.45	10.55	10.31	11.30

	3 ปี	5 ปี	10 ปี	ตั้งแต่จัดตั้ง
กองทุน	-2.51	-2.66	-	1.01
ดัชนีชี้วัด (THB)	-2.60	-0.66	-	3.82
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	-3.24	-1.75	-	-
ความผันผวนกองทุน	10.85	14.15	-	12.10
ความผันผวนดัชนีชี้วัด (THB)	11.12	16.74	-	14.62

ระดับความเสี่ยง

ต่ำ	1	2	3	4	5	6	7	8	สูง
						6			

คำอธิบาย

ลงทุนในตราสารทุนเป็นหลักโดยเฉลี่ยในรอบปีไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน 02 ก.พ. 2559
 วันเริ่มต้น class -
 นโยบายการจ่ายเงินปันผล ไม่มีนโยบายจ่ายเงินปันผล
 การรับซื้อคืนหน่วย ไม่เกินปีละ 2 ครั้ง ทุกวันที่ 30
 ลงทุนอัตโนมัติ พฤษภาคม และ 30 พฤศจิกายน
 ไม่มีกำหนดระยะเวลาสิ้นสุดของอายุกองทุน โครงการ

ดัชนีชี้วัด :

1. ดัชนีผลตอบแทนรวมตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET TRI) สัดส่วน 100%
 สำหรับผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด ผลการดำเนินงานน้อยกว่า 1 ปี คำนวณตามระยะเวลาจริง

คำเตือน :

- ▶ การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ▶ ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวม มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต: มีบริษัทแม่ดูแลให้ทำตามกฎหมาย
 จัดอันดับกองทุน Morningstar ★★

ชื่อเดิม : กองทุนเปิดธนาชาติ Prime Low Beta (T-PrimeLowBeta)

ชื่อใหม่ : กองทุนเปิดอีส์พีริ่ง Prime Low Beta (ES-PRIMELOWBETA)

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

ระยะเวลาได้รับเงินค่าขายคืน: T+2

Remark : ปัจจุบันและในภาวะปกติจะชำระภายใน 2 วันทำการนับถัดจากวันที่คำสั่งขายสามารถดำเนินการได้

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	2.140	1.603
รวมค่าใช้จ่าย	3.210	1.766

หมายเหตุ: รวมค่าใช้จ่ายของรอบปีบัญชี วันที่ 2 ก.พ 66 - 1 ก.พ 67

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
หุ้นสามัญ	99.16
เงินฝากและอื่นๆ	0.84

ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก

ชื่อหลักทรัพย์	% NAV
บริษัท อินทัช โฮลดิ้งส์ จำกัด (มหาชน) (INTUCH)	8.93
บริษัท แอดวานซ์ อินโฟร์ เซอร์วิส จำกัด (มหาชน) (ADVANC)	8.68
บริษัท กรุงเทพดุสิตเวชการ จำกัด (มหาชน) (BDMS)	7.19
บริษัท ซี.พี. ออลล์ จำกัด (มหาชน) (CPALL)	6.33
บริษัท ปตท.สำรวจและผลิตปิโตรเลียม จำกัด (มหาชน) (PTTEP)	5.39

ข้อมูลเชิงสถิติ

Maximum Drawdown	-36.83%
Sharpe Ratio	-0.33%
Alpha	0.09%
Beta	0.80
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน	83.49%

การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม

กลุ่มอุตสาหกรรม	% NAV
เทคโนโลยีสารสนเทศและการสื่อสาร	21.72
การแพทย์	16.12
ธนาคาร	12.72
พาณิชย์	8.94
ขนส่งและโลจิสติกส์	6.88

ผู้จัดการกองทุนรวม

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

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

ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือบริหารความเสี่ยง

ด้านสภาพคล่องได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



www.eastspring.co.th

คำอธิบาย

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

Recovering Period ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาตั้งแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินลงทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลานานเท่าใด

FX Hedging เปอร์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

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