

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน  
อีสปริง (ประเทศไทย) จำกัด

ข้อมูล ณ วันที่ 31 ตุลาคม 2567  
ชนิดจ่ายเงินปันผล  
Class ES-SET50-D

**ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม**

- กองทุนรวมตราสารทุน (Equity Fund)
- กลุ่ม SET 50 Index Fund

**นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน**

- กองทุนมีนโยบายที่จะพยายามลงทุนในหุ้นเต็มอัตรา (fully invested) เพื่อให้สามารถสร้างผลตอบแทนที่ใกล้เคียงกับดัชนี SET50 ให้มากที่สุดเท่าที่จะทำได้กองทุนจะใช้กลยุทธ์การบริหารกองทุนเชิงรับ (Passive management strategy) เพื่อสร้างผลตอบแทนจากการลงทุนให้ใกล้เคียงกับผลตอบแทนของดัชนี SET50
- กลยุทธ์การลงทุน : มุ่งหวังให้ได้รับผลประโยชน์จากการเคลื่อนไหวตามดัชนีชี้วัด

**ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปีกumul (ต่อปี)**

	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี
กองทุน	-	14.20	-	-
ดัชนีชี้วัด (THB)	-	13.75	-	-
ความผันผวนกองทุน	-	13.48	-	-
ความผันผวนดัชนีชี้วัด (THB)	-	13.57	-	-

  

	3 ปี	5 ปี	10 ปี	ตั้งแต่จัดตั้ง
กองทุน	-	-	-	17.68
ดัชนีชี้วัด (THB)	-	-	-	16.67
ความผันผวนกองทุน	-	-	-	12.25
ความผันผวนดัชนีชี้วัด (THB)	-	-	-	12.36

ต่ำ	ระดับความเสี่ยง								สูง
	1	2	3	4	5	6	7	8	
<b>คำอธิบาย</b>									
ลงทุนในตราสารทุนเป็นหลักโดยเฉลี่ยในรอบปีไม่น้อยกว่า 80 % ของ NAV									

**ข้อมูลกองทุนรวม**

วันจดทะเบียนกองทุน	29 มี.ค. 2544
วันเริ่มต้น class	17 มิ.ย. 2567
นโยบายการจ่ายเงินปันผล	จ่ายเงินปันผล ไม่เกินปีละ 4 ครั้ง
การรับซื้อคืนหน่วยลงทุน	-
อัตราเงินปันผล	-
อายุกองทุน	ไม่กำหนด

**ผู้จัดการกองทุนรวม**

น.ส. พัชราภา มหัทธนกกุล (ตั้งแต่ 11 ก.ค. 2565)  
นาย สมิทธิ์ ศักดิ์กำจร (ตั้งแต่ 02 ส.ค. 2564)

**ดัชนีชี้วัด :**

1. ดัชนีผลตอบแทนรวม SET 50 (SET50 TRI) สัดส่วน 100% สำหรับผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปีกumul ผลการดำเนินงานน้อยกว่า 1 ปี คำนวณตามระยะเวลาจริง

**คำเตือน :**

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวม มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต: มีบริษัทแม่ดูแลให้ทำตามกฎหมาย

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือ  
บริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่อง  
ได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

[www.eastspring.co.th](http://www.eastspring.co.th)

**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  
 ระยะเวลาชำระเงินค่าขายคืน : T+2

Remark : ปัจจุบันและในภาวะปกติจะชำระภายใน 2 วันทำการนับถัดจากวันที่คำสั่งขายสามารถดำเนินการได้

**ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)**

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	1.00	0.500
รวมค่าใช้จ่าย*	1.200	0.6321

หมายเหตุ : รวมค่าใช้จ่าย ของรอบปีบัญชี 1 พ.ค. 65 ถึง 30 เม.ย. 66 และสามารถดูค่าธรรมเนียมอื่นๆเพิ่มเติมได้ที่หนังสือชี้ชวนส่วนข้อมูลกองทุนรวม

**ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าหน่วยลงทุน)**

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การขาย	ไม่มี	ไม่มี
การรับซื้อคืน	ไม่มี	ไม่มี
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า	ไม่มี	ไม่มี
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก	ไม่มี	ไม่มี
การโอนหน่วย	5 บาท ต่อ 1,000 หน่วย	5 บาท ต่อ 1,000 หน่วย

หมายเหตุ : ส่วนต่างมูลค่าหน่วยลงทุน (Spread) ที่เรียกเก็บจากผู้ทำรายการนี้ (ส่วนต่างดังกล่าวจะถูกนำส่งเข้าหรือตกเป็นของกองทุนทั้งจำนวน เพื่อนำไปชำระเป็นค่าใช้จ่ายในการซื้อขายหลักทรัพย์ของกองทุน) ไม่เกิน 0.30% เก็บจริง 0.10%

**สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน**

ชื่อประเภททรัพย์สิน	% NAV
หุ้นสามัญ	99.75
ประเภทรายการค้างรับอื่นๆ	2.41
เงินฝากธนาคารประเภทออมทรัพย์	1.23
ประเภทรายการค้างจ่ายหรือหนี้สินอื่นๆ	-3.39

**ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก**

ชื่อหลักทรัพย์	% NAV
บริษัท เติลต้า อีเลคโทรนิคส์ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)	13.42
บริษัท ปตท. จำกัด (มหาชน)	7.54
บริษัท ท่าอากาศยานไทย จำกัด (มหาชน)	6.85
บริษัท แอควานซ์ อินโฟร เซอร์วิส จำกัด (มหาชน)	6.38
บริษัท กัลฟ์ เอ็นเนอร์จี ดีเวลลอปเม้นท์ จำกัด (มหาชน)	6.05

**ข้อมูลเชิงสถิติ**

Maximum Drawdown	-3.21%
Recovering Period	1 เดือน
FX Hedging	N/A
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน	12.69%
Sharpe Ratio	N/A

**การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม**

กลุ่มอุตสาหกรรม	% NAV
พลังงานและสาธารณูปโภค	22.45
ชิ้นส่วนอิเล็กทรอนิกส์	13.42
เทคโนโลยีสารสนเทศและการสื่อสาร	12.35
ธนาคาร	12.04
พาณิชย์	8.35

## คำอธิบาย

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

Recovering Period ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาตั้งแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลานานเท่าใด

FX Hedging เปรียบเทียบของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลานึง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์กับผลรวมของมูลค่าการขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 1 ปีหารด้วยมูลค่า NAV ของกองทุนรวมเฉลี่ยในรอบระยะเวลาเดียวกัน กองทุนรวมที่มีค่า portfolio turnover สูง บ่งชี้ถึงการซื้อขายหลักทรัพย์บ่อยครั้งของผู้จัดการกองทุนและทำให้มีต้นทุนการซื้อขายหลักทรัพย์ที่สูง จึงต้องพิจารณาเปรียบเทียบกับผลการดำเนินงานของกองทุนรวมเพื่อประเมินความคุ้มค่าของการซื้อขายหลักทรัพย์ดังกล่าว

Sharpe Ratio อัตราส่วนระหว่างผลตอบแทนส่วนเพิ่มของกองทุนรวมเปรียบเทียบกับ ความเสี่ยงจากการลงทุน โดยคำนวณจากผลต่างระหว่างอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมกับอัตราผลตอบแทนที่ปราศจากความเสี่ยง (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 โดยใช้ตัวอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมตราสารหนี้ คำนวณจากค่าเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักของ Yield to Maturity ของตราสารหนี้แต่ละตัวที่กองทุนมีการลงทุน และเนื่องจาก Yield to Maturity มีหน่วยมาตรฐานเป็นเปอร์เซ็นต์ต่อปี จึงสามารถนำไปใช้เปรียบเทียบอัตราผลตอบแทนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีนโยบายถือครองตราสารหนี้จนครบกำหนดอายุและมีลักษณะการลงทุนที่ใกล้เคียงกันได้



[www.eastspring.co.th](http://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