

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน
อีสท์สปริง (ประเทศไทย) จำกัด

ข้อมูล ณ วันที่ 31 สิงหาคม 2566

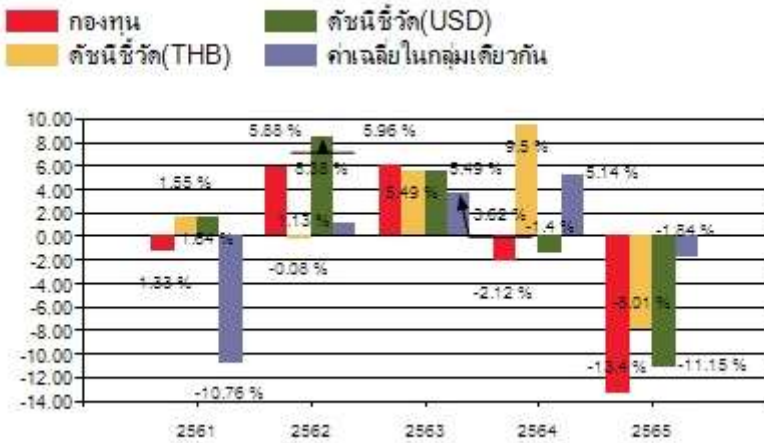
ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมตราสารหนี้ (Fixed Income Fund)
- กองทุนรวมฟีดเดอร์ (Feeder Fund)
- กลุ่ม Global Bond Discretionary F/X Hedge or Unhedge

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- เน้นลงทุนในกองทุน PIMCO GIS Global Bond Fund โดยกองทุนดังกล่าว มีวัตถุประสงค์ในการลงทุนที่เน้นลงทุนในตราสารหนี้ กองทุนดังกล่าวบริหารจัดการโดย PIMCO Global Advisors (Ireland) Limited
- มุ่งหวังให้ผลประโยชน์การเคลื่อนไหวตามกองทุนหลัก โดยกองทุนหลักมุ่งหวังให้ผลประโยชน์การเคลื่อนไหวสูงกว่าดัชนีชี้วัด

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (% ต่อปี)



ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด (%ต่อปี)

	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี
กองทุน	-0.11	-0.72	-0.31	-4.02
ดัชนีชี้วัด (THB)	4.27	0.45	1.20	-3.58
ดัชนีชี้วัด (USD)	2.87	-0.15	2.18	0.55
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	0.04	-0.20	-0.66	-2.46
ความผันผวนกองทุน	4.16	4.29	4.19	4.49
ความผันผวนดัชนีชี้วัด (THB)	9.43	9.00	9.26	10.88
ความผันผวนดัชนีชี้วัด (USD)	5.01	4.22	4.93	5.44

	3 ปี	5 ปี	10 ปี	ตั้งแต่จัดตั้ง
กองทุน	-4.88	-1.13	-0.10	1.29
ดัชนีชี้วัด (THB)	0.81	2.20	2.22	2.25
ดัชนีชี้วัด (USD)	-3.03	0.84	1.36	1.63
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	-2.66	-0.41	-0.74	-
ความผันผวนกองทุน	3.62	3.56	4.81	5.28
ความผันผวนดัชนีชี้วัด (THB)	8.76	7.63	6.85	6.87
ความผันผวนดัชนีชี้วัด (USD)	4.31	3.83	4.16	4.61

ระดับความเสี่ยง

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

คำอธิบาย

ลงทุนในพันธบัตรรัฐบาล และตราสารหนี้เอกชน โดยมีตราสาร non-investment grade / unrated ไม่เกิน 20 % ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน	14 ก.ค. 2553
วันเริ่มต้น class	-
นโยบายการจ่ายเงินปันผล	ไม่มีนโยบายจ่ายเงินปันผล
การรับซื้อคืนหน่วยลงทุนอัตโนมัติ	-
อายุกองทุน	ไม่กำหนด

ดัชนีชี้วัด :

1. Bloomberg GLOBAL AGGREGATE Total RETURN

INDEX VALUE Hedged USD สัดส่วน 100%

หมายเหตุ : ในรูปสกุลเงินบาท

สำหรับผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด ผลการ

ดำเนินงานน้อยกว่า 1 ปี คำนวณตามระยะเวลาจริง

คำเตือน :

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวม มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต: มีบริษัทแม่ดูแลให้ทำตามกฎหมาย

จัดอันดับกองทุน Morningstar ★★★★★

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+3

Remark : ปัจจุบันและในภาวะปกติจะชำระภายใน 3 วันทำการซื้อขายถัดจากวันทำการซื้อขาย

ข้อมูลเชิงสถิติ

Maximum Drawdown	-16.64%
FX Hedging	90.32%
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน	8.77%

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	1.6050	0.9095
รวมค่าใช้จ่าย	1.9795	1.1470

หมายเหตุ : รวมค่าใช้จ่าย ของรอบปีบัญชี 1 ก.ค. 64 ถึง 30 มิ.ย. 65

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การขาย	1.00	1.00
การรับซื้อคืน	ไม่มี	ยกเว้น
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า	1.00	1.00
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก	ไม่มี	ยกเว้น
การโอนหน่วย	5	5

หมายเหตุ : ค่าโอน 5 บาท ต่อหน่วยลงทุน 1,000 หน่วย

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน

ชื่อประเภททรัพย์สิน	% NAV
หน่วยลงทุนของกองทุนรวม ตราสารหนี้	97.27
เงินฝากธนาคารประเภทออม ทรัพย์	4.62
ประเภทรายการค้างรับอื่นๆ	0.08
ประเภทรายการค้างจ่ายหรือ หนี้สินอื่นๆ	-0.47
รายการอื่นๆ	-1.50

ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก

ชื่อหลักทรัพย์	% NAV
PIMCO GIS Global Bond Fund	97.27

ผู้จัดการกองทุนรวม

น.ส. อธิษฐา อรรถกมุขวัฒนา

(ตั้งแต่ 24 ส.ค. 2565)

ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือบริหารความเสี่ยง

ด้านสภาพคล่องได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



www.eastspring.co.th

การลงทุนในกองทุนอื่นเกินกว่า 20% (กองในประเทศ และหรือกองต่างประเทศ)

ชื่อกองทุน : PIMCO GIS Global Bond Fund

ISIN code : IE0002461055

Bloomberg code : PIMGBAI ID

EQUITY

คำอธิบาย

Maximum Drawdown เปอร์เซ็นต์ของผลขาดทุนสูงสุดของกองทุนรวมในระยะเวลา 5 ปีย้อนหลัง (หรือตั้งแต่จัดตั้งกองทุนกรณีที่ยังไม่ครบ 5 ปี) โดยวัดจากระดับ NAV ต่อหน่วยที่จุดสูงสุดไปจนถึงจุดต่ำสุดในช่วงที่ NAV ต่อหน่วยปรับตัวลดลง ค่า Maximum Drawdown เป็นข้อมูลที่จะช่วยให้ทราบถึงความเสี่ยงที่อาจจะขาดทุนจากการลงทุนในกองทุนรวม

Recovering Period ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาตั้งแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลานานเท่าใด

FX Hedging เปอร์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

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

Sharpe Ratio อัตราส่วนระหว่างผลตอบแทนส่วนเพิ่มของกองทุนรวมเปรียบเทียบกับความเสี่ยงจากการลงทุน 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 ซึ่งเป็นผลจากประสิทธิภาพของผู้จัดการกองทุนในการคัดเลือกหรือหาจังหวะเข้าลงทุนในหลักทรัพย์ได้อย่างเหมาะสม

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 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

Expert in Asia. Invest in Your Future.