

กองทุนเปิดฟิลลิปบริหารเงิน

PHILLIP CASH MANAGEMENT OPEN END FUND (PCASH)

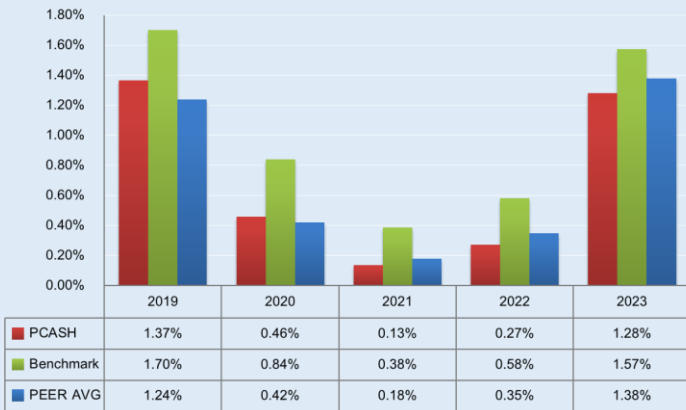
ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมตราสารหนี้, กองทุนรวมตลาดเงิน
- กองทุนที่ลงทุนแบบไม่มีความเสี่ยงต่างประเทศ
- กลุ่ม Money Market Government

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- ลงทุนในตราสารแห่งหนี้ และ/หรือ เงินฝาก หรือตราสารการเงินอื่นใดที่มีกำหนดชำระคืนเมื่อทางถาวร หรือจะครบกำหนดชำระคืนไม่เกิน 397 วัน นับแต่วันที่ลงทุน
- กองทุนจะดำรงพอร์ตโฟลิโอ ดูเรชั่น (Portfolio Duration) ของกองทุน ณ ขณะใดขณะหนึ่งไม่เกิน 92 วัน
- ไม่ลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า และตราสารที่มีลักษณะของสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแฝง (Structured Notes)
- มุ่งหวังให้ผลประโยชน์การสูงกว่าดัชนี (active management)

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (%ต่อปี)



ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด (%ต่อปี)

| Fund | YTD | 3M | 6M | 1Y |
|----------------|-----------|-----------|-----------|-----------|
| | 28 Dec 23 | 31 Jul 24 | 30 Apr 24 | 31 Oct 23 |
| PCASH | 1.53 | 0.47 | 0.92 | 1.79 |
| Benchmark | 1.95 | 0.62 | 1.17 | 2.30 |
| Peer AVG | 1.68 | 0.51 | 1.02 | 1.98 |
| PCASH (SD) | 0.08 | 0.07 | 0.08 | 0.08 |
| Benchmark (SD) | 0.12 | 0.13 | 0.12 | 0.12 |

| Fund | 3Y | 5Y | 10Y | Inception |
|----------------|-----------|-----------|-----------|-----------|
| | 29 Oct 21 | 31 Oct 19 | 31 Oct 14 | 07 Aug 07 |
| PCASH | 1.03 | 0.77 | 1.01 | 1.51 |
| Benchmark | 1.39 | 1.12 | 1.33 | 1.83 |
| Peer AVG | 1.14 | 0.82 | 0.97 | |
| PCASH (SD) | 0.07 | 0.07 | 0.07 | 0.09 |
| Benchmark (SD) | 0.11 | 0.10 | 0.09 | 0.12 |

ระดับความเสี่ยง



เสี่ยงต่ำ

ลงทุนในเงินฝาก ตราสารเทียบเท่าเงินฝาก พันธบัตรรัฐบาลหรือพันธบัตร ธปท. ซึ่งอายุไม่เกิน 397 วัน โดยไม่มีความเสี่ยงต่างประเทศ

ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน : 7 สิงหาคม 2550

วันเริ่มต้น class : -

นโยบายการจ่ายเงินปันผล : ไม่มีนโยบายจ่ายเงินปันผล
อายุกองทุน : -

ผู้จัดการกองทุนรวม

นายสุชาติ เจริญวุฒิคุณ ตั้งแต่ 24 ส.ค. 66
นายพุทธิพันธ์ วัชรารคม ตั้งแต่ 04 ก.ย. 66
นายวุทธิพัฒน์ พงษ์ษา ตั้งแต่ 18 ธ.ค. 66

ดัชนีชี้วัด :

ThaiBMA Short-Term Government Bond Index

คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวม มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต : ไม่ได้เข้าร่วม CAC / ไม่มีบริษัทแม่ดูแลให้ทำตามกฎหมาย

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

ผู้ลงทุนสามารถศึกษา
เครื่องมือบริหารความเสี่ยง
ด้านสภาพคล่องได้ใน
หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



การซื้อขายหน่วยลงทุน

วันทำการซื้อ : ทุกวันทำการ

เวลาทำการ : 08.30 – 15.30 น.

การซื้อขายครั้งแรกขั้นต่ำ : ไม่กำหนด

การซื้อขายครั้งถัดไปขั้นต่ำ : ไม่กำหนด

การขายคืนหน่วยลงทุน

วันทำการขายคืน : ทุกวันทำการ

เวลาทำการ : 08.30 – 15.00 น.

การขายคืนขั้นต่ำ : ไม่กำหนด

ยอดคงเหลือขั้นต่ำ : ไม่กำหนด

ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน : T+1

หมายเหตุ: ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน : ภายใน 5 วันทำการนับแต่วันคำนวณราคาซื้อขายคืนหน่วยลงทุน ทั้งนี้ ปัจจุบันผู้ถือหน่วยลงทุนจะได้รับเงินค่าขายหน่วยลงทุน ภายใน 1 วันทำการนับแต่วันคำนวณราคาซื้อขายคืนหน่วยลงทุน

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)

| ค่าธรรมเนียม | สูงสุดไม่เกิน | เก็บจริง |
|---------------|---------------|----------|
| การจัดการ | 0.6420 | 0.1607 |
| รวมค่าใช้จ่าย | 1.6050 | 0.2656 |

หมายเหตุ

- ค่าธรรมเนียมรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว
- รวมค่าใช้จ่าย ประกอบด้วย ค่าธรรมเนียมการจัดการ ผู้ดูแลผลประโยชน์ นายทะเบียน และค่าใช้จ่ายอื่น โดยอัตราที่เรียกเก็บจริงของค่าใช้จ่ายอื่นเป็นข้อมูลตามรอบปีบัญชีหรือรอบ 6 เดือนล่าสุดของกองทุน

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)

| ค่าธรรมเนียม | สูงสุดไม่เกิน | เก็บจริง |
|-----------------------------|---------------------------|---------------------------|
| การขาย | 1.0000 | ไม่มี |
| การรับซื้อคืน | ไม่มี | ไม่มี |
| การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า | ไม่มี | ไม่มี |
| การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก | ไม่มี | ไม่มี |
| การโอนหน่วย | ตามที่นายทะเบียนเรียกเก็บ | ตามที่นายทะเบียนเรียกเก็บ |

หมายเหตุ

- ค่าธรรมเนียมรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว
- บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน

| ประเภททรัพย์สิน | สัดส่วน % ของพอร์ต |
|-----------------|--------------------|
|-----------------|--------------------|

| | |
|--|-------|
| ตราสารหนี้ภาครัฐ | 90.42 |
| เงินฝากสถาบันการเงิน | 2.92 |
| • เงินฝาก ธนาคาร ยูโอบี จำกัด (มหาชน) 2.82 | |
| • เงินฝาก ธนาคารอาร์ เอช บี จำกัด 0.10 | |
| ทรัพย์สินและหนี้สินอื่น ๆ | 6.67 |
| • เงินฝาก (THB ,BAY) 6.69 | |
| • หนี้สิน -0.02 | |

ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก

| ชื่อหลักทรัพย์ | สัดส่วน % ของพอร์ต |
|---------------------------------------|--------------------|
| พันธบัตร ธนาคารแห่งประเทศไทย CB25102A | 32.12 |
| พันธบัตร ธนาคารแห่งประเทศไทย CB24D19A | 13.93 |
| พันธบัตร ธนาคารแห่งประเทศไทย CB24D06A | 8.58 |
| พันธบัตร ธนาคารแห่งประเทศไทย CB24N14A | 6.44 |
| พันธบัตร ธนาคารแห่งประเทศไทย CB24D12A | 6.43 |

ข้อมูลเชิงสถิติ

Maximum Drawdown : -0.02%

Recovering Period : 19 วัน

FX Hedging : N/A

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน : 2.05 เท่า

Sharpe Ratio : N/A

Alpha : N/A

Beta : N/A

Tracking Error : N/A

อายุเฉลี่ยของตราสารหนี้ : 2 เดือน

Yield to Maturity : 1.87%

การจัดสรรการลงทุนในต่างประเทศ

N/A

ผู้ออกตราสาร 5 อันดับแรก

| ผู้ออกตราสาร | สัดส่วน % ของพอร์ต |
|-------------------------|--------------------|
| ธนาคารแห่งประเทศไทย | 87.85 |
| ธนาคาร ยูโอบี จำกัด | 2.82 |
| กระทรวงการคลัง | 2.57 |
| ธนาคารอาร์ เอช บี จำกัด | 0.10 |

การจัดสรรการลงทุนตามอันดับความน่าเชื่อถือ (%)

| อันดับความน่าเชื่อถือ | ในประเทศ |
|-----------------------|----------|
| Gov bond / AAA | 90.41 |
| AA | n/a |
| A | n/a |
| BBB | n/a |
| below BBB | n/a |
| Unrated | n/a |

คำอธิบาย

Maximum Drawdown เปรอ์เซ็นต์ผลขาดทุนสูงสุดของกองทุนรวมในระยะเวลา 5 ปีย้อนหลัง (หรือตั้งแต่จัดตั้งกองทุนกรณีที่ยังไม่ครบ 5 ปี) โดยวัดจากระดับ NAV ต่อหน่วยที่จุดสูงสุด ไปจนถึงจุดต่ำสุดในช่วงที่ NAV ต่อหน่วยปรับตัวลดลง ค่า Maximum Drawdown เป็นข้อมูลที่ช่วยให้ทราบถึงความเสี่ยงที่อาจจะขาดทุนจากการลงทุนในกองทุนรวม

Recovering Period ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาตั้งแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลานานเท่าใด

FX Hedging เปรอ์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

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

Sharpe Ratio อัตราส่วนระหว่างผลตอบแทนส่วนเพิ่มของกองทุนรวมเปรียบเทียบกับความเสี่ยงจากการลงทุน โดยคำนวณจากผลต่างระหว่างอัตราผลตอบแทนของ

กองทุนรวมกับอัตราผลตอบแทนที่ปราศจากความเสี่ยง (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 ระดับและทิศทางการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุน โดยเปรียบเทียบกับอัตราการเปลี่ยนแปลงของตลาด Beta น้อยกว่า 1 แสดงว่าหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนน้อยกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด Beta มากกว่า 1 แสดงว่า หลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนมากกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด

Tracking Error อัตราผลตอบแทนของกองทุนมีประสิทธิภาพในการเลียนแบบดัชนีชี้วัด โดยหาก tracking error ต่ำ หมายถึงกองทุนรวมมีประสิทธิภาพในการสร้างผลตอบแทนให้ใกล้เคียงกับดัชนีชี้วัด กองทุนรวมที่มีค่า tracking error สูง จะมีอัตราผลตอบแทนโดยเฉลี่ยห่างจากดัชนีชี้วัดมากขึ้น

Yield to Maturity อัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในตราสารหนี้โดยถือจนครบกำหนดอายุ ซึ่งคำนวณจากดอกเบี้ยที่จะได้รับในอนาคตตลอดอายุตราสารและเงินต้นที่จะได้รับคืนนำมาคิดลดเป็นมูลค่าปัจจุบัน โดยใช้วิธีอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมตราสารหนี้ คำนวณจากค่าเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักของ Yield to Maturity ของตราสารหนี้แต่ละตัวที่กองทุนมีการลงทุน และเนื่องจาก Yield to Maturity มีหน่วยมาตรฐานเป็นเปอร์เซ็นต์ต่อปี จึงสามารถนำไปใช้เปรียบเทียบอัตราผลตอบแทนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีนโยบายถือครองตราสารหนี้จนครบกำหนดอายุและมีลักษณะการลงทุนที่ใกล้เคียงกันได้

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนรวม ฟิลลิป จำกัด

โทรศัพท์ : 0-2153-9290 ต่อ 1187

www.phillipasset.co.th

ที่อยู่ 849 อาคารวิวัฒน์ ชั้น 22 ห้อง 2201

ถ.สีลม แขวงสีลม เขตบางรัก

กรุงเทพมหานคร 10500