

กองทุนเปิดฟิลลิป ไซน่า กรีน เอ็นเนอร์จี แอนด์ เอ็นไวรอนเมนท์

Phillip China Green Energy and Environment (P-CGREEN)

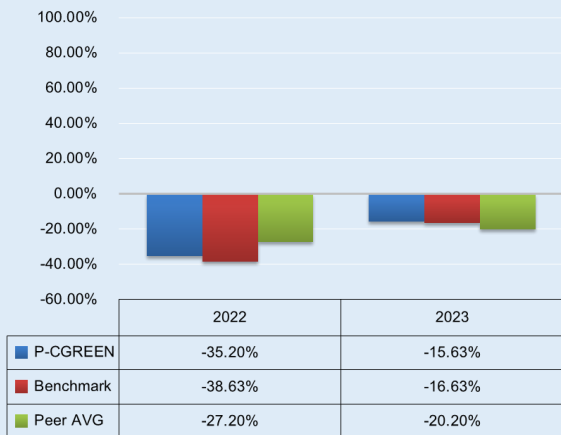
ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมตราสารทุน
- กองทุนรวมหน่วยลงทุน (Feeder Fund)

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- ลงทุนในหน่วยลงทุนของ KraneShares MSCI China Clean Technology Index ETF (กองทุนปลายทาง) เพียงกองทุนเดียวเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80% ของ NAV
- กองทุนปลายทางมีวัตถุประสงค์จะลงทุนอย่างน้อย 80% ของสินทรัพย์รวมในดัชนีที่ติดตามผลการดำเนินงานของบริษัทในประเทศจีนที่ดำเนินธุรกิจเกี่ยวกับเทคโนโลยีสะอาด ที่เป็นมิตรกับสิ่งแวดล้อม 5 กลุ่มธุรกิจ คือ กลุ่มพลังงานทางเลือก (Alternative Energy), การพัฒนาและการจัดการทรัพยากรน้ำอย่างยั่งยืน (Sustainable Water), การออกแบบอาคารที่คำนึงถึงสิ่งแวดล้อม (Green Building), การป้องกันมลพิษ (Pollution Prevention) และการใช้พลังงานอย่างมีประสิทธิภาพ (Energy Efficiency)
- กองทุนปลายทางบริหารจัดการลงทุนโดย Krane Funds Advisors, LLC
- กองทุน P-CGREEN อาจลงทุนใน Derivatives เพื่อป้องกันความเสี่ยง (Hedging) จากอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศโดยขึ้นอยู่กับดุลยพินิจของผู้จัดการกองทุน ซึ่งพิจารณาสถานะของตลาดในขณะนั้น
- กองทุนปลายทาง มุ่งหวังให้ผลประกอบการเคลื่อนไหวตามดัชนีชี้วัด (passive management/index tracking) และกองทุน P-CGREEN มุ่งหวังให้ผลประกอบการเคลื่อนไหวตามกองทุนปลายทาง

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (%ต่อปี)



ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด (%ต่อปี)

| Fund | YTD 28 Dec 23 | 3M 30 Nov 23 | 6M 31 Aug 23 | 1Y 28 Feb 23 | Inception 27 Apr 21 |
|----------------|------------------|-----------------|-----------------|-----------------|------------------------|
| P-CGREEN | -3.26 | -4.17 | -16.62 | -22.35 | -38.07 |
| Benchmark | -3.70 | -5.35 | -18.60 | -23.61 | -41.39 |
| Peer AVG | -1.91 | -5.42 | -12.23 | -22.12 | |
| P-CGREEN (SD) | 34.00 | 32.36 | 27.74 | 28.63 | 33.68 |
| Benchmark (SD) | 38.58 | 37.12 | 32.05 | 31.96 | 38.12 |

ระดับความเสี่ยง



ความเสี่ยงสูง

ลงทุนในตราสารทุนเป็นหลักโดยเฉลี่ยในรอบปีไม่น้อยกว่า 80 % ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน : 27 เม.ย. 2564

วันเริ่มต้น class : -

นโยบายการจ่ายเงินปันผล : ไม่มีนโยบายจ่ายเงินปันผล
อายุกองทุน : -

ผู้จัดการกองทุนรวม

นายสุชาติ เจริญวุฒิคุณ ตั้งแต่วันที่ 24 ส.ค. 66
 นายพุทธิพันธ์ วัชรวิเศษ ตั้งแต่วันที่ 04 ก.ย. 66
 นายวุฒิพัฒน์ พงษ์ธา ตั้งแต่วันที่ 18 ธ.ค. 66

ดัชนีชี้วัด :

ผลการดำเนินงานของกองทุนปลายทาง สัดส่วน (%) :
 100.00 ในรูปสกุลเงินดอลลาร์สหรัฐ โดยปรับด้วยอัตรา
 แลกเปลี่ยนเพื่อคำนวณผลตอบแทนให้อยู่ในรูปสกุลเงิน
 บาท ณ วันที่คำนวณผลตอบแทน

คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวม
มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต : ไม่ได้เข้าร่วม CAC /
 ไม่มีบริษัทแม่ดูแลให้ทำตามกฎหมาย
 จัดอันดับกองทุน Morningstar : N/A

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเรื่องมี
 บริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่องได้
 ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

การซื้อขายหน่วยลงทุน

วันทำการซื้อ : ทุกวันทำการ

เวลาทำการ : 8.30 – 15.30 น.

การซื้อขายครั้งแรกขั้นต่ำ : ไม่กำหนด

การซื้อขายครั้งถัดไปขั้นต่ำ : ไม่กำหนด

การขายคืนหน่วยลงทุน

วันทำการขายคืน : ทุกวันทำการ

เวลาทำการ : 8.30 – 15.30 น.

การขายคืนขั้นต่ำ : ไม่กำหนด

ยอดคงเหลือขั้นต่ำ : ไม่กำหนด

ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน : T+3

ข้อมูลเชิงสถิติ

Maximum Drawdown : -58.53%

Recovering Period : N/A

FX Hedging : ตามดุลยพินิจผู้จัดการกองทุน

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน : 0.03 เท่า

Sharpe Ratio : -2.77

Alpha : 1.26%

Beta : 0.90

Tracking Error : 15.30%

อายุเฉลี่ยของตราสารหนี้ : N/A

Yield to Maturity : N/A

การจัดสรรการลงทุนในต่างประเทศ

N/A

การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม /
ผู้ออกตราสาร 5 อันดับแรก

N/A

การจัดสรรการลงทุนตามอันดับ
ความน่าเชื่อถือ (%)

N/A

ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก

ชื่อหลักทรัพย์

สัดส่วน %
ของพอร์ต

หน่วยลงทุน KraneShares

91.49

MSCI China Clean

Technology Index ETF

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)

| ค่าธรรมเนียม | สูงสุดไม่เกิน | เก็บจริง |
|---------------|---------------|----------|
| การจัดการ | 2.1400 | 1.6054 |
| รวมค่าใช้จ่าย | 3.9500 | 1.7262 |

หมายเหตุ

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

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)

| ค่าธรรมเนียม | สูงสุดไม่เกิน | เก็บจริง |
|-----------------------------|-----------------|-----------------|
| การขาย | 2.0000 | 1.5000 |
| การรับซื้อคืน | 1.5000 | ไม่เรียกเก็บ |
| การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า | 2.0000 | 1.5000 |
| การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก | 1.5000 | ไม่เรียกเก็บ |
| การโอนหน่วย | 50 บาท / รายการ | 50 บาท / รายการ |

หมายเหตุ

- ค่าธรรมเนียมรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว
- บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน

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

| | |
|---------------------------------------------------------------------|-------|
| หน่วยลงทุน KraneShares MSCI China Clean Technology Index ETF (KGRN) | 91.49 |
|---------------------------------------------------------------------|-------|

| | |
|-------------------------------------------------|------|
| เงินฝากหรือตราสารหนี้ที่สถาบันการเงินเป็นผู้ออก | 0.22 |
|-------------------------------------------------|------|

- เงินฝาก ธนาคาร ยูโอบี จำกัด (มหาชน) 0.2
- เงินฝาก ธนาคารอาร์ เอช บี จำกัด 0.02

| | |
|---------------------------|------|
| ทรัพย์สินและหนี้สินอื่น ๆ | 8.29 |
|---------------------------|------|

- เงินฝากสกุลเงินดอลลาร์สหรัฐ (USD) 6.12
- เงินฝาก BAY (THB) 2.32
- หนี้สิน -0.15

การลงทุนในกองทุนอื่นเกินกว่า 20% (กองต่างประเทศ)

ชื่อกองทุน : KraneShares MSCI China Clean Technology Index ETF

web link : <https://kraneshares.com/kgm/>

ISIN code : US5007678502

Bloomberg code : KGRN



คำอธิบาย

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

Recovering Period ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาตั้งแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินลงทุนเริ่มต้นใช้เวลานานเท่าใด

FX Hedging เปรอ์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตกองทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลานึง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 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 ซึ่งเป็นผลจากประสิทธิภาพของผู้จัดการกองทุนในการคัดเลือกหรือจังหวะเข้าลงทุนในหลักทรัพย์ได้อย่างเหมาะสม

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 โดยใช้ใช้อัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมตราสารหนี้ คำนวณจากค่าเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักของ Yield to Maturity ของตราสาร

หนี้แต่ละตัวที่กองทุนมีการลงทุน และเนื่องจาก Yield to Maturity มีหน่วยมาตรฐานเป็นเปอร์เซ็นต์ต่อปี จึงสามารถนำไปใช้เปรียบเทียบอัตราผลตอบแทนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีนโยบายถือครองตราสารหนี้จนครบกำหนดอายุและมีลักษณะการลงทุนที่ใกล้เคียงกันได้

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ฟิลลิป จำกัด

โทรศัพท์ : 0-2153-9290 ต่อ 1184

www.phillipasset.co.th

ที่อยู่ 849 อาคารวรวิวัฒน์ ชั้น 22 ห้อง 2201

ถ.สีลม แขวงสีลม เขตบางรัก

กรุงเทพมหานคร 10500