

กองทุนเปิดฟิลลิป ไซน่า กรีน เอ็นเนอร์จี แอนด์ เอ็นไวรอนเมนต์ Phillip China Green Energy and Environment (P-CGREEN)

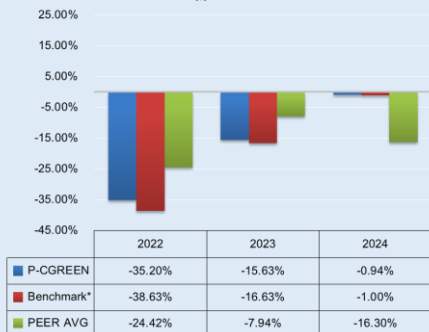
ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมตราสารทุน, กองทุนรวมฟิเตอร์
- กองทุนรวมที่เน้นลงทุนแบบมีความเสี่ยงต่างประเทศ
- กลุ่ม Global Equity - Alternative Energy

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- ลงทุนในหน่วยลงทุนของ KraneShares MSCI China Clean Technology Index ETF (กองทุนปลายทาง) เพียงกองทุนเดียวเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของ NAV
- กองทุนปลายทางมีวัตถุประสงค์จะลงทุนอย่างน้อยร้อยละ 80 ของสินทรัพย์รวมในดัชนีที่ติดตามผลการดำเนินงานของบริษัทในประเทศจีนที่ดำเนินธุรกิจเกี่ยวกับเทคโนโลยีสะอาดที่เป็นมิตรกับสิ่งแวดล้อม 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 ซึ่งพิจารณาภาวะของตลาดในขณะนั้น
- กองทุนปลายทาง มุ่งหวังให้ผลประกอบการเคลื่อนไหวตามดัชนีชี้วัด (Passive Management/Index Tracking) และกองทุน P-CGREEN มุ่งหวังให้ผลประกอบการเคลื่อนไหวตามกองทุนปลายทาง

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (%ต่อปี)



ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปีกลม

Fund	YTD	3M	6M	1Y*
P-CGREEN	17.49	10.55	3.19	37.92
Benchmark	19.61	11.43	4.45	40.61
Peer AVG	18.53	18.22	24.50	12.15
P-CGREEN (SD)	31.69	18.54	31.02	37.38
Benchmark (SD)	32.43	19.06	31.73	38.78
Fund	3Y*	5Y*	10Y*	Inception*
P-CGREEN	-8.39	N/A	N/A	-6.55
Benchmark	-9.43	N/A	N/A	-7.27
Peer AVG	-7.01	N/A	N/A	
P-CGREEN (SD)	31.65	N/A	N/A	33.74
Benchmark (SD)	34.17	N/A	N/A	37.21

หมายเหตุ : * % ต่อปี

ระดับความเสี่ยง



ความเสี่ยงสูง

ลงทุนในตราสารทุนเป็นหลักโดยเฉลี่ยในรอบปีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน : 27 เม.ย. 2564

วันเริ่มต้น class : -

นโยบายการจ่ายเงินปันผล : ไม่มีนโยบายจ่ายเงินปันผล
อายุกองทุน : ไม่กำหนด

ผู้จัดการกองทุนรวม

นายพุทธิพันธ์ วัชรินาคม ตั้งแต่ 04 ก.ย. 2566
นายสุชาติ เจริญวุฒิคุณ ตั้งแต่ 24 ส.ค. 2566

ดัชนีชี้วัด :

ผลการดำเนินงานของกองทุนปลายทาง สัดส่วน (%) :
100.00 ในรูปสกุลเงินดอลลาร์สหรัฐ โดยปรับด้วยอัตราแลกเปลี่ยนเพื่อคำนวณผลตอบแทนให้อยู่ในรูปสกุลเงินบาท ณ วันที่คำนวณผลตอบแทน

คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวมมิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต
- กองทุนที่ไม่เหมาะสมกับผู้ลงทุนที่ต้องการผลตอบแทนอย่างสม่ำเสมอหรือต้องการรักษาเงินต้น ผู้ลงทุนโปรดศึกษาและลงทุนให้เหมาะสมกับระดับความเสี่ยงที่ยอมรับได้

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

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือบริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่องได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

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 : -59.36%

Recovering Period : N/A

FX Hedging : ตามดุลยพินิจผู้จัดการกองทุน

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน : 0.02 เท่า

Sharpe Ratio : -0.34

Alpha : 1.07%

Beta : 0.92

Tracking Error : 2.66%

อายุเฉลี่ยของตราสารหนี้ : N/A

Yield to Maturity : N/A

หมายเหตุ: ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน ภายใน 5 วันทำการนับตั้งแต่วันถัดจากวันรับซื้อคืนหน่วยลงทุน ทั้งนี้ ปัจจุบัน ผู้ถือหน่วยลงทุนจะได้รับเงินค่าขายหน่วยลงทุน ภายใน 3 วันทำการนับตั้งแต่วันถัดจากวันรับซื้อคืนหน่วยลงทุน โดยไม่นับรวมวันหยุดทำการของผู้ประกอบธุรกิจการจัดการกองทุนต่างประเทศที่มีลักษณะในทำนองเดียวกับธุรกิจการจัดการกองทุนรวม และผู้ประกอบธุรกิจที่เกี่ยวข้องในต่างประเทศซึ่งจะส่งผลกระทบต่อราคาชำระราคา

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	2.1400	1.1318
รวมค่าใช้จ่าย	3.9500	1.2216

หมายเหตุ

1. ค่าธรรมเนียมรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว

2. 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

1. ค่าธรรมเนียมรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว

2. บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน

ประเภททรัพย์สิน	สัดส่วน % ของพอร์ต
หน่วยลงทุน KraneShares MSCI China Clean Technology Index ETF (KGRN)	99.00
เงินฝากหรือตราสารหนี้ที่สถาบันการเงินเป็นผู้ออก	0.29
• เงินฝาก ธนาคาร ยูโอบี จำกัด (มหาชน) 0.26	
• เงินฝาก ธนาคารอาร์ เอช บี จำกัด 0.03	
ทรัพย์สินและหนี้สินอื่น ๆ	0.71
• เงินฝาก BAY (THB) 0.86	
• หนี้สิน -0.15	

การจัดสรรการลงทุนในต่างประเทศ

N/A

การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม / ผู้ออกตราสาร 5 อันดับแรก

N/A

การจัดสรรการลงทุนตามอันดับความน่าเชื่อถือ (%)

N/A

ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก

ชื่อหลักทรัพย์	สัดส่วน % ของพอร์ต
หน่วยลงทุน KraneShares MSCI China Clean Technology Index ETF (KGRN)	99.00

การลงทุนในกองทุนอื่นเกินกว่า 20% (กองต่างประเทศ)

ชื่อกองทุน : KraneShares MSCI China Clean Technology Index ETF

ISIN code : US5007678502

Bloomberg code : KGRN

คำอธิบาย

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

Recovering Period ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาดังแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินลงทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลานานเท่าใด

FX Hedging เพอร์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตกองทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลานึง 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 สูงกว่าจะเป็นกองทุนที่มีประสิทธิภาพในการบริหารจัดการลงทุนที่ดีกว่า 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 โดยใช้วิธีอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมตราสารหนี้ คำนวณจากค่าเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักของ Yield to Maturity ของตราสาร

หนี้แต่ละตัวที่กองทุนมีการลงทุน และเนื่องจาก Yield to Maturity มีหน่วยมาตรฐานเป็นเปอร์เซ็นต์ต่อปี จึงสามารถนำไปใช้เปรียบเทียบอัตราผลตอบแทนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ ที่มีนโยบายถือครองตราสารหนี้จนครบกำหนดอายุและมีลักษณะการลงทุนที่ใกล้เคียงกันได้

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนรวม ฟิลลิป จำกัด

โทรศัพท์ : 0-2153-9200 ต่อ 1187

www.phillippasset.co.th

ที่อยู่ 849 อาคารวรวัฒน์ ชั้น 22 ห้อง 2201

ถ.สีลม แขวงสีลม เขตบางรัก

กรุงเทพมหานคร 10500