

กองทุนเปิด ฟิลลิป ทองคำ Phillip Gold Fund (PGOLD)

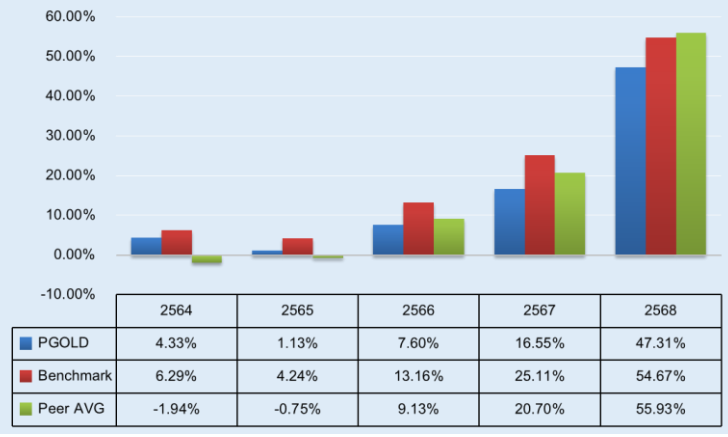
ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมทรัพย์สินทางเลือก, กองทุนรวมฟิวดเจอร์
- กองทุนรวมที่เน้นลงทุนแบบมีความเสี่ยงต่างประเทศ
- กลุ่ม Commodities Precious Metals

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- ลงทุนในหน่วยลงทุนของ SPDR Gold Trust (กองทุนปลายทาง) เพียงกองทุนเดียวเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของ NAV
- กองทุนปลายทางบริหารจัดการลงทุนโดย World Gold Trust Services, LLC ที่ถือหุ้นโดย World Gold Council (WGC)
- กองทุน PGOLD อาจลงทุนใน Derivatives เพื่อป้องกันความเสี่ยง (Hedging) จากอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศโดยขึ้นอยู่กับดุลยพินิจของผู้จัดการกองทุน ซึ่งพิจารณาสถานะของตลาดในขณะนั้น
- กองทุนมุ่งหวังให้ผลประโยชน์การเคลื่อนไหวตามดัชนีชี้วัด (Passive Management)

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (%ต่อปี)



ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด

Fund	YTD	3M	6M	1Y*
PGOLD	8.04	-7.88	13.90	31.14
Benchmark	9.40	-4.00	16.04	36.52
Peer AVG	5.64	-8.77	12.96	33.51
PGOLD (SD)	40.79	42.89	34.19	26.83
Benchmark (SD)	31.01	28.83	26.62	22.47

Fund	3Y*	5Y*	10Y*	Inception*
PGOLD	23.68	16.77	9.10	5.66
Benchmark	30.49	22.23	12.85	9.28
Peer AVG	26.45	17.23	10.27	
PGOLD (SD)	18.16	15.68	13.91	14.89
Benchmark (SD)	17.29	15.97	14.74	15.87

หมายเหตุ : * % ต่อปี

ระดับความเสี่ยง



ความเสี่ยงสูงมาก

ลงทุนในทรัพย์สินทางเลือก เช่น ทองคำ โดยเฉลี่ยในรอบปีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน : 30 ต.ค. 2552
 วันเริ่มต้น class : -
 นโยบายการจ่ายเงินปันผล : ไม่มีนโยบายจ่ายเงินปันผล
 อายุกองทุน : ไม่กำหนด
 การป้องกันความเสี่ยง FX : ตามดุลยพินิจ
 การเรียกเก็บค่าธรรมเนียมตามผลการดำเนินงาน : ไม่มี

ผู้จัดการกองทุนรวม

นายพุทธิพันธ์ วชิราคม ตั้งแต่วันที่ 04 ก.ย. 2566
 นายสุชาติ เจริญวุฒิคุณ ตั้งแต่วันที่ 24 ส.ค. 2566

ดัชนีชี้วัด :

LBMA Gold Price PM สัดส่วน 100%
 ปรับด้วยอัตราแลกเปลี่ยนเพื่อเปรียบเทียบกับค่าสกุลเงินบาท ณ วันที่คำนวณโดยใช้ค่ากลางระหว่างราคาเสนอซื้อ (BID) และราคาเสนอขาย (OFFER) ที่ประกาศโดย Bloomberg โดยใช้ข้อมูลอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศล่าสุด ณ 16.00 น. หรือเวลาใกล้เคียงที่สุดถัดจากเวลาที่กำหนดของวันคำนวณมูลค่าทรัพย์สินสุทธิเป็นเกณฑ์ในการคำนวณ

คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวมไม่ได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต
- กองทุนที่ไม่เหมาะสมกับผู้ลงทุนที่ต้องการผลตอบแทนอย่างสม่ำเสมอหรือต้องการรักษาเงินต้น ผู้ลงทุนโปรดศึกษาและลงทุนให้เหมาะสมกับระดับความเสี่ยงที่ยอมรับได้

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

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเรื่องมีอบริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่องได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

การซื้อขายหน่วยลงทุน

วันทำการซื้อ : ทุกวันทำการ

เวลาทำการ : 8.30 - 14:30 น.

การซื้อขายครั้งแรกขั้นต่ำ : ไม่กำหนด

การซื้อขายครั้งถัดไปขั้นต่ำ : ไม่กำหนด

การขายคืนหน่วยลงทุน

วันทำการขายคืน : ทุกวันทำการ

เวลาทำการ : 8.30 - 12.00 น.

การขายคืนขั้นต่ำ : ไม่กำหนด

ยอดคงเหลือขั้นต่ำ : ไม่กำหนด

ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน : T+3 คือ 3 วัน

ทำการหลังจากวันทำการขายคืน

ข้อมูลเชิงสถิติ

Maximum Drawdown : -18.81%

Recovering Period : N/A

FX Hedging : ตามดุลยพินิจผู้จัดการกองทุน

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน : 0.16 เท่า

Sharpe Ratio : 1.26

Alpha : -6.81%

Beta : 0.66

Tracking Error : 19.98%

อายุเฉลี่ยของตราสารหนี้ : N/A

Yield to Maturity : N/A

หมายเหตุ : ขอสงวนสิทธิ์ในการเปลี่ยนแปลงระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืนจริง ทั้งนี้ไม่เกิน 5 วันทำการหลังจากวันทำการขายคืน โดยมีให้นับรวมวันหยุดทำการในต่างประเทศ

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)

ค่าธรรมเนียมต่อไปนี้จะส่งผลกระทบต่อผู้ลงทุน เนื่องจากจะทำให้ผลตอบแทนจากการลงทุนลดลง ดังนั้น ผู้ลงทุนควรตรวจสอบทุกครั้งก่อนตัดสินใจลงทุน

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	1.6050	1.1819
ค่าตอบแทนแก่ตัวแทนขายหน่วยลงทุนของกองทุนรวม (trailer fee) : มี		
รวมค่าใช้จ่าย	3.7450	3.4710

หมายเหตุ

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

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย) ผู้ลงทุนจะถูกเรียกเก็บค่าธรรมเนียม

ต่อไปนี้โดยตรงทุกครั้งเมื่อทำการซื้อขายหรือสับเปลี่ยนหน่วยลงทุน

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

หมายเหตุ

- ค่าธรรมเนียมรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว
- บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ

การจัดสรรการลงทุนในต่างประเทศ

N/A

การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม / ผู้ออกตราสาร 5 อันดับแรก

N/A

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน

ประเภททรัพย์สิน	สัดส่วน % ของพอร์ต
หน่วยลงทุน	94.86
เงินฝากสถาบันการเงิน	0.10
ทรัพย์สิน/หนี้สินอื่น ๆ	5.03

ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก

ชื่อหลักทรัพย์	สัดส่วน % ของพอร์ต
SPDR GOLD TRUST	94.86
เงินฝากธนาคาร ยูโอบี จำกัด (มหาชน)	0.10

การจัดสรรการลงทุนตามอันดับความน่าเชื่อถือ (%)

N/A

การลงทุนในกองทุนอื่นเกินกว่า 20% (กองต่างประเทศ)

ชื่อกองทุน : SPDR GOLD TRUST

ISIN code : US78463V1070

Bloomberg code : 2840 HK

คำอธิบาย

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

Recovering Period ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาตั้งแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้เวลานานเท่าใด

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 โดยใช้ใช้วัดอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมตราสารหนี้ คำนวณจากค่าเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักของ Yield to Maturity ของตราสารหนี้แต่ละตัวที่กองทุนมีการลงทุน และเนื่องจาก Yield to Maturity มีหน่วยมาตรฐานเป็นเปอร์เซ็นต์ต่อปี จึงสามารถนำไปใช้เปรียบเทียบอัตราผลตอบแทนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีนโยบายถือครองตราสารหนี้จนครบกำหนดอายุและมีลักษณะการลงทุนที่ใกล้เคียงกันได้

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนรวม ฟิลลิป จำกัด

โทรศัพท์ : 0-2153-9200 ต่อ 1187

www.phillipasset.co.th

ที่อยู่ 849 อาคารวิวัฒน์ ชั้น 22 ห้อง 2201

ถ.สีลม แขวงสีลม เขตบางรัก

กรุงเทพมหานคร 10500