

## กองทุนเปิดฟิลลิปบริหารเงิน

### PHILLIP CASH MANAGEMENT OPEN END FUND (PCASH)

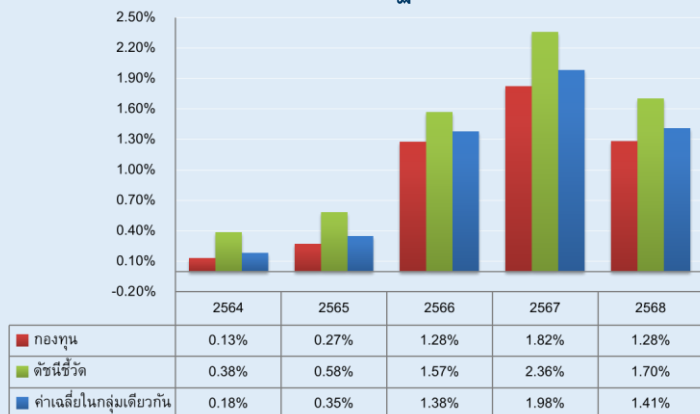
#### ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมตราสารหนี้, กองทุนรวมตลาดเงิน
- กองทุนที่ลงทุนแบบไม่มีความเสี่ยงต่างประเทศ
- กลุ่ม Money Market Government

#### นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- ลงทุนในตราสารแห่งหนี้ และ/หรือ เงินฝาก หรือตราสารการเงินอื่นใดที่มีกำหนดชำระคืนเมื่อทวงถาม หรือจะครบกำหนดชำระคืนไม่เกิน 397 วัน นับแต่วันที่ลงทุน
- กองทุนจะดำรงพอร์ตโฟลิโอ ดูเรชั่น (Portfolio Duration) ของกองทุน ณ ขณะใดขณะหนึ่งไม่เกิน 92 วัน
- ไม่ลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า และตราสารที่มีลักษณะของสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแฝง (Structured Notes)
- มุ่งหวังให้ผลประกอบการสูงกว่าดัชนี (Active Management)

#### ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (%ต่อปี)



#### ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปึกหมุด

|                          | YTD    | 3 เดือน | 6 เดือน | 1 ปี *           |
|--------------------------|--------|---------|---------|------------------|
| กองทุน                   | 0.43   | 0.12    | 0.30    | 0.77             |
| ดัชนีชี้วัด              | 0.65   | 0.20    | 0.46    | 1.13             |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน | 0.51   | 0.16    | 0.36    | 0.89             |
| ความผันผวนกองทุน         | 0.04   | 0.03    | 0.04    | 0.04             |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด    | 0.09   | 0.07    | 0.08    | 0.09             |
|                          | 3 ปี * | 5 ปี *  | 10 ปี * | ตั้งแต่จัดตั้ง * |
| กองทุน                   | 1.36   | 1.03    | 0.96    | 1.47             |
| ดัชนีชี้วัด              | 1.80   | 1.40    | 1.31    | 1.80             |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน | 1.51   | 1.15    | 0.96    |                  |
| ความผันผวนกองทุน         | 0.07   | 0.07    | 0.06    | 0.09             |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด    | 0.12   | 0.11    | 0.10    | 0.12             |
| หมายเหตุ : * % ต่อปี     |        |         |         |                  |

#### ระดับความเสี่ยง

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

ลงทุนในเงินฝาก ตราสารเทียบเท่าเงินฝาก พันธบัตรรัฐบาลหรือพันธบัตร ธปท. ซึ่งอายุไม่เกิน 397 วัน โดยไม่มีความเสี่ยงต่างประเทศ

#### ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน : 07 ส.ค. 2550

วันเริ่มต้น class : -

นโยบายการจ่ายเงินปันผล : ไม่มีนโยบายจ่ายเงินปันผล

อายุกองทุน : ไม่กำหนด

การป้องกันความเสี่ยง FX : -

การเรียกเก็บค่าธรรมเนียมตามผลการดำเนินงาน : ไม่มี

#### ผู้จัดการกองทุนรวม

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

#### ดัชนีชี้วัด :

ผลตอบแทนรวมของดัชนีตราสารหนี้ภาครัฐระยะสั้น (ThaiBMA Short term Government Bond Index Total Return) สัดส่วน 100% โดยมีวัตถุประสงค์เพื่อเปรียบเทียบกับผลการดำเนินงานของกองทุนรวม (Performance Objective)

#### คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
  - ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวมมิได้เป็นที่ยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต
  - กองทุนที่ไม่เหมาะสมกับผู้ลงทุนที่ต้องการผลตอบแทนอย่างสม่ำเสมอหรือต้องการรักษาเงินต้น
- ผู้ลงทุนโปรดศึกษาและลงทุนให้เหมาะสมกับระดับความเสี่ยงที่ยอมรับได้

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต : ไม่ได้เข้าร่วม CAC / ไม่มีบริษัทแม่ดูแลให้ทำตามกฎหมาย

ผู้ลงทุนสามารถศึกษา  
เครื่องมือบริหารความเสี่ยง  
ด้านสภาพคล่องได้ใน  
หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



การซื้อหน่วยลงทุน

วันทำการซื้อ : ทุกวันทำการ

เวลาทำการ : 08.30 – 15.30 น.

การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ : ไม่กำหนด

การซื้อครั้งถัดไปขั้นต่ำ : ไม่กำหนด

การขายคืนหน่วยลงทุน

วันทำการขายคืน : ทุกวันทำการ

เวลาทำการ : 08.30 – 15.00 น.

การขายคืนขั้นต่ำ : ไม่กำหนด

ยอดคงเหลือขั้นต่ำ : ไม่กำหนด

ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน : T+1 คือ 1 วันทำการหลังจากวันทำการขายคืน

หมายเหตุ : ขอสงวนสิทธิ์ในการเปลี่ยนแปลงระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืนจริง ทั้งนี้ไม่เกิน 5 วันทำการหลังจากวันทำการขายคืน

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)

ค่าธรรมเนียมต่อไปนี้จะส่งผลกระทบต่อผู้ลงทุน เนื่องจากจะทำให้ผลตอบแทนจากการลงทุนลดลง ดังนั้นผู้ลงทุนควรตรวจสอบทุกครั้งก่อนตัดสินใจลงทุน

| ค่าธรรมเนียม                                                   | สูงสุดไม่เกิน | เก็บจริง |
|----------------------------------------------------------------|---------------|----------|
| การจัดการ                                                      | 0.6420        | 0.1605   |
| ค่าตอบแทนแก่ตัวแทนขายหน่วยลงทุนของกองทุนรวม (trailer fee) : มี |               |          |
| รวมค่าใช้จ่าย                                                  | 1.6050        | 0.2708   |

หมายเหตุ

1. ค่าธรรมเนียมรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว

2. รวมค่าใช้จ่าย ประกอบด้วย ค่าธรรมเนียมการจัดการ ผู้ดูแลผลประโยชน์ นายทะเบียน และค่าใช้จ่ายอื่นโดยอัตราที่เรียกเก็บจริงของค่าใช้จ่ายอื่นเป็นข้อมูลตามรอบปีบัญชีหรือรอบ 6 เดือนล่าสุดของกองทุน

|                                                                                                                                                           |                           |                           |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------|---------------------------|
| ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย) ผู้ลงทุนจะถูกเรียกเก็บค่าธรรมเนียมต่อไปนี้อย่างตรงทุกครั้งที่ทำการขายหรือสับเปลี่ยนหน่วยลงทุน |                           |                           |
| ค่าธรรมเนียม                                                                                                                                              | สูงสุดไม่เกิน             | เก็บจริง                  |
| การขาย                                                                                                                                                    | ไม่มี                     | ไม่มี                     |
| การรับซื้อคืน                                                                                                                                             | ไม่มี                     | ไม่มี                     |
| การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า                                                                                                                               | ไม่มี                     | ไม่มี                     |
| การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก                                                                                                                                | ไม่มี                     | ไม่มี                     |
| การโอนหน่วย                                                                                                                                               | ตามที่นายทะเบียนเรียกเก็บ | ตามที่นายทะเบียนเรียกเก็บ |

หมายเหตุ

1. ค่าธรรมเนียมรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว

2. บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ

|                                            |                    |                                       |                    |
|--------------------------------------------|--------------------|---------------------------------------|--------------------|
| สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน             |                    | ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก         |                    |
| ประเภททรัพย์สิน                            | สัดส่วน % ของพอร์ต | ชื่อหลักทรัพย์                        | สัดส่วน % ของพอร์ต |
| ตราสารหนี้ภาครัฐ                           | 88.83              | พันธบัตร ธนาคารแห่งประเทศไทย CB26N19A | 23.26              |
| เงินฝากสถาบันการเงิน                       | 0.26               | พันธบัตร ธนาคารแห่งประเทศไทย CB26O15A | 15.52              |
| • เงินฝาก ธนาคารอาร์ เอช บี จำกัด 0.19     |                    | พันธบัตร ธนาคารแห่งประเทศไทย CB26N12A | 13.18              |
| • เงินฝาก ธนาคาร ยูโอบี จำกัด (มหาชน) 0.07 |                    | พันธบัตร ธนาคารแห่งประเทศไทย CB26O08A | 12.81              |
| ทรัพย์สินและหนี้สินอื่น ๆ                  | 10.91              | พันธบัตร ธนาคารแห่งประเทศไทย CB26N05B | 8.14               |
| • เงินฝาก (THB, BAY) 10.97                 |                    |                                       |                    |
| • หนี้สิน -0.06                            |                    |                                       |                    |

|                                          |  |
|------------------------------------------|--|
| ข้อมูลเชิงสถิติ                          |  |
| Maximum Drawdown : -0.01%                |  |
| Recovering Period : 4 วัน                |  |
| FX Hedging : N/A                         |  |
| อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน : 2.44 เท่า   |  |
| Sharpe Ratio : N/A                       |  |
| Alpha : N/A                              |  |
| Beta : N/A                               |  |
| Tracking Error : N/A                     |  |
| อายุเฉลี่ยของตราสารหนี้ : 1 เดือน 17 วัน |  |
| Yield to Maturity : 0.84%                |  |

|                               |     |
|-------------------------------|-----|
| การจัดสรรการลงทุนในต่างประเทศ |     |
|                               | N/A |

|                             |                    |
|-----------------------------|--------------------|
| ผู้ออกตราสาร 5 อันดับแรก    |                    |
| ผู้ออกตราสาร                | สัดส่วน % ของพอร์ต |
| ธนาคารแห่งประเทศไทย         | 88.83              |
| ธนาคารอาร์ เอช บี จำกัด     | 0.19               |
| ธนาคาร ยูโอบี จำกัด (มหาชน) | 0.07               |

|                                               |          |
|-----------------------------------------------|----------|
| การจัดสรรการลงทุนตามอันดับความน่าเชื่อถือ (%) |          |
| อันดับความน่าเชื่อถือ                         | ในประเทศ |
| Government bond / AAA                         | 88.83    |
| AA                                            | n/a      |
| A                                             | n/a      |
| BBB                                           | n/a      |
| below BBB                                     | n/a      |
| Unrated                                       | n/a      |

## คำอธิบาย

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

**Recovering Period** ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาดังแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลานานเท่าใด

**FX Hedging** เพอร์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

**อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน** ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตกองทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลาหนึ่ง 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 โดยใช้ตัวอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมตราสารหนี้ คำนวณจากค่าเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักของ Yield to Maturity ของตราสาร

หนี้แต่ละตัวที่กองทุนมีการลงทุน และเนื่องจาก Yield to Maturity มีหน่วยมาตรฐานเป็นเปอร์เซ็นต์ต่อปี จึงสามารถนำไปใช้เปรียบเทียบอัตราผลตอบแทนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีนโยบายถือครองตราสารหนี้จนครบกำหนดอายุและมีลักษณะการลงทุนที่ใกล้เคียงกันได้

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนรวม ฟิลลิป จำกัด

โทรศัพท์ : 0-2153-9200 ต่อ 1187

www.phillipasset.co.th

ที่อยู่ 849 อาคารวรวิวัฒน์ ชั้น 22 ห้อง 2201

ถ.สีลม แขวงสีลม เขตบางรัก

กรุงเทพมหานคร 10500