

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน เอ็มเอฟซี จำกัด (มหาชน)

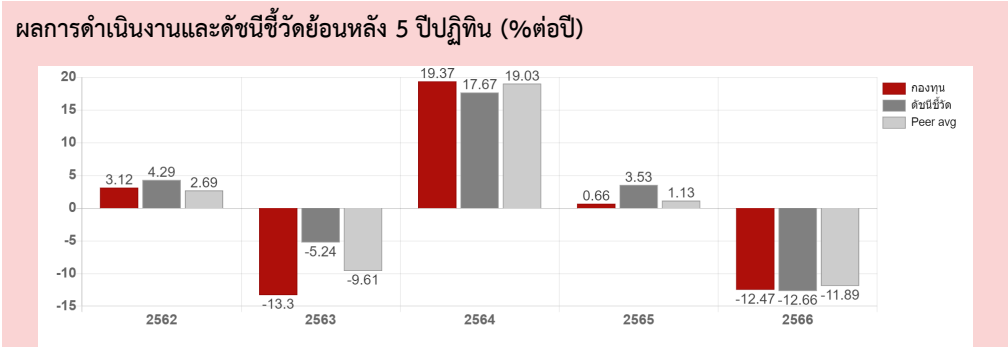
กองทุนเปิดร่วมพัฒนาสอง

Ruam Pattana Two Open-end Fund

RPF2

- ประเภทกองทุนรวม/กลุ่มกองทุนรวม
- กองทุนรวมตราสารทุน
 - กองทุนรวมที่มีนโยบายเปิดให้มีการลงทุนในกองทุนรวมอื่นภายใต้ บลจ. เดียวกัน (Cross Investing Fund)
 - กลุ่มกองทุนรวม: Equity General

- นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน
- ลงทุนในหลักทรัพย์ประเภทหุ้นทุนของกิจการที่มีปัจจัยพื้นฐานดี และมีแนวโน้มการเติบโตสูงในระยะปานกลางถึงระยะยาว
 - กองทุนมุ่งหวังให้ผลประกอบการสูงกว่าดัชนีชี้วัด (Active Management)



| | YTD | 3 เดือน | 6 เดือน | 1 ปี |
|--------------------------|-------|---------|---------|----------------|
| กองทุน | -1.96 | 0.96 | 0.74 | -10.45 |
| ดัชนีชี้วัด | -1.20 | 1.70 | 1.37 | -10.13 |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน | -3.63 | -0.31 | -1.03 | -11.42 |
| ความผันผวนกองทุน | 11.04 | 11.37 | 11.04 | 11.38 |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด | 10.82 | 11.47 | 10.98 | 11.17 |
| | 3 ปี | 5 ปี | 10 ปี | ตั้งแต่จัดตั้ง |
| กองทุน | -3.60 | -2.52 | 1.04 | 10.67 |
| ดัชนีชี้วัด | -3.14 | -0.87 | 1.72 | N/A** |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน | -4.17 | -2.41 | 0.28 | - |
| ความผันผวนกองทุน | 11.59 | 16.37 | 14.16 | 19.85 |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด | 11.05 | 16.76 | 14.44 | N/A** |

* ผลตอบแทนที่มีอายุเกินหนึ่งปีจะแสดงเป็นผลตอบแทนต่อปี

** ไม่มีข้อมูลตัวชี้วัดที่เป็น TRI ครอบคลุมระยะเวลาการลงทุนดังกล่าว

ระดับความเสี่ยง

ต่ำ

1

2

3

4

5

6

7

8

สูง

เสี่ยงสูง

ลงทุนในตราสารทุนเป็นหลัก โดยเฉลี่ยในรอบปีไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม :

วันจดทะเบียนกองทุน 22 ก.ย. 2543

นโยบายการจ่ายเงินปันผล จ่าย

อายุกองทุน ไม่กำหนด

- ผู้จัดการกองทุนรวม :
- นายวิภ เฉลียวจิตติกุล (ตั้งแต่ 21 ส.ค. 2562)
 - นายรุ่งโรจน์ นิลนพคุณ (ตั้งแต่ 25 ก.ค. 2566)

ดัชนีชี้วัด :

ดัชนีผลตอบแทนรวมตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET TRI) สัดส่วน 100%


- คำเตือน
- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
 - ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวมมิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต : ได้รับการรับรองจาก CAC

จัดอันดับกองทุน Morningstar : ★★★★★

ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือบริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่องได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



www.mfcfund.com

| การซื้อขายหน่วยลงทุน | | การขายคืนหน่วยลงทุน | |
|----------------------------|------------------|---|------------------|
| วันทำการซื้อ : | ทุกวันทำการ | วันทำการขายคืน : | ทุกวันทำการ |
| เวลาทำการ : | 08:30 - 15:30 น. | เวลาทำการ : | 08:30 - 15:30 น. |
| การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ : | 10,000 บาท | การขายคืนขั้นต่ำ : | ไม่กำหนด |
| การซื้อครั้งถัดไปขั้นต่ำ : | 1,000 บาท | ยอดคงเหลือขั้นต่ำ : | ไม่กำหนด |
| | | ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน : | T+3 |
| | | 3 วันทำการนับแต่วันรับซื้อคืนหน่วยลงทุน | |

| ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV) ¹ | | |
|---|---------------|----------|
| ค่าธรรมเนียม | สูงสุดไม่เกิน | เก็บจริง |
| การจัดการ | 0.9630 | 0.9630 |
| รวมค่าใช้จ่าย ² | 2.2100 | 1.1754 |
| หมายเหตุ : | | |
| 1. ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว | | |
| 2. การรวมค่าใช้จ่ายที่เก็บจริง คิดตามรอบบัญชีของกองทุน | | |

| ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย) ¹ | | |
|---|---------------|---------------|
| ค่าธรรมเนียม | สูงสุดไม่เกิน | เก็บจริง |
| การขาย | 1.00 | 0.50 |
| การรับซื้อคืน | 1.00 | ไม่มี |
| การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า ² | ไม่มี | ไม่มี |
| การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก ³ | ไม่มี | ไม่มี |
| การโอนหน่วย | 50 บาท/รายการ | 50 บาท/รายการ |
| หมายเหตุ : | | |
| 1. ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว | | |
| 2. ผู้ถือหน่วยลงทุนจะสับเปลี่ยนเข้าที่ราคาขาย ซึ่งเท่ากับ มูลค่าหน่วยลงทุนที่ใช้เพื่อการคำนวณราคาขาย + ค่าธรรมเนียมการขาย (ถ้ามี) | | |
| 3. ผู้ถือหน่วยลงทุนจะสับเปลี่ยนออกที่ราคารับซื้อคืน ซึ่งเท่ากับ มูลค่าหน่วยลงทุนที่ใช้เพื่อการคำนวณราคารับซื้อคืน - ค่าธรรมเนียมการรับซื้อคืน (ถ้ามี) | | |

| สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน | |
|--------------------------------|-------|
| Breakdown | %NAV |
| หุ้นสามัญ | 95.23 |
| เงินฝากธนาคาร และอื่นๆ | 4.14 |
| หน่วยลงทุน | 0.63 |

| ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก | |
|--------------------------------------|------|
| Holding | %NAV |
| บมจ.ท่าอากาศยานไทย | 6.36 |
| บมจ.ซีพี ออลล์ | 5.85 |
| บมจ.เดลต้า อีเลคโทรนิคส์ (ประเทศไทย) | 5.65 |
| บมจ.แอดวานซ์ อินโฟร์ เซอร์วิส | 4.87 |
| บมจ.กัลฟ์ เอ็นเนอร์จี ดีเวลลอปเม้นท์ | 4.18 |

| ข้อมูลเชิงสถิติ | |
|----------------------------|---------------------|
| Maximum Drawdown | -34.17% |
| Recovering Period | 1 ปี 9 เดือน 17 วัน |
| Sharpe Ratio | -0.47 |
| Alpha | -0.46% |
| Beta | 0.96 |
| อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน | 0.58 เท่า |

| การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม 5 อันดับแรก | |
|--|-------|
| กลุ่มอุตสาหกรรม | %NAV |
| พลังงาน | 16.14 |
| พาณิชย์ | 12.60 |
| ธนาคาร | 10.55 |
| เทคโนโลยีสารสนเทศและการสื่อสาร | 9.16 |
| ชิ้นส่วนอิเล็กทรอนิกส์ | 7.75 |

คำอธิบาย

- **Maximum Drawdown:** เพอร์เซ็นต์ผลขาดทุนสูงสุดของกองทุนรวมในระยะเวลา 5 ปีย้อนหลัง (หรือตั้งแต่จัดตั้งกองทุนกรณีที่ยังไม่ครบ 5 ปี) โดยวัดจากระดับ NAV ต่อหน่วยที่จุดสูงสุดไปจนถึงจุดต่ำสุดในช่วงที่ NAV ต่อหน่วยปรับตัวลดลง ค่า Maximum Drawdown เป็นข้อมูลที่ช่วยให้ทราบถึงความเสี่ยงที่อาจจะขาดทุน จากการลงทุนในกองทุนรวม
- **Recovering Period:** ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาดังแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลานานเท่าใด
- **FX Hedging:** เพอร์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน
- **อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน:** ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตกองทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลาหนึ่ง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์กับผลรวมของมูลค่าการขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 1 ปีหารด้วยมูลค่า NAV ของกองทุนรวมเฉลี่ยในรอบระยะเวลาเดียวกัน กองทุนรวมที่มีค่า portfolio turnover สูง บ่งชี้ถึงการซื้อขายหลักทรัพย์บ่อยครั้งของผู้จัดการกองทุนและทำให้มีต้นทุนการซื้อขายหลักทรัพย์ที่สูง จึงต้องพิจารณาเปรียบเทียบกับผลการดำเนินงานของกองทุนรวม เพื่อประเมินความคุ้มค่าของการซื้อขายหลักทรัพย์ดังกล่าว
- **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 แสดงว่าหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนน้อยกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด Beta มากกว่า 1 แสดงว่าหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนมากกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด
- **Tracking Error:** อัตราผลตอบแทนของกองทุนมีประสิทธิภาพในการเลียนแบบดัชนีชี้วัด โดยหาก tracking error ต่ำ หมายถึงกองทุนรวมมีประสิทธิภาพในการสร้างผลตอบแทนให้ใกล้เคียงกับดัชนีชี้วัด กองทุนรวมที่มีค่า tracking error สูง จะมีอัตราผลตอบแทนโดยเฉลี่ยห่างจากดัชนีชี้วัดมากขึ้น
- **Yield to Maturity:** อัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในตราสารหนี้โดยถือจนครบกำหนดอายุ ซึ่งคำนวณจากดอกเบี้ยที่จะได้รับในอนาคตตลอดอายุตราสารและเงินต้นที่จะได้รับคืนนำมาคิดลดเป็นมูลค่าปัจจุบัน โดยใช้วัดอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมตราสารหนี้ คำนวณจากค่าเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักของ Yield to Maturity ของตราสารหนี้แต่ละตัวที่กองทุนมีการลงทุน และเนื่องจาก Yield to Maturity มีหน่วยมาตรฐานเป็นเปอร์เซ็นต์ต่อปี จึงสามารถนำไปใช้เปรียบเทียบอัตราผลตอบแทนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีนโยบายถือครองตราสารหนี้จนครบกำหนดอายุและมีลักษณะการลงทุนที่ใกล้เคียงกันได้

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน เอ็มเอฟซี จำกัด (มหาชน)

เลขที่ 199 อาคารคอลัมน์ทาวเวอร์ ชั้น จี และชั้น 21-23

ถนนรัชดาภิเษก เขตคลองเตย กรุงเทพฯ 10110

โทรศัพท์: 0-2649-2000 www.mfcfund.com