

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน เอ็มเอฟซี จำกัด (มหาชน)

กองทุนเปิดเอ็มเอฟซี หุ้นไทย เมกะ

MFC MEGA Thai Stocks Fund

ชนิดจ่ายเงินปันผล : M-MEGA-D

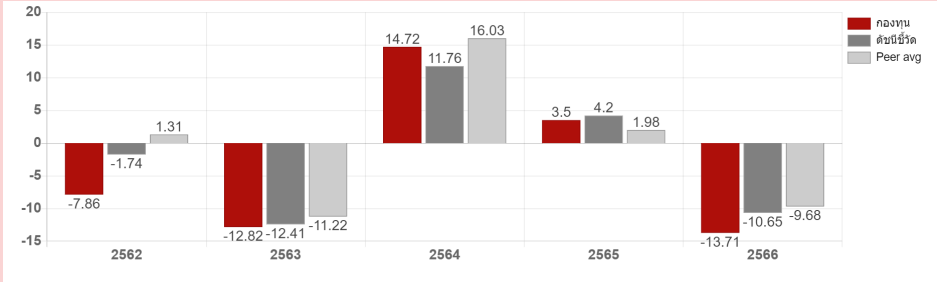
ประเภทกองทุนรวม/กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมตราสารทุน
- กลุ่มกองทุนรวม: Equity Large Cap

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- ลงทุนในหุ้นที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย ที่เป็นส่วนประกอบของดัชนี SET50 จำนวนไม่เกิน 35 บริษัท โดยคัดเลือกหุ้นที่มีปัจจัยพื้นฐานดี และ/หรือ มีศักยภาพในการเจริญเติบโตดี ประกอบกับการวิเคราะห์ทางเทคนิค และจะให้น้ำหนักการลงทุนในหุ้นที่ผ่านเกณฑ์การคัดเลือกเพื่อให้พอร์ตการลงทุนมีความผันผวนน้อยที่สุด
- กองทุนมุ่งหวังให้ผลประกอบการสูงกว่าดัชนีชี้วัด (active management)

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (%ต่อปี)



ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด (%ต่อปี)

| | YTD | 3 เดือน | 6 เดือน | 1 ปี |
|--------------------------|-------|---------|---------|----------------|
| กองทุน | -1.85 | -1.85 | -5.71 | -11.12 |
| ดัชนีชี้วัด | -2.40 | -2.40 | -4.73 | -10.79 |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน | -2.36 | -2.36 | -5.22 | -8.63 |
| ความผันผวนกองทุน | 10.51 | 10.51 | 11.51 | 11.14 |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด | 10.80 | 10.80 | 12.03 | 11.93 |
| | 3 ปี | 5 ปี | 10 ปี | ตั้งแต่จัดตั้ง |
| กองทุน | -3.57 | - | - | -4.20 |
| ดัชนีชี้วัด | -1.91 | - | - | -2.67 |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน | -2.16 | - | - | - |
| ความผันผวนกองทุน | 11.52 | - | - | 16.06 |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด | 11.90 | - | - | 18.76 |

* ผลตอบแทนที่มีอายุเกินหนึ่งปีจะแสดงเป็นผลตอบแทนต่อปี

ระดับความเสี่ยง



ลงทุนในตราสารทุนเป็นหลัก โดยเฉลี่ยในรอบปีไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม :

| | |
|------------------------|---------------|
| วันจดทะเบียนกองทุน | 10 เม.ย. 2562 |
| วันเริ่มต้น class | 10 เม.ย. 2562 |
| นโยบายการจ่ายเงินปันผล | จ่าย |
| อายุกองทุน | ไม่กำหนด |

ผู้จัดการกองทุนรวม :

- นายประวีร์ อัจฉิมกุล (ตั้งแต่ 17 ธ.ค. 2562)
- นายรุ่งโรจน์ นิลนพคุณ (ตั้งแต่ 25 ก.ค. 2566)

ดัชนีชี้วัด :

ดัชนีผลตอบแทนรวม SET50 (SET50 TRI) สัดส่วน 100%

คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวมไม่ได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต : ได้รับการรับรองจาก CAC

จัดอันดับกองทุน Morningstar : ★★★★★

ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือ

บริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่อง

ได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



www.mfcfund.com

| การซื้อขายหน่วยลงทุน | | การขายคืนหน่วยลงทุน | |
|----------------------------|------------------|---|------------------|
| วันทำการซื้อ : | ทุกวันทำการ | วันทำการขายคืน : | ทุกวันทำการ |
| เวลาทำการ : | 08:30 - 15:30 น. | เวลาทำการ : | 08:30 - 15:30 น. |
| การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ : | 1,000 บาท | การขายคืนขั้นต่ำ : | ไม่กำหนด |
| การซื้อครั้งถัดไปขั้นต่ำ : | 500 บาท | ยอดคงเหลือขั้นต่ำ : | ไม่กำหนด |
| | | ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน : | T+3 |
| | | 3 วันทำการนับแต่วันรับซื้อคืนหน่วยลงทุน | |

| ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV) ¹ | | |
|---|---------------|----------|
| ค่าธรรมเนียม | สูงสุดไม่เกิน | เก็บจริง |
| การจัดการ | 2.1400 | 0.8025 |
| รวมค่าใช้จ่าย ² | 4.4619 | 1.0485 |
| หมายเหตุ : | | |
| 1. ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว | | |
| 2. การรวมค่าใช้จ่ายที่เก็บจริง คิดตามรอบบัญชีของกองทุน | | |

| ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย) ¹ | | |
|---|---------------|---------------|
| ค่าธรรมเนียม | สูงสุดไม่เกิน | เก็บจริง |
| การขาย | 0.50 | 0.50 |
| การรับซื้อคืน | 0.50 | 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) | | |
| 4. ค่าใช้จ่ายซื้อขายหลักทรัพย์ 0.10% ของมูลค่าซื้อขาย (เก็บจริง) | | |

| สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน | |
|--------------------------------|-------|
| Breakdown | %NAV |
| หุ้นสามัญ | 96.39 |
| เงินฝากธนาคาร และอื่นๆ | 3.61 |

| ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก | |
|--------------------------------------|------|
| Holding | %NAV |
| บมจ.ท่าอากาศยานไทย | 8.43 |
| บมจ.ปตท. | 7.80 |
| บมจ.เดลต้า อีเลคโทรนิคส์ (ประเทศไทย) | 7.39 |
| บมจ.ซีพี ออลล์ | 5.73 |
| บมจ.แอดวานซ์ อินโฟร์ เซอร์วิส | 5.17 |

| ข้อมูลเชิงสถิติ | |
|----------------------------|-----------|
| Maximum Drawdown | -37.56% |
| Recovering Period | N/A |
| Sharpe Ratio | -0.39 |
| Alpha | -1.67% |
| Beta | 0.95 |
| อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน | 1.64 เท่า |

| การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม 5 อันดับแรก | |
|--|-------|
| กลุ่มอุตสาหกรรม | %NAV |
| พลังงาน | 23.31 |
| ธนาคาร | 11.97 |
| พาณิชย์ | 9.63 |
| เทคโนโลยีสารสนเทศและการสื่อสาร | 9.29 |
| ขนส่ง | 8.43 |

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 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 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

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน เอ็มเอฟซี จำกัด (มหาชน)

กองทุนเปิดเอ็มเอฟซี หุ้นไทย เมกะ

MFC MEGA Thai Stocks Fund

ชนิดสะสมมูลค่า : M-MEGA-A

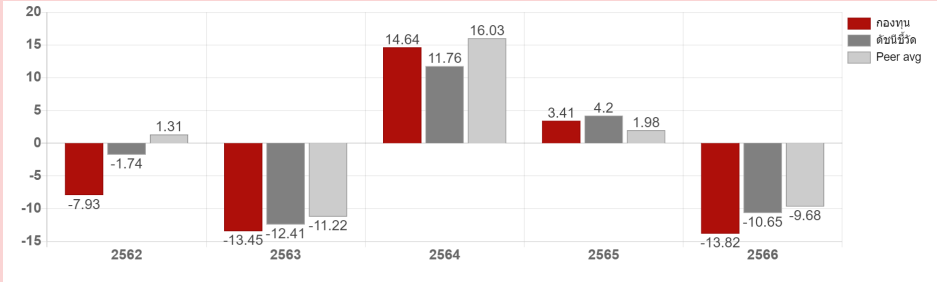
ประเภทกองทุนรวม/กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมตราสารทุน
- กลุ่มกองทุนรวม: Equity Large Cap

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- ลงทุนในหุ้นที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย ที่เป็นส่วนประกอบของดัชนี SET50 จำนวนไม่เกิน 35 บริษัท โดยคัดเลือกหุ้นที่มีปัจจัยพื้นฐานดี และ/หรือ มีศักยภาพในการเจริญเติบโตดี ประกอบกับการวิเคราะห์ทางเทคนิค และจะให้น้ำหนักการลงทุนในหุ้นที่ผ่านเกณฑ์การคัดเลือกเพื่อให้พอร์ตการลงทุนมีความผันผวนน้อยที่สุด
- กองทุนมุ่งหวังให้ผลประกอบการสูงกว่าดัชนีชี้วัด (active management)

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (%ต่อปี)



ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด (%ต่อปี)

| | YTD | 3 เดือน | 6 เดือน | 1 ปี |
|--------------------------|-------|---------|---------|----------------|
| กองทุน | -1.92 | -1.92 | -5.87 | -11.32 |
| ดัชนีชี้วัด | -2.40 | -2.40 | -4.73 | -10.79 |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน | -2.36 | -2.36 | -5.22 | -8.63 |
| ความผันผวนกองทุน | 10.53 | 10.53 | 11.54 | 11.15 |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด | 10.80 | 10.80 | 12.03 | 11.93 |
| | 3 ปี | 5 ปี | 10 ปี | ตั้งแต่จัดตั้ง |
| กองทุน | -3.66 | - | - | -4.42 |
| ดัชนีชี้วัด | -1.91 | - | - | -2.67 |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน | -2.16 | - | - | - |
| ความผันผวนกองทุน | 11.52 | - | - | 16.09 |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด | 11.90 | - | - | 18.76 |

* ผลตอบแทนที่มีอายุเกินหนึ่งปีจะแสดงเป็นผลตอบแทนต่อปี

ระดับความเสี่ยง



ลงทุนในตราสารทุนเป็นหลัก โดยเฉลี่ยในรอบปีไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม :

| | |
|------------------------|---------------|
| วันจดทะเบียนกองทุน | 10 เม.ย. 2562 |
| วันเริ่มต้น class | 10 เม.ย. 2562 |
| นโยบายการจ่ายเงินปันผล | ไม่จ่าย |
| อายุกองทุน | ไม่กำหนด |

ผู้จัดการกองทุนรวม :

- นายประวีร์ อัจฉิมกุล (ตั้งแต่ 17 ธ.ค. 2562)
- นายรุ่งโรจน์ นิลนพคุณ (ตั้งแต่ 25 ก.ค. 2566)

ดัชนีชี้วัด :

ดัชนีผลตอบแทนรวม SET50 (SET50 TRI) สัดส่วน 100%

คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวมไม่ได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต : ได้รับการรับรองจาก CAC

จัดอันดับกองทุน Morningstar : ★★★★★

ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือ

บริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่อง

ได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



www.mfcfund.com

| การซื้อขายหน่วยลงทุน | | การขายคืนหน่วยลงทุน | |
|----------------------------|------------------|---|------------------|
| วันทำการซื้อ : | ทุกวันทำการ | วันทำการขายคืน : | ทุกวันทำการ |
| เวลาทำการ : | 08:30 - 15:30 น. | เวลาทำการ : | 08:30 - 15:30 น. |
| การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ : | 1,000 บาท | การขายคืนขั้นต่ำ : | ไม่กำหนด |
| การซื้อครั้งถัดไปขั้นต่ำ : | 500 บาท | ยอดคงเหลือขั้นต่ำ : | ไม่กำหนด |
| | | ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน : | T+3 |
| | | 3 วันทำการนับแต่วันรับซื้อคืนหน่วยลงทุน | |

| ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV) ¹ | | |
|---|---------------|----------|
| ค่าธรรมเนียม | สูงสุดไม่เกิน | เก็บจริง |
| การจัดการ | 2.1400 | 0.8025 |
| รวมค่าใช้จ่าย ² | 4.4619 | 1.0485 |
| หมายเหตุ : | | |
| 1. ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว | | |
| 2. การรวมค่าใช้จ่ายที่เก็บจริง คิดตามรอบบัญชีของกองทุน | | |

| ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย) ¹ | | |
|---|---------------|---------------|
| ค่าธรรมเนียม | สูงสุดไม่เกิน | เก็บจริง |
| การขาย | 0.50 | 0.50 |
| การรับซื้อคืน | 0.50 | 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) | | |
| 4. ค่าใช้จ่ายซื้อขายหลักทรัพย์ 0.10% ของมูลค่าซื้อขาย (เก็บจริง) | | |

| สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน | |
|--------------------------------|-------|
| Breakdown | %NAV |
| หุ้นสามัญ | 96.39 |
| เงินฝากธนาคาร และอื่นๆ | 3.61 |

| ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก | |
|--------------------------------------|------|
| Holding | %NAV |
| บมจ.ท่าอากาศยานไทย | 8.43 |
| บมจ.ปตท. | 7.80 |
| บมจ.เดลต้า อิเลคโทรนิคส์ (ประเทศไทย) | 7.39 |
| บมจ.ซีพี ออลล์ | 5.73 |
| บมจ.แอดวานซ์ อินโฟร์ เซอร์วิส | 5.17 |

| ข้อมูลเชิงสถิติ | |
|----------------------------|-----------|
| Maximum Drawdown | -38.04% |
| Recovering Period | N/A |
| Sharpe Ratio | -0.39 |
| Alpha | -1.67% |
| Beta | 0.95 |
| อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน | 1.64 เท่า |

| การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม 5 อันดับแรก | |
|--|-------|
| กลุ่มอุตสาหกรรม | %NAV |
| พลังงาน | 23.31 |
| ธนาคาร | 11.97 |
| พาณิชย์ | 9.63 |
| เทคโนโลยีสารสนเทศและการสื่อสาร | 9.29 |
| ขนส่ง | 8.43 |

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 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:** ระดับและทิศทางของการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุน 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