



บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน เอ็มเอฟซี จำกัด (มหาชน)

กองทุนเปิดเอ็มเอฟซี เซ็ต 50

MFC SET 50 Fund

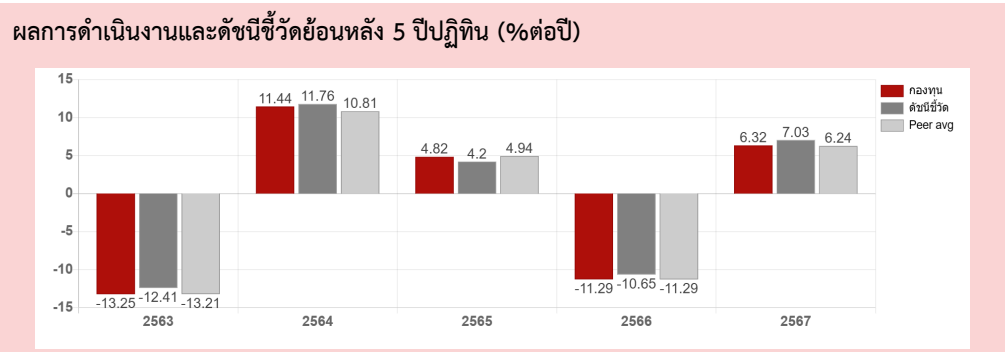
ชนิดผู้ลงทุนทั่วไป : M-S50-G

**ประเภทกองทุนรวม/กลุ่มกองทุนรวม**

- กองทุนรวมตราสารทุน
- กองทุนรวมที่มีนโยบายเปิดให้มีการลงทุนในกองทุนรวมอื่นภายใต้ บลจ. เดียวกัน (Cross Investing Fund)
- กลุ่มกองทุนรวม: SET 50 Index Fund

**นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน**

- ลงทุนในหุ้นสามัญที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ เพื่อให้สามารถสร้างผลตอบแทนที่ใกล้เคียงกับดัชนี SET 50
- กองทุนมุ่งหวังให้ผลประกอบการเคลื่อนไหวตามดัชนีชี้วัด (Passive Management / Index Tracking)



|                          | YTD    | 3 เดือน | 6 เดือน | 1 ปี  |
|--------------------------|--------|---------|---------|-------|
| กองทุน                   | -15.33 | -0.72   | -16.42  | -6.45 |
| ดัชนีชี้วัด              | -15.26 | -0.60   | -16.31  | -5.96 |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน | -15.40 | -0.66   | -16.50  | -6.52 |
| ความผันผวนกองทุน         | 22.94  | 26.09   | 21.74   | 17.52 |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด    | 22.53  | 25.33   | 21.36   | 17.30 |

|                          | 3 ปี  | 5 ปี  | 10 ปี | ตั้งแต่จัดตั้ง |
|--------------------------|-------|-------|-------|----------------|
| กองทุน                   | -6.90 | -1.08 | 0.33  | 6.05           |
| ดัชนีชี้วัด              | -6.32 | -0.70 | 0.29  | 6.33           |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน | -6.92 | -1.21 | -0.33 | -              |
| ความผันผวนกองทุน         | 13.77 | 15.03 | 16.51 | 20.29          |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด    | 13.77 | 15.08 | 16.70 | 20.63          |

\* ผลตอบแทนที่มีอายุเกินหนึ่งปีจะแสดงเป็นผลตอบแทนต่อปี

**ระดับความเสี่ยง**

ต่ำ

12345678

สูง

**เสี่ยงสูง**

ลงทุนในตราสารทุนเป็นหลัก โดยเฉลี่ยในรอบปีไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV

**ข้อมูลกองทุนรวม :**

วันจดทะเบียนกองทุน 6 พ.ค. 2547

วันเริ่มต้น class 6 พ.ค. 2547

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
- 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 :   | 1,000 บาท        | การขายคืนขั้นต่ำ :  | ไม่กำหนด         |
| การซื้อครั้งถัดไปขั้นต่ำ :   | 500 บาท          | ยอดคงเหลือขั้นต่ำ : | ไม่กำหนด         |
| ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน :  |                  |                     | T+5*             |
| หมายเหตุ :   |                  |                     |                  |
| • T+5 คือ 5 วันทำการหลังจากวันทำการขายคืน (ปัจจุบัน 3 วันทำการหลังจากวันทำการขายคืน) |                  |                     |                  |

| ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)                      |               |          |
|--|---------------|----------|
| ค่าธรรมเนียม   | สูงสุดไม่เกิน | เก็บจริง |
| การจัดการ  | 0.4280        | 0.4280   |
| รวมค่าใช้จ่าย  | 1.6600        | 0.6219   |
| หมายเหตุ :   |               |          |
| • ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว |               |          |
| • การรวมค่าใช้จ่ายที่เก็บจริง คิดตามรอบบัญชีของกองทุน                      |               |          |

| ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)   |               |                     |
|---|---------------|---------------------|
| ค่าธรรมเนียม  | สูงสุดไม่เกิน | เก็บจริง            |
| การขาย  | ไม่มี         | ไม่มี               |
| การรับซื้อคืน   | ไม่มี         | ไม่มี               |
| การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า   | ไม่มี         | ดูหมายเหตุเพิ่มเติม |
| การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก  | ไม่มี         | ดูหมายเหตุเพิ่มเติม |
| การโอนหน่วย   | 50 บาท/รายการ | 50 บาท/รายการ       |
| หมายเหตุ :  |               |                     |
| • ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว  |               |                     |
| • ผู้ถือหน่วยลงทุนจะสับเปลี่ยนเข้าที่ราคาขาย ซึ่งเท่ากับ มูลค่าหน่วยลงทุนที่ใช้เพื่อการค้าขาย + ค่าธรรมเนียมการขาย (ถ้ามี)                        |               |                     |
| • ผู้ถือหน่วยลงทุนจะสับเปลี่ยนออกที่ราคารับซื้อคืน ซึ่งเท่ากับ มูลค่าหน่วยลงทุนที่ใช้เพื่อการค้าขายรับซื้อคืน - ค่าธรรมเนียมการรับซื้อคืน (ถ้ามี) |               |                     |
| • ค่าใช้จ่ายซื้อขายหลักทรัพย์ 0.10% ของมูลค่าซื้อขาย (เก็บจริง)   |               |                     |
| • บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ                          |               |                     |

| สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน |       |
|--------------------------------|-------|
| Breakdown                      | %NAV  |
| หุ้นสามัญ                      | 99.64 |
| เงินฝากธนาคาร และอื่นๆ         | 0.36  |

| ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก        |       |
|--------------------------------------|-------|
| Holding                              | %NAV  |
| บมจ.เดลต้า อิเลคโทรนิคส์ (ประเทศไทย) | 12.57 |
| บมจ.แอดวานซ์ อินโฟร์ เซอร์วิส        | 8.41  |
| บมจ.ปตท.                             | 8.19  |
| บมจ.กัลฟ์ เอ็นเนอร์จี ดีเวลลอปเม้นท์ | 6.58  |
| บมจ.ท่าอากาศยานไทย                   | 4.56  |

| ข้อมูลเชิงสถิติ            |           |
|----------------------------|-----------|
| Maximum Drawdown           | -28.53%   |
| Recovering Period          | N/A       |
| Sharpe Ratio               | -0.63     |
| Alpha                      | -1.73%    |
| Beta                       | 1.08      |
| Tracking Error             | 0.33%     |
| อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน | 0.18 เท่า |

| การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม 5 อันดับแรก |       |
|--|-------|
| กลุ่มอุตสาหกรรม                                | %NAV  |
| พลังงาน  | 23.18 |
| ธนาคาร   | 15.60 |
| ชิ้นส่วนอิเล็กทรอนิกส์                         | 13.12 |
| เทคโนโลยีสารสนเทศและการสื่อสาร                 | 12.59 |
| พาณิชย์  | 7.70  |

## 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](http://www.mfcfund.com)

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน เอ็มเอฟซี จำกัด (มหาชน)

กองทุนเปิดเอ็มเอฟซี เซ็ต 50

MFC SET 50 Fund

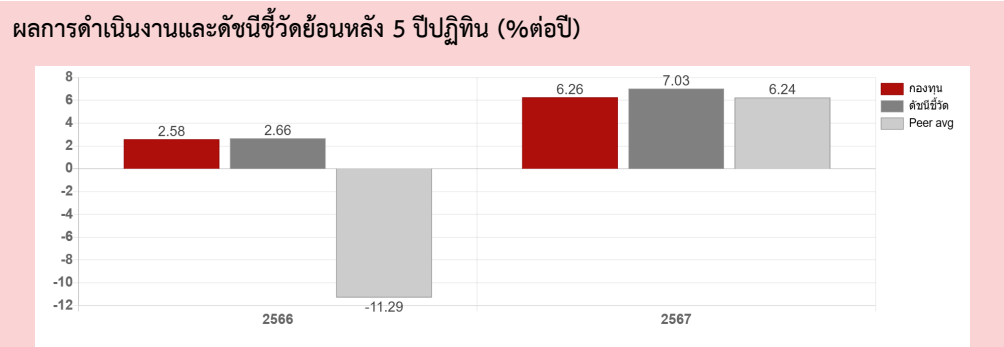
ชนิดเพื่อการออม : M-S50-SSF

ประเภทกองทุนรวม/กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมตราสารทุน
- กองทุนรวมเพื่อการออม
- กองทุนรวมที่มีนโยบายเปิดให้มีการลงทุนในกองทุนรวมอื่นภายใต้ บลจ. เดียวกัน (Cross Investing Fund)
- กลุ่มกองทุนรวม: SET 50 Index Fund

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- ลงทุนในหุ้นสามัญที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ เพื่อให้สามารถสร้างผลตอบแทนที่ใกล้เคียงกับดัชนี SET 50
- กองทุนมุ่งหวังให้ผลประกอบการเคลื่อนไหวตามดัชนีชี้วัด (Passive Management / Index Tracking)



| ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปีกumul (%ต่อปี) |        |         |         |                |
|---|--------|---------|---------|----------------|
|   | YTD    | 3 เดือน | 6 เดือน | 1 ปี           |
| กองทุน                                    | -15.33 | -0.72   | -16.42  | -6.45          |
| ดัชนีชี้วัด                               | -15.26 | -0.60   | -16.31  | -5.96          |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน                  | -15.40 | -0.66   | -16.50  | -6.52          |
| ความผันผวนกองทุน                          | 22.94  | 26.09   | 21.74   | 17.52          |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด                     | 22.87  | 25.84   | 21.66   | 17.48          |
|   | 3 ปี   | 5 ปี    | 10 ปี   | ตั้งแต่จัดตั้ง |
| กองทุน                                    | -      | -       | -       | -5.22          |
| ดัชนีชี้วัด                               | -      | -       | -       | -4.65          |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน                  | -      | -       | -       | -              |
| ความผันผวนกองทุน                          | -      | -       | -       | 15.68          |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด                     | -      | -       | -       | 15.68          |

\* ผลตอบแทนที่มีอายุเกินหนึ่งปีจะแสดงผลตอบแทนต่อปี

ระดับความเสี่ยง

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

เสี่ยงสูง

ลงทุนในตราสารทุนเป็นหลัก โดยเฉลี่ยในรอบปีไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม :

วันจดทะเบียนกองทุน 6 พ.ค. 2547

วันเริ่มต้น class 1 ธ.ค. 2566

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
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวมมิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต : ได้รับการรับรองจาก CAC

จัดอันดับกองทุน Morningstar :

ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือบริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่องได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

www.mfcfund.com

| การซื้อขายหน่วยลงทุน          |           | การขายคืนหน่วยลงทุน |                  |
|-------------------------------|-----------|---------------------|------------------|
| วันทำการซื้อ :                | -         | วันทำการขายคืน :    | ทุกวันทำการ      |
| เวลาทำการ :                   | - น.      | เวลาทำการ :         | 08:30 - 15:30 น. |
| การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ :      | 1,000 บาท | การขายคืนขั้นต่ำ :  | ไม่กำหนด         |
| การซื้อครั้งถัดไปขั้นต่ำ :    | 500 บาท   | ยอดคงเหลือขั้นต่ำ : | ไม่กำหนด         |
| ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน : |           |                     | T+5*             |

- หมายเหตุ :
- บริษัทจัดการจะไม่เปิดเสนอขายหน่วยลงทุนชนิดเพื่อการออม (SSF) ตั้งแต่วันที่ 1 มกราคม พ.ศ. 2568 เป็นต้นไป
  - T+5 คือ 5 วันทำการหลังจากวันทำการขายคืน (ปัจจุบัน 3 วันทำการหลังจากวันทำการขายคืน)

| ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)  |               |          |
|--|---------------|----------|
| ค่าธรรมเนียม   | สูงสุดไม่เกิน | เก็บจริง |
| การจัดการ  | 0.4280        | 0.4280   |
| รวมค่าใช้จ่าย  | 1.6600        | 0.6207   |
| หมายเหตุ :   |               |          |
| <ul style="list-style-type: none"><li>ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว</li><li>การรวมค่าใช้จ่ายที่เก็บจริง คิดตามรอบปีบัญชีของกองทุน</li></ul> |               |          |

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

- หมายเหตุ :
- ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว
  - ผู้ถือหน่วยลงทุนจะสับเปลี่ยนเข้าที่ราคาขาย ซึ่งเท่ากับ มูลค่าหน่วยลงทุนที่ใช้เพื่อการคำนวณราคาขาย + ค่าธรรมเนียมการขาย (ถ้ามี)
  - ผู้ถือหน่วยลงทุนจะสับเปลี่ยนออกที่ราคารับซื้อคืน ซึ่งเท่ากับ มูลค่าหน่วยลงทุนที่ใช้เพื่อการคำนวณราคารับซื้อคืน - ค่าธรรมเนียมการรับซื้อคืน (ถ้ามี)
  - ผู้ถือหน่วยลงทุนสามารถโอนย้ายหน่วยลงทุนมายังกองทุนรวมเพื่อการออมภายใต้การจัดการของ บลจ. ได้ โดยมีค่าธรรมเนียม เท่ากับ มูลค่าหน่วยลงทุนที่ใช้เพื่อการคำนวณราคาขาย + ค่าธรรมเนียมการขาย (ถ้ามี)
  - ผู้ถือหน่วยลงทุนสามารถโอนย้ายหน่วยลงทุนไปยังกองทุนรวมเพื่อการออมภายใต้การจัดการของ บลจ.อื่น ได้ โดยมีค่าธรรมเนียม (คิดจริง) 0.50% ของมูลค่าหน่วยลงทุนของวันทำการล่าสุดก่อนวันทำการการโอนย้าย (วัน T-1)
  - ผู้ถือหน่วยลงทุนไม่สามารถนำหน่วยลงทุนของกองทุนรวมไปโอนหรือจำนำได้
  - ค่าใช้จ่ายซื้อขายหลักทรัพย์ 0.10% ของมูลค่าซื้อขาย (เก็บจริง)
  - บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ

| สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน |       |
|--------------------------------|-------|
| Breakdown                      | %NAV  |
| หุ้นสามัญ                      | 99.64 |
| เงินฝากธนาคาร และอื่นๆ         | 0.36  |

| ข้อมูลเชิงสถิติ            |           |
|----------------------------|-----------|
| Maximum Drawdown           | -27.28%   |
| Recovering Period          | N/A       |
| Sharpe Ratio               | -0.63     |
| Alpha                      | -1.73%    |
| Beta                       | 1.08      |
| Tracking Error             | 0.33%     |
| อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน | 0.18 เท่า |

| การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม 5 อันดับแรก |       |
|--|-------|
| กลุ่มอุตสาหกรรม                                | %NAV  |
| พลังงาน  | 23.18 |
| ธนาคาร   | 15.60 |
| ชิ้นส่วนอิเล็กทรอนิกส์                         | 13.12 |
| เทคโนโลยีสารสนเทศและการสื่อสาร                 | 12.59 |
| พาณิชย์  | 7.70  |

| ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก         |       |
|---------------------------------------|-------|
| Holding                               | %NAV  |
| บมจ.เดลด้า อีเล็คโทรนิคส์ (ประเทศไทย) | 12.57 |
| บมจ.แอดวานซ์ อินโฟร์ เซอร์วิส         | 8.41  |
| บมจ.ปตท.                              | 8.19  |
| บมจ.กัลฟ์ เอ็นเนอร์จี ดีเวลลอปเม้นท์  | 6.58  |
| บมจ.ท่าอากาศยานไทย                    | 4.56  |

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](http://www.mfcfund.com)