

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน เอ็มเอฟซี จำกัด (มหาชน)

กองทุนเปิดเอ็มเอฟซีโกลบอลหุ้นระยะยาว
MFC Global Long Term Equity Fund

ชนิดหุ้นระยะยาว : MGLTF

ประเภทกองทุนรวม/กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมตราสารทุน
- กองทุนรวมหุ้นระยะยาว ที่จัดตั้งขึ้นก่อนวันที่ 1 มกราคม พ.ศ. 2563
- กลุ่มกองทุนรวม: Equity General

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- ลงทุนในหุ้นสามัญของบริษัทจดทะเบียนโดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่ต่ำกว่าร้อยละ 65 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุนรวม และลงทุนในหลักทรัพย์ต่างประเทศไม่เกินร้อยละ 35 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุนรวม
- กองทุนอาจลงทุนใน derivatives เพื่อป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน และเพื่อ Efficient Portfolio Management
- กองทุนมุ่งหวังให้ผลประกอบการสูงกว่าดัชนีชี้วัด (Active Management)

ระดับความเสี่ยง



ลงทุนในตราสารทุน โดยเฉลี่ยในรอบปีไม่น้อยกว่า 65% ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม :

| | |
|------------------------|---------------|
| วันจดทะเบียนกองทุน | 29 มิ.ย. 2550 |
| วันเริ่มต้น class | 29 มิ.ย. 2550 |
| นโยบายการจ่ายเงินปันผล | จ่าย |
| อายุกองทุน | ไม่กำหนด |

ผู้จัดการกองทุนรวม :

- นายประวีร์ อัจฉิมกุล (ตั้งแต่ 17 ธ.ค. 2562)
- นายธนัย ลิขิตชัยกุล (ตั้งแต่ 1 ก.ย. 2566)

ดัชนีชี้วัด :

ดัชนีผลตอบแทนรวมตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET TRI) สัดส่วน 100%

คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวมมิได้เป็นสัญญาณถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต : ได้รับการรับรองจาก CAC
จัดอันดับกองทุน Morningstar : ★★★★★

ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือ

บริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่อง

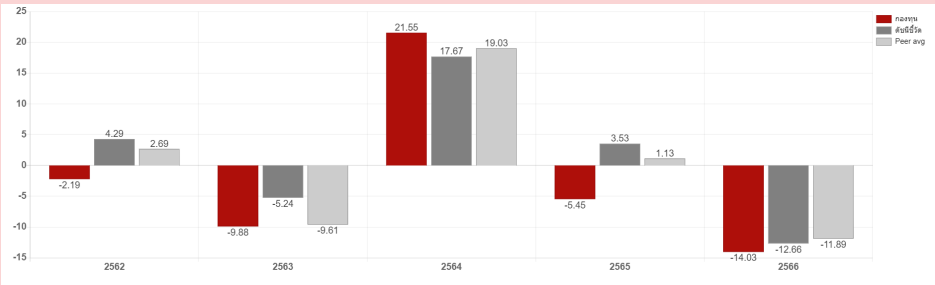
ได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



www.mfcfund.com

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (%ต่อปี)



ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด (%ต่อปี)

| | YTD | 3 เดือน | 6 เดือน | 1 ปี |
|--------------------------|-------|---------|---------|----------------|
| กองทุน | -4.69 | -4.06 | -4.69 | -11.77 |
| ดัชนีชี้วัด | -6.07 | -4.53 | -6.07 | -10.57 |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน | -6.40 | -4.68 | -6.40 | -10.13 |
| ความผันผวนกองทุน | 9.88 | 10.41 | 9.88 | 10.66 |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด | 10.32 | 10.73 | 10.32 | 10.88 |
| | 3 ปี | 5 ปี | 10 ปี | ตั้งแต่จัดตั้ง |
| กองทุน | -5.70 | -5.39 | 0.57 | 1.18 |
| ดัชนีชี้วัด | -3.58 | -2.62 | 1.78 | 6.76 |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน | -4.17 | -3.52 | 0.54 | - |
| ความผันผวนกองทุน | 10.97 | 14.89 | 13.09 | 17.52 |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด | 11.10 | 16.75 | 14.41 | 18.23 |

* ผลตอบแทนที่มีอายุเกินหนึ่งปีจะแสดงเป็นผลตอบแทนต่อปี

| การซื้อขายหน่วยลงทุน | | การขายคืนหน่วยลงทุน | |
|---|-----------|---|------------------|
| วันทำการซื้อ : | - | วันทำการขายคืน : | ทุกวันทำการ |
| เวลาทำการ : | - น. | เวลาทำการ : | 08:30 - 15:30 น. |
| การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ : | 1,000 บาท | การขายคืนขั้นต่ำ : | ไม่กำหนด |
| การซื้อครั้งถัดไปขั้นต่ำ : | 1,000 บาท | ยอดคงเหลือขั้นต่ำ : | ไม่กำหนด |
| | | ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน : | T+3 |
| | | 3 วันทำการนับแต่วันรับซื้อคืนหน่วยลงทุน | |
| หมายเหตุ : | | | |
| ● บริษัทจัดการจะไม่เปิดเสนอขายหน่วยลงทุนชนิดหุ้นระยะยาวอีก ตั้งแต่วันที่ 1 มกราคม พ.ศ. 2563 เป็นต้นไป | | | |

| ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV) ¹ | | |
|---|---------------|----------|
| ค่าธรรมเนียม | สูงสุดไม่เกิน | เก็บจริง |
| การจัดการ | 1.6050 | 1.6050 |
| รวมค่าใช้จ่าย ² | 2.9750 | 1.8356 |
| หมายเหตุ : | | |
| 1. ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว | | |
| 2. การรวมค่าใช้จ่ายที่เก็บจริง คิดตามรอบปีบัญชีของกองทุน | | |

| ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย) ¹ | | |
|---|---------------|----------|
| ค่าธรรมเนียม | สูงสุดไม่เกิน | เก็บจริง |
| การขาย | 3.00 | ไม่มี |
| การรับซื้อคืน | 3.00 | ไม่มี |
| การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า ² | 3.00 | ไม่มี |
| การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก ³ | 3.00 | ไม่มี |
| การโอนหน่วย ⁴ | ไม่มี | ไม่มี |
| หมายเหตุ : | | |
| 1. ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว | | |
| 2. ผู้ถือหน่วยลงทุนจะสับเปลี่ยนเข้าที่ราคาขาย ซึ่งเท่ากับ มูลค่าหน่วยลงทุนที่ใช้เพื่อการคำนวณราคาขาย + ค่าธรรมเนียมการขาย (ถ้ามี) | | |
| ผู้ถือหน่วยลงทุนสามารถโอนย้ายหน่วยลงทุนมายังกองทุนรวมหุ้นระยะยาวภายใต้การจัดการของ บลจ. ได้ โดยมีค่าธรรมเนียม เท่ากับ | | |
| มูลค่าหน่วยลงทุนที่ใช้เพื่อการคำนวณราคาขาย + ค่าธรรมเนียมการขาย (ถ้ามี) | | |
| 3. ผู้ถือหน่วยลงทุนจะสับเปลี่ยนออกที่ราคารับซื้อคืน ซึ่งเท่ากับ มูลค่าหน่วยลงทุนที่ใช้เพื่อการคำนวณราคารับซื้อคืน - ค่าธรรมเนียมการรับซื้อคืน (ถ้ามี) | | |
| ผู้ถือหน่วยลงทุนสามารถโอนย้ายหน่วยลงทุนไปยังกองทุนรวมหุ้นระยะยาวภายใต้การจัดการของ บลจ.อื่น ได้ โดยมีค่าธรรมเนียม (คิดจริง) | | |
| 1.50% ของมูลค่าหน่วยลงทุนของวันทำการล่าสุดก่อนวันทำการโอนย้าย (วัน T-1) | | |
| 4. ผู้ถือหน่วยลงทุนไม่สามารถนำหน่วยลงทุนของกองทุนรวมไปโอนหรือจำหน่ายได้ | | |

| สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน | |
|--------------------------------|-------|
| Breakdown | %NAV |
| หุ้นสามัญ | 86.00 |
| หน่วยลงทุน | 11.84 |
| เงินฝากธนาคาร และอื่นๆ | 2.16 |

| ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก | |
|--------------------------------------|------|
| Holding | %NAV |
| iShares MSCI ACWI ETF | 7.98 |
| บมจ.ท่าอากาศยานไทย | 5.07 |
| บมจ.เดลด้า อีเลคโทรนิคส์ (ประเทศไทย) | 4.84 |
| บมจ.ซีพี ออลล์ | 4.50 |
| บมจ.ปตท. | 4.44 |

| ข้อมูลเชิงสถิติ | |
|----------------------------|-----------|
| Maximum Drawdown | -37.90% |
| Recovering Period | N/A |
| FX Hedging | 82.00% |
| Sharpe Ratio | -0.69 |
| Alpha | -2.12% |
| Beta | N/A |
| อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน | 1.70 เท่า |

| การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม 5 อันดับแรก | |
|--|-------|
| กลุ่มอุตสาหกรรม | %NAV |
| พลังงาน | 16.35 |
| พาณิชย์ | 11.77 |
| ธนาคาร | 8.89 |
| อาหารและเครื่องดื่ม | 8.14 |
| เทคโนโลยีสารสนเทศและการสื่อสาร | 7.16 |

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

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน เอ็มเอฟซี จำกัด (มหาชน)

กองทุนเปิดเอ็มเอฟซีโกลบอลหุ้นระยะยาว

MFC Global Long Term Equity Fund

ชนิดเพื่อการลงทุน : MGMF

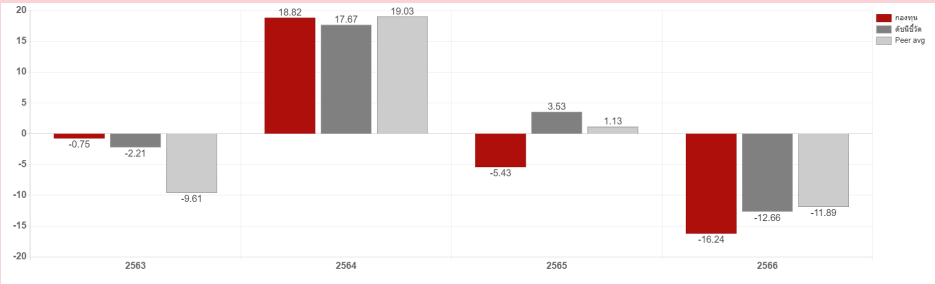
ประเภทกองทุนรวม/กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมตราสารทุน
- กลุ่มกองทุนรวม: Equity General

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- ลงทุนในหุ้นสามัญของบริษัทจดทะเบียนโดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่ต่ำกว่าร้อยละ 65 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุนรวม และลงทุนในหลักทรัพย์ต่างประเทศไม่เกินร้อยละ 35 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุนรวม
- กองทุนอาจลงทุนใน derivatives เพื่อป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน และเพื่อ Efficient Portfolio Management
- กองทุนมุ่งหวังให้ผลประกอบการสูงกว่าดัชนีชี้วัด (Active Management)

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (%ต่อปี)



ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปึกมุด (%ต่อปี)

| | YTD | 3 เดือน | 6 เดือน | 1 ปี |
|--------------------------|-------|---------|---------|----------------|
| กองทุน | -4.70 | -4.06 | -4.70 | -12.97 |
| ดัชนีชี้วัด | -6.07 | -4.53 | -6.07 | -10.57 |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน | -6.40 | -4.68 | -6.40 | -10.13 |
| ความผันผวนกองทุน | 9.88 | 10.41 | 9.88 | 10.77 |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด | 10.32 | 10.73 | 10.32 | 10.88 |
| | 3 ปี | 5 ปี | 10 ปี | ตั้งแต่จัดตั้ง |
| กองทุน | -7.21 | - | - | -3.23 |
| ดัชนีชี้วัด | -3.58 | - | - | -0.65 |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน | -4.17 | - | - | - |
| ความผันผวนกองทุน | 11.16 | - | - | 11.82 |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด | 11.10 | - | - | 11.98 |

* ผลตอบแทนที่มีอายุเกินหนึ่งปีจะแสดงเป็นผลตอบแทนต่อปี

ระดับความเสี่ยง



ลงทุนในตราสารทุน โดยเฉลี่ยในรอบปีไม่น้อยกว่า 65% ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม :

| | |
|------------------------|---------------|
| วันจดทะเบียนกองทุน | 29 มิ.ย. 2550 |
| วันเริ่มต้น class | 1 ก.ค. 2563 |
| นโยบายการจ่ายเงินปันผล | จ่าย |
| อายุกองทุน | ไม่กำหนด |

ผู้จัดการกองทุนรวม :

- นายประวีร์ อัจฉิมกุล (ตั้งแต่ 17 ธ.ค. 2562)
- นายธนัย ลิขิตชัยกุล (ตั้งแต่ 1 ก.ย. 2566)

ดัชนีชี้วัด :

ดัชนีผลตอบแทนรวมตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET TRI) สัดส่วน 100%

คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวมมิได้เป็นสัญญาณถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

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 | 1.6050 | 1.6050 |
| รวมค่าใช้จ่าย ² | 2.9750 | 1.8356 |
| หมายเหตุ : | | |
| 1. ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว | | |
| 2. การรวมค่าใช้จ่ายที่เก็บจริง คิดตามรอบปีบัญชีของกองทุน | | |

| ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย) ¹ | | |
|---|---------------|---------------|
| ค่าธรรมเนียม | สูงสุดไม่เกิน | เก็บจริง |
| การขาย ² | 3.00 | 0.50 |
| การรับซื้อคืน | 3.00 | ไม่มี |
| การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า ³ | 3.00 | ไม่มี |
| การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก ⁴ | 3.00 | ไม่มี |
| การโอนหน่วย | 50 บาท/รายการ | 50 บาท/รายการ |
| หมายเหตุ : | | |
| 1. ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว | | |
| 2. บริษัทจัดการขอสงวนสิทธิในการคิดค่าธรรมเนียมการขายหน่วยลงทุนกับผู้สั่งซื้อหรือผู้ถือหน่วยลงทุนแต่ละกลุ่มหรือแต่ละคนไม่เท่ากันได้ | | |
| 3. ผู้ถือหน่วยลงทุนจะสับเปลี่ยนเข้าที่ราคาขาย ซึ่งเท่ากับ มูลค่าหน่วยลงทุนที่ใช้เพื่อการคำนวณราคาขาย + ค่าธรรมเนียมการขาย (ถ้ามี) | | |
| 4. ผู้ถือหน่วยลงทุนจะสับเปลี่ยนออกที่ราคารับซื้อคืน ซึ่งเท่ากับ มูลค่าหน่วยลงทุนที่ใช้เพื่อการคำนวณราคารับซื้อคืน - ค่าธรรมเนียมการรับซื้อคืน (ถ้ามี) | | |

| สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน | |
|--------------------------------|-------|
| Breakdown | %NAV |
| หุ้นสามัญ | 86.00 |
| หน่วยลงทุน | 11.84 |
| เงินฝากธนาคาร และอื่นๆ | 2.16 |

| ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก | |
|--------------------------------------|------|
| Holding | %NAV |
| iShares MSCI ACWI ETF | 7.98 |
| บมจ.ท่าอากาศยานไทย | 5.07 |
| บมจ.เดลต้า อีเลคโทรนิคส์ (ประเทศไทย) | 4.84 |
| บมจ.ซีพี ออลล์ | 4.50 |
| บมจ.ปตท. | 4.44 |

| ข้อมูลเชิงสถิติ | |
|----------------------------|-----------|
| Maximum Drawdown | -25.78% |
| Recovering Period | N/A |
| FX Hedging | 82.00% |
| Sharpe Ratio | -0.69 |
| Alpha | -2.12% |
| Beta | N/A |
| อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน | 1.70 เท่า |

| การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม 5 อันดับแรก | |
|--|-------|
| กลุ่มอุตสาหกรรม | %NAV |
| พลังงาน | 16.35 |
| พาณิชย์ | 11.77 |
| ธนาคาร | 8.89 |
| อาหารและเครื่องดื่ม | 8.14 |
| เทคโนโลยีสารสนเทศและการสื่อสาร | 7.16 |

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:** ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตกองทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลานึง 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