

กองทุนเปิด BCAP SET100 ETF (BSET100)

ประเภทกองทุนรวม/ กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมตราสารทุน / กองทุนรวมอีทีเอฟ (Exchange Traded Fund) / กองทุนรวมที่ลงทุนแบบไม่มีความเสี่ยงต่างประเทศ
- กลุ่มกองทุน : Equity Large Cap

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- กองทุนจะใช้กลยุทธ์การบริหารกองทุนเชิงรับ (Passive Management Strategy) โดยมุ่งหวังให้ผลประกอบการเคลื่อนไหวตามดัชนีชี้วัด โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชี ไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน โดยลงทุนในหลักทรัพย์หรือสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) ที่มีสินทรัพย์อ้างอิงเป็นหลักทรัพย์ที่เป็นส่วนประกอบของดัชนี SET100 Total Return Index ซึ่งรวมถึงหลักทรัพย์ที่อยู่ระหว่างการเข้าหรือออกจากการเป็นหลักทรัพย์ที่เป็นส่วนประกอบของดัชนีอ้างอิงด้วย ซึ่งอาจพิจารณาเลือกใช้กลยุทธ์แบบ Full Replication หรือ Optimization
- กองทุนอาจลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) เพื่อเพิ่มประสิทธิภาพในการลงทุน (Efficient Portfolio Management)
- กลยุทธ์การลงทุน มุ่งหวังให้ผลประกอบการเคลื่อนไหวตามดัชนีชี้วัด (Passive Management/Index Tracking)

ระดับความเสี่ยง



เสี่ยงสูง

ลงทุนในตราสารทุนเป็นหลักโดยเฉลี่ยในรอบปีไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน 06 กันยายน 2560

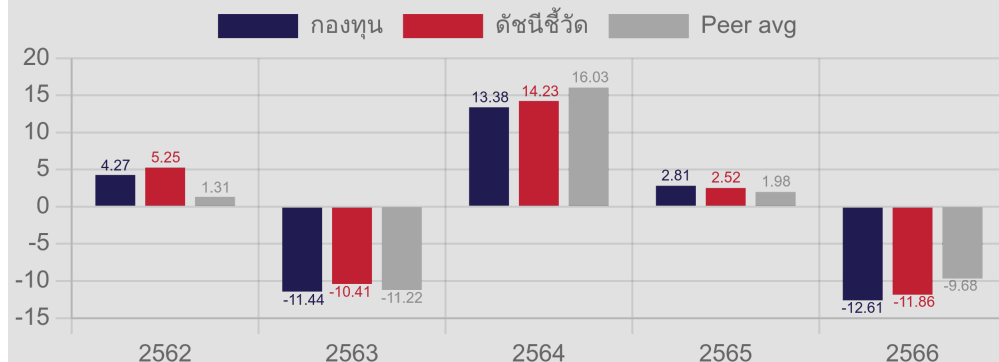
นโยบายการจ่ายเงินปันผล จ่าย

อายุกองทุน ไม่กำหนด

ผู้จัดการกองทุน

นายเมธี เมฆอรุณเรือง (ตั้งแต่วันที่ 20 พ.ย. 2560)

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (% ต่อปี)



ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปึกหมุด (%ต่อปี)

	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี
กองทุน	-6.92	-4.43	-6.92	-10.97
ดัชนีชี้วัด	-6.61	-4.28	-6.61	-10.39
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	-5.99	-3.71	-5.99	-8.99
ความผันผวนกองทุน	10.92	11.17	10.92	11.75
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	10.98	11.26	10.98	11.79

	3 ปี	5 ปี	10 ปี	ตั้งแต่จัดตั้ง
กองทุน	-4.29	-4.89	N/A	-1.78
ดัชนีชี้วัด	-3.90	-4.26	N/A	-1.11
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	-2.53	-4.37	N/A	N/A
ความผันผวนกองทุน	11.69	18.45	N/A	16.91
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	11.73	18.50	N/A	16.95

ดัชนีชี้วัด

ดัชนีผลตอบแทนรวม SET 100 (SET100 TRI) 100.00%

คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวมมิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต : ได้รับการรับรองจาก CAC
 ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือ บริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่อง ได้ที่หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



www.bcap.co.th

การซื้อขายหน่วยลงทุน	การซื้อขายหน่วยลงทุน
วันทำการซื้อ/ขายคืน : ทุกวันทำการของตลาดหลักทรัพย์ฯ	
- ผู้ร่วมค้าหน่วยลงทุนสามารถสั่งซื้อ/ขายคืนหน่วยลงทุนได้ที่บริษัทจัดการได้ทุกวันทำการของตลาดหลักทรัพย์ฯ	
- ผู้สนใจลงทุนทั่วไปสามารถสั่งซื้อ/ขายคืนหน่วยลงทุนโดยผ่านผู้ร่วมค้าหน่วยลงทุนด้วยวิธีการส่ง/รับมอบ ตะกร้าหลักทรัพย์ ตามขั้นตอนและวิธีการรับซื้อคืนที่ผู้ร่วมค้าหน่วยลงทุนกำหนด	
- ผู้สนใจลงทุนทั่วไปและผู้ร่วมค้าหน่วยลงทุนสามารถซื้อ/ขายคืนหน่วยลงทุนผ่านตลาดหลักทรัพย์ฯ โดยปฏิบัติตามกฎ ระเบียบ และวิธีปฏิบัติของตลาดหลักทรัพย์ฯ	
มูลค่าขั้นต่ำในการซื้อครั้งแรก : เป็นไปตามที่ผู้ร่วมค้า	มูลค่าขั้นต่ำในการขายคืน : ไม่กำหนด
หน่วยลงทุน หรือตลาดหลักทรัพย์ฯกำหนด	ยอดคงเหลือขั้นต่ำ : ไม่กำหนด
มูลค่าขั้นต่ำในการซื้อครั้งถัดไป : เป็นไปตามที่ผู้ร่วม	จำนวนหน่วยลงทุนขั้นต่ำของการขายคืน : สำหรับผู้
ค้าหน่วยลงทุน หรือตลาดหลักทรัพย์ฯกำหนด	ร่วมค้าหน่วยลงทุน : 1 หน่วยของการซื้อขาย
จำนวนหน่วยลงทุนขั้นต่ำของการซื้อครั้งถัดไป :	(creation unit : CU) และเพิ่มขึ้นเป็นทวีคูณของ 1
สำหรับผู้ร่วมค้าหน่วยลงทุน : 1 หน่วยของการซื้อขาย หน่วยของการซื้อขาย	
(creation unit : CU) และเพิ่มขึ้นเป็นทวีคูณของ 1	ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน : ภายใน 5 วันทำการ
หน่วยของการซื้อขาย	นับตั้งแต่วันถัดจากวันส่งคำสั่งขายคืนหน่วยลงทุน
	โดยบริษัทจัดการจะชำระเป็นตะกร้าหลักทรัพย์ตาม
	อัตราส่วนและรายละเอียดของหลักทรัพย์ที่บริษัท
	จัดการกำหนด

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุน (% ต่อปีของ NAV)		
ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	1.605%	0.535%
รวมค่าใช้จ่าย	3.21%	0.69245%
หมายเหตุ		
- ค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายข้างต้นได้รวมภาษีมูลค่าเพิ่มและภาษีอื่นใดในตนเองเดียวกันแล้ว (ถ้ามี)		
- ค่าใช้จ่ายข้างต้นเป็นอัตราตามรอบปีบัญชีปัจจุบัน ทั้งนี้ สามารถศึกษาข้อมูลเพิ่มเติมได้ที่หนังสือชี้ชวนส่วนข้อมูลกองทุนรวม		

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วยลงทุน (% ต่อมูลค่าซื้อขาย)		
ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การขาย	1.07%	ปัจจุบันไม่เรียกเก็บ
การรับซื้อคืน	1.07%	ปัจจุบันไม่เรียกเก็บ
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า	ไม่มี	ไม่มี
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก	ไม่มี	ไม่มี
การโอน	ตามที่นายทะเบียนเรียกเก็บ	ปัจจุบันไม่เรียกเก็บ
หมายเหตุ - ค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายข้างต้นได้รวมภาษีมูลค่าเพิ่มและภาษีอื่นใดในตนเองเดียวกันแล้ว (ถ้ามี) ทั้งนี้ สามารถศึกษาข้อมูลเพิ่มเติมได้ที่หนังสือชี้ชวนส่วนข้อมูลกองทุนรวม		

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน	ทรัพย์สินที่ลงทุนสูงสุด 5 อันดับแรก
% NAV	% NAV
1. หุ้นสามัญ	99.45
2. เงินฝากธนาคาร	0.51
	1. บริษัท เบลต้า อีเลคโทรนิคส์ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) (DELTA)
	2. บริษัท ปตท. จำกัด (มหาชน) (PTT)
	3. บริษัท ท่าอากาศยานไทย จำกัด (มหาชน) (AOT)
	4. บริษัท แอดวานซ์ อินโฟร์ เซอร์วิส จำกัด (มหาชน) (ADVANC)
	5. บริษัท ปตท.สำรวจและผลิตปิโตรเลียม จำกัด (มหาชน) (PTTEP)

ข้อมูลความเสี่ยงเชิงสถิติ	
Maximum drawdown	-41.93 %
Recovering Period	N/A
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน	0.08 เท่า
Sharpe Ratio	-0.45
Alpha	-0.42
Beta	1.00
Tracking Error	0.08 %
Tracking Difference	-0.58 %

การจัดสรรการลงทุนในต่างประเทศ	
	% NAV
-	

การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม 5 อันดับแรก	
	% NAV
1. พลังงานและสาธารณูปโภค	22.95
2. ธนาคาร	10.89
3. ขนส่งและโลจิสติกส์	9.27
4. เทคโนโลยีสารสนเทศและการสื่อสาร	9.25
5. ชิ้นส่วนอิเล็กทรอนิกส์	8.77

อันดับความน่าเชื่อถือของตราสารหนี้ (%)	
-	

คำอธิบาย

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

Recovering Period ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาตั้งแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้เวลานานเท่าใด

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 แสดงว่า หลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนมากกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด

Tracking Error อัตราผลตอบแทนของกองทุนมีประสิทธิภาพในการเลียนแบบดัชนีชี้วัด โดยหาก tracking error ต่ำ หมายถึงกองทุนรวมมีประสิทธิภาพในการสร้างผลตอบแทนให้ใกล้เคียงกับดัชนีชี้วัด กองทุนรวมที่มีค่า tracking error สูง จะมีอัตราผลตอบแทนโดยเฉลี่ยห่างจากดัชนีชี้วัดมากขึ้น

Tracking Difference (TD) ค่าส่วนต่างระหว่างผลตอบแทนเฉลี่ยของกองทุนรวมและผลตอบแทนของดัชนีอ้างอิงของกองทุน

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน บางกอกแคปปิตอล จำกัด

โทรศัพท์ : 0-2618-1599 website : www.bcap.co.th

ที่อยู่ 191 อาคารสีลมคอมเพล็กซ์ ชั้น 24 ห้องเลขที่ A-C ถนนสีลม แขวงสีลม เขตบางรัก กรุงเทพฯ 10500