

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน เอ็มเอฟซี จำกัด (มหาชน)

กองทุนเปิดเอ็มเอฟซี โกลบอล คอนเวอร์ติเบิล บอนด์

MFC Global Convertible Bond Fund

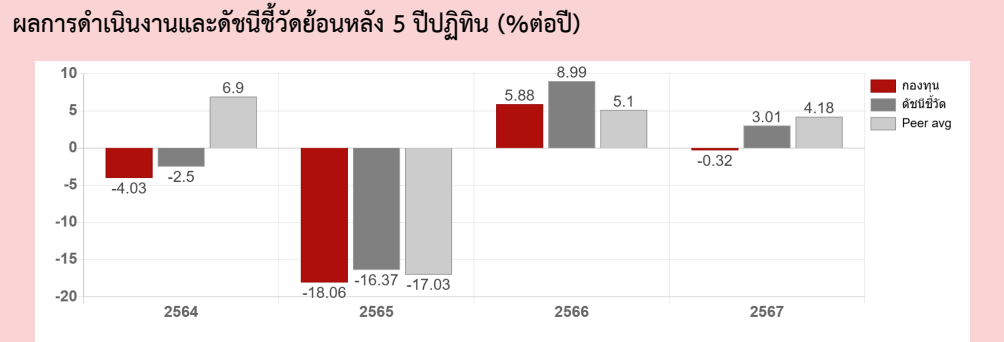
MCONVERT

ประเภทกองทุนรวม/กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมผสม
- กองทุนรวมหน่วยลงทุน (Fund of Funds)
- กลุ่มกองทุนรวม: Foreign Investment Allocation

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- ลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมตราสารหนี้ต่างประเทศ และ/หรือกองทุนรวมอียูโอฟตราสารหนี้ต่างประเทศ ที่มีนโยบายลงทุนใน ตราสารกึ่งหนี้กึ่งทุน เช่น หุ้นกู้แปลงสภาพ (Convertible bond) หุ้นกู้แปลงสภาพแบบ มีเงื่อนไข (contingent convertible bond) และตราสารอื่น ๆ ที่เกี่ยวข้อง
- กองทุนอาจลงทุนใน derivatives เพื่อป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน และเพื่อ Efficient Portfolio Management
- กองทุนมุ่งหวังให้ผลประกอบการสูงกว่าดัชนีชี้วัด (active management)



| ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด (%ต่อปี) |      |         |         |                |
|---|------|---------|---------|----------------|
|   | YTD  | 3 เดือน | 6 เดือน | 1 ปี           |
| กองทุน                                    | 1.88 | -0.19   | -0.32   | 3.90           |
| ดัชนีชี้วัด                               | 2.62 | 0.14    | 0.81    | 5.94           |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน                  | 0.70 | -0.82   | -1.37   | 1.83           |
| ความผันผวนกองทุน                          | 8.95 | 10.39   | 8.56    | 7.18           |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด                     | 9.60 | 11.73   | 9.25    | 7.50           |
|   | 3 ปี | 5 ปี    | 10 ปี   | ตั้งแต่จัดตั้ง |
| กองทุน                                    | 0.69 | -       | -       | -4.57          |
| ดัชนีชี้วัด                               | 3.30 | -       | -       | -1.67          |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน                  | 0.75 | -       | -       | -              |
| ความผันผวนกองทุน                          | 7.82 | -       | -       | 8.75           |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด                     | 7.54 | -       | -       | 8.02           |

\* ผลตอบแทนที่มีอายุเกินหนึ่งปีจะแสดงเป็นผลตอบแทนต่อปี

ระดับความเสี่ยง

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

เสี่ยงสูง

ลงทุนในตราสารหนี้เอกชนเป็นหลัก โดยมีตราสาร non-investment grade / unrated ไม่น้อยกว่า 60% ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม :

วันจดทะเบียนกองทุน 29 ต.ค. 2564

นโยบายการจ่ายเงินปันผล ไม่จ่าย

อายุกองทุน ไม่กำหนด

ผู้จัดการกองทุนรวม :

- นางฉัตรพร ศิริสากุล (ตั้งแต่ 8 เม.ย. 2565)
- นายชาญวุฒิ รุ่งแสงบุญญ (ตั้งแต่ 29 ต.ค. 2564)

ดัชนีชี้วัด :

1) Lazard Global Convertible Bond สัดส่วน 50%

2) Morgan Stanley Global Convertible Bond สัดส่วน 50%

หมายเหตุ: ปรับด้วยต้นทุนการป้องกันความเสี่ยงด้านอัตราแลกเปลี่ยนเพื่อคำนวณผลตอบแทนเป็นสกุลเงินบาท ณ วันที่ลงทุน ในสัดส่วน 85% และปรับด้วยอัตราแลกเปลี่ยนเพื่อคำนวณผลตอบแทนเป็นสกุลเงินบาท ณ วันคำนวณผลตอบแทน สัดส่วน 15% (มีผลตั้งแต่วันที่ 1 เมษายน 2568 เป็นต้นไป)

คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวม มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

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. |
| การซื้อขายครั้งแรกขั้นต่ำ :   | 1 บาท            | การขายคืนขั้นต่ำ :            | ไม่กำหนด         |
| การซื้อขายครั้งถัดไปขั้นต่ำ :   | 1 บาท            | ยอดคงเหลือขั้นต่ำ :           | ไม่กำหนด         |
|   |                  | ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน : | T+5*             |
| หมายเหตุ :  |                  |                               |                  |
| • T+5 คือ 5 วันทำการนับจากวันคำนวณ NAV (ปัจจุบัน 5 วันทำการหลังจากวันทำรายการขายคืน โดยมีให้นับรวมวันหยุดทำการในต่างประเทศ) |                  |                               |                  |

| ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)                      |               |          |
|--|---------------|----------|
| ค่าธรรมเนียม   | สูงสุดไม่เกิน | เก็บจริง |
| การจัดการ  | 2.1400        | 1.0700   |
| รวมค่าใช้จ่าย  | 4.8899        | 1.3410   |
| หมายเหตุ :   |               |          |
| • ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว |               |          |
| • การรวมค่าใช้จ่ายที่เก็บจริง คิดตามรอบปีบัญชีของกองทุน                    |               |          |

| ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)  |               |                     |
|--|---------------|---------------------|
| ค่าธรรมเนียม   | สูงสุดไม่เกิน | เก็บจริง            |
| การขาย   | 2.00          | 1.00                |
| การรับซื้อคืน  | 2.00          | ไม่มี               |
| การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า  | ไม่มี         | ดูหมายเหตุเพิ่มเติม |
| การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก   | ไม่มี         | ดูหมายเหตุเพิ่มเติม |
| การโอนหน่วย  | 50 บาท/รายการ | 50 บาท/รายการ       |
| หมายเหตุ :   |               |                     |
| • ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว   |               |                     |
| • บริษัทจัดการของสงวนสิทธิในการคิดค่าธรรมเนียมการขายหน่วยลงทุนกับผู้สั่งซื้อหรือผู้ถือหน่วยลงทุนแต่ละกลุ่มหรือแต่ละคน ไม่เท่ากันได้                  |               |                     |
| • บริษัทจัดการของสงวนสิทธิในการคิดค่าธรรมเนียมการรับซื้อคืนหน่วยลงทุนกับผู้ขายคืนหรือผู้ถือหน่วยลงทุนแต่ละกลุ่มหรือแต่ละคนไม่เท่ากันได้              |               |                     |
| • ผู้ถือหน่วยลงทุนจะสับเปลี่ยนเข้าที่ราคาขาย ซึ่งเท่ากับ มูลค่าหน่วยลงทุนที่ใช้เพื่อการคำนวณราคาขาย + ค่าธรรมเนียมการขาย (ถ้ามี)                     |               |                     |
| • ผู้ถือหน่วยลงทุนจะสับเปลี่ยนออกที่ราคารับซื้อคืน ซึ่งเท่ากับ มูลค่าหน่วยลงทุนที่ใช้เพื่อการคำนวณราคารับซื้อคืน - ค่าธรรมเนียมการรับซื้อคืน (ถ้ามี) |               |                     |
| • บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ                             |               |                     |

| สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน |       |
|--------------------------------|-------|
| Breakdown                      | %NAV  |
| หน่วยลงทุน                     | 95.57 |
| เงินฝากธนาคาร และอื่นๆ         | 4.43  |

| ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก                  |       |
|--|-------|
| Holding  | %NAV  |
| Morgan Stanley Global Convertible Bond Class Z | 67.69 |
| Lazard Global Convertible Bond                 | 27.88 |

| ข้อมูลเชิงสถิติ            |           |
|----------------------------|-----------|
| Maximum Drawdown           | -23.92%   |
| Recovering Period          | N/A       |
| FX Hedging                 | 93.25%    |
| Sharpe Ratio               | -0.06     |
| Alpha                      | -2.61%    |
| Beta                       | N/A       |
| อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน | 0.04 เท่า |

การลงทุนในกองทุนอื่นเกินกว่า 20% (กองทุนต่างประเทศ)

| ชื่อกองทุน                                     | ISIN code    | Bloomberg code |
|--|--------------|----------------|
| Morgan Stanley Global Convertible Bond Class Z | LU0360484413 | MSGCVBZ LX     |
| Lazard Global Convertible Bond                 | FR0013429446 | LCGICHU FP     |

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 บ่งชี้ถึงการซื้อขายหลักทรัพย์บ่อยครั้งของผู้จัดการกองทุนและทำให้ต้นทุนการซื้อขายหลักทรัพย์ที่สูง 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:** อัตราผลตอบแทนของกองทุนมีประสิทธิภาพในการเล่นแบบดัชนีชี้วัด โดยหาก tracking error ต่ำ หมายถึงกองทุนรวมมีประสิทธิภาพในการสร้างผลตอบแทนให้ใกล้เคียงกับดัชนีชี้วัด กองทุนรวมที่มีค่า tracking error สูง จะมีอัตราผลตอบแทนโดยเฉลี่ยห่างจากดัชนีชี้วัดมากขึ้น
- **Yield to Maturity:** อัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในตราสารหนี้โดยถือจนครบกำหนดอายุ ซึ่งคำนวณจากดอกเบี้ยที่จะได้รับในอนาคตตลอดอายุตราสารและเงินต้นที่จะได้รับคืนนำมาคิดลดเป็นมูลค่าปัจจุบัน โดยใช้ตัวอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมตราสารหนี้ 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)