

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน เอ็มเอฟซี จำกัด (มหาชน)

กองทุนเปิดเอ็มเอฟซี Rebound Complex Structured Return ห้ามขายผู้ลงทุนรายย่อย

MFC Rebound Complex Structured Return Not for Retail Investors

MREBOUND-AI

ประเภทกองทุนรวม/กลุ่มกองทุนรวม

- ประเภทกองทุน : กองทุนรวมผสม / กองทุนที่ลงทุนแบบมีความเสี่ยงทั้งในและต่างประเทศ
- กลุ่มกองทุนรวม : Miscellaneous

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

ลงทุนในตราสารทุน และ/หรือหน่วยลงทุนของกองทุนต่างประเทศ และ/หรือกองทุนรวมอียิปต์ต่างประเทศ ตราสารหนี้ที่มีอันดับความน่าเชื่อถืออยู่ในอันดับที่สามารถลงทุนได้ (Investment Grade) และ/หรือเงินฝากทั้งในและ/หรือต่างประเทศ และสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) ประเภทสัญญาออพชั่น (Option) หรือวอร์แรนต์ (Warrant) ที่มีการจ่ายผลตอบแทนอ้างอิงกับกองทุนรวมอียิปต์ต่างประเทศ โดยกองทุนจะลงทุนในตราสารซึ่งประกอบด้วย 2 ส่วนหลัก ดังนี้

ส่วนที่ 1 ลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุน Invesco QQQ Trust, Series 1 ในสกุลเงินดอลลาร์สหรัฐอเมริกา (USD) ประมาณร้อยละ 50 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน

ส่วนที่ 2 ส่วนที่เหลือประมาณร้อยละ 50 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน กองทุนจะแบ่งการลงทุนออกเป็น 2 ส่วนย่อย ดังนี้

2.1 ลงทุนในตราสารหนี้ที่มีอันดับความน่าเชื่อถืออยู่ในอันดับที่สามารถลงทุนได้ (Investment Grade) และ/หรือเงินฝากทั้งในและ/หรือต่างประเทศ ประมาณร้อยละ 46.75-47.25 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน โดยมีกลยุทธ์ในการลงทุนจนครบกำหนดอายุ (buy&hold) ทั้งนี้ กองทุนอาจลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) เพื่อป้องกันความเสี่ยง (Hedging) จากอัตราแลกเปลี่ยนตามดุลยพินิจของผู้จัดการกองทุน

2.2 ลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) ประเภทสัญญาออพชั่น (Option) หรือวอร์แรนต์ (Warrant) ที่มีการจ่ายผลตอบแทนอ้างอิงกับการเปลี่ยนแปลงราคาของกองทุน Invesco QQQ Trust, Series 1 ประมาณร้อยละ 2.75-3.25 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน โดยมีกลยุทธ์ในการลงทุนจนครบกำหนดอายุ (buy&hold) ทั้งนี้ กองทุนจะไม่ป้องกันความเสี่ยงด้านอัตราแลกเปลี่ยนสำหรับการลงทุนในสัญญาออพชั่นหรือวอร์แรนต์

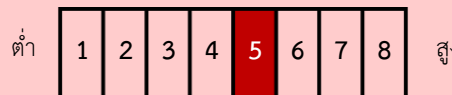
ผลการดำเนินงานย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (%ต่อปี)

-

ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด (%ต่อปี)

-

ระดับความเสี่ยง



เสี่ยงปานกลางค่อนข้างสูง

ลงทุนในตราสารทุน ตราสารหนี้ เงินฝาก และสัญญาออพชั่นหรือวอร์แรนต์ ที่มีการจ่ายผลตอบแทนอ้างอิงกับกองทุน Invesco QQQ Trust, Series 1

ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน ภายใน 2 วันทำการหลังจากวันสุดท้ายของการ IPO

นโยบายการจ่ายเงินปันผล ไม่จ่าย

อายุกองทุน ประมาณ 2 ปี โดยไม่ต่ำกว่า 1 ปี 11 เดือน และไม่เกิน 2 ปี 1 เดือน

ผู้จัดการกองทุนรวม

- คุณกิตติพงษ์ กังวานเกียรติชัย : เริ่มบริหารจัดการตั้งแต่วันที่จดทะเบียนกองทุน
- คุณพิพัฒน์ นรานันท์ : เริ่มบริหารจัดการตั้งแต่วันที่จดทะเบียนกองทุน

ดัชนีชี้วัด :

ไม่มี เนื่องจากกองทุนไม่สามารถวัดผลการดำเนินงานได้ เพราะอัตราผลตอบแทนของกองทุนขึ้นอยู่กับเงื่อนไขการจ่ายผลตอบแทนของสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ซึ่งเป็นลักษณะเฉพาะเจาะจงที่สร้างขึ้นสำหรับกองทุนนี้โดยเฉพาะ

คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวม มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต
- ผู้ลงทุนไม่สามารถขายคืนหน่วยลงทุนนั้นในช่วงเวลา 2 ปีได้

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต : ได้รับการรับรองจาก CAC

ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือ
บริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่อง
ได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



www.mfcfund.com

การซื้อหน่วยลงทุน

การขายคืนหน่วยลงทุน

วันทำการซื้อ:	ระหว่างวันที่ 31 ส.ค. – 8 ก.ย. 2566	วันทำการขายคืน:	รับซื้อคืนหน่วยลงทุน เมื่อครบอายุโครงการ
เวลาทำการ:	08:30 – 15:30 น.	เวลาทำการ:	-
การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ:	500,000 บาท	การขายคืนขั้นต่ำ:	-
การซื้อครั้งถัดไปขั้นต่ำ:	-	ยอดคงเหลือขั้นต่ำ:	-
		ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน:	T+5 คือ 5 วันทำการนับแต่วันรับซื้อคืนหน่วยลงทุน

หมายเหตุ:

เมื่อครบกำหนดอายุโครงการ บริษัทจัดการจะจัดให้มีการดำเนินการรับซื้อคืนหน่วยลงทุนโดยอัตโนมัติทั้งหมดภายใน 2 วันทำการก่อนวันครบกำหนดอายุโครงการ และจะชำระเงินค่าขายคืนหน่วยลงทุนให้แก่ผู้ถือหน่วยลงทุนภายใน 5 วันทำการนับตั้งแต่วันที่ถัดจากวันทำการขายคืนหน่วยลงทุนโดยอัตโนมัติ โดยการนำเงินเข้าบัญชีเงินฝากประเภทออมทรัพย์หรือประเภทกระแสรายวันของผู้ถือหน่วยลงทุน ณ ธนาคารที่บริษัทจัดการกำหนดหรือเป็นเช็คขีดคร่อมเฉพาะส่งจ่ายผู้ถือหน่วยลงทุน ตามที่ผู้ถือหน่วยลงทุนได้แจ้งความประสงค์ไว้

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของมูลค่าจดทะเบียนกองทุนรวม)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	2.14	1.07
รวมค่าใช้จ่าย	3.1779	N/A

หมายเหตุ:

- ค่าธรรมเนียมการจัดการกองทุน ในอัตราไม่เกินร้อยละ 2.14 ต่อปีของมูลค่าเงินลงทุนจดทะเบียนกองทรัสต์สินเป็นกองทุนรวม ทั้งนี้ ในกรณีที่มีอัตราผลตอบแทนที่กองทุนได้รับหลังหักค่าใช้จ่ายสูงกว่าอัตราผลตอบแทนเฉลี่ยต่อปีที่จะรับซื้อคืนอัตโนมัติ บริษัทจัดการขอสงวนสิทธิ์ที่จะคิดค่าธรรมเนียมการจัดการเพิ่มเติมจากที่ได้ประมาณการไว้ โดยจะไม่เกินอัตราค่าธรรมเนียมการจัดการรายปีข้างต้น ทั้งนี้บริษัทจัดการจะแจ้งอัตราที่เรียกเก็บจริงให้ผู้ถือหน่วยทราบอีกครั้งหลังจากมีการลงทุนจริงบนเว็บไซต์
- ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่มหรือภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การขาย	2.00	1.00
การรับซื้อคืน	2.00	ไม่มี
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า	ไม่มี	ไม่มี
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก	ไม่มี	ไม่มี
การโอนหน่วย	ตามที่นายทะเบียนเรียกเก็บ	ตามที่นายทะเบียนเรียกเก็บ

หมายเหตุ: ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว

การลงทุนในกองทุนต่างประเทศเกินกว่า 20% ของ NAV

ชื่อกองทุน:	Invesco QQQ Trust, Series 1
ISIN Code:	US46090E1038
Bloomberg Ticker:	QQQ

ข้อมูลเชิงสถิติ

Maximum Drawdown	N/A
Recovering Period	N/A
FX Hedging	N/A
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน	N/A

การจัดสรรการลงทุนในต่างประเทศ*

ประเทศ	% NAV
สหรัฐอเมริกา	53.00
ไทย	47.00

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน*

Holding	% NAV
กองทุนต่างประเทศ	50.00
หุ้นกู้เอกชน	47.00
สัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Warrant)	3.00

ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก*

Holding	% NAV
กองทุน Invesco QQQ Trust, Series 1	50.00
หุ้นกู้บริษัท ทู คอร์ปอเรชั่น จำกัด (มหาชน)	9.16
หุ้นกู้บริษัท เจ เอ็ม ที เน็ทเวอร์ค เซอร์วิสซีเอส จำกัด (มหาชน)	9.16
หุ้นกู้บริษัท ลิลิ พร็อพเพอร์ตี้ จำกัด (มหาชน)	9.16
หุ้นกู้บริษัท เอเชียเสริมกิจสตีลซิง จำกัด (มหาชน)	4.70

* ข้อมูลดังกล่าวเป็นการคาดการณ์การลงทุน ซึ่งอาจเปลี่ยนแปลงได้

รายละเอียดการลงทุนเพิ่มเติม:

รายละเอียดการลงทุนในตราสารหนี้ เงินฝาก และสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

การลงทุนในส่วนที่ 2 กองทุนมีกลยุทธ์ในการลงทุนจนครบกำหนดอายุ (buy&hold) โดยส่วนนี้จะแบ่งการลงทุนออกเป็น 2 ส่วนย่อย ดังนี้

2.1 ลงทุนในตราสารหนี้ที่มีอันดับความน่าเชื่อถืออยู่ในอันดับที่สามารถลงทุนได้ (Investment Grade) และ/หรือเงินฝากทั้งในและ/หรือต่างประเทศ ประมาณร้อยละ 46.75-47.25 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน

ประมาณการตราสารและสัดส่วนที่คาดว่าจะลงทุนในส่วนของตราสารหนี้และ/หรือเงินฝาก

ตราสารที่ลงทุน*	อันดับความน่าเชื่อถือ ของผู้ออกตราสาร	สัดส่วน การลงทุน โดยประมาณ*	ผลตอบแทนที่คาดว่าจะได้รับ (ต่อปี)
หุ้นกู้บริษัท ทู คอร์ปอเรชั่น จำกัด (มหาชน)	TRIS : A+	9.16%	0.53%
หุ้นกู้บริษัท เอเชียเสริมกิจลีสซิ่ง จำกัด (มหาชน)	Fitch : A(thai)	4.70%	0.27%
หุ้นกู้บริษัท เอพี (ไทยแลนด์) จำกัด (มหาชน)	TRIS : A	1.18%	0.06%
หุ้นกู้บริษัท เงินติดล้อ จำกัด (มหาชน)	TRIS : A	4.47%	0.26%
หุ้นกู้บริษัท เจ เอ็ม ที เน็ทเวอร์ค เซอร์วิส เซส จำกัด (มหาชน)	TRIS : BBB+	9.16%	0.59%
หุ้นกู้บริษัท กลีล ปร็อพเพอร์ตี้ จำกัด (มหาชน)	TRIS : BBB+	9.16%	0.59%
หุ้นกู้บริษัท เมืองไทย แคปปิตอล จำกัด (มหาชน)	TRIS : BBB+	4.47%	0.32%
หุ้นกู้บริษัท ศรีสวัสดิ์ คอร์ปอเรชั่น จำกัด (มหาชน)	TRIS : BBB+	4.70%	0.33%
รวม		47.00%	
ประมาณการผลตอบแทนของตราสารหนี้และ/หรือเงินฝาก (ก่อนหักค่าใช้จ่าย)			2.95%

ทั้งนี้ บริษัทจัดการจะเปิดเผยพอร์ตการลงทุนและสัดส่วนการลงทุนให้ผู้ลงทุนทราบในหนังสือชี้ชวนส่วนสรุปข้อมูลสำคัญ และส่วนข้อมูลกองทุนรวมก่อนการเสนอขายหน่วยลงทุน

* บริษัทจัดการจะใช้ดุลยพินิจในการเปลี่ยนแปลงทรัพย์สินที่ลงทุนหรือสัดส่วนการลงทุนได้ต่อเมื่อเป็นการดำเนินการภายใต้สถานการณ์ที่จำเป็นและสมควร เพื่อรักษาผลประโยชน์ของผู้ลงทุนเป็นสำคัญ โดยไม่ทำให้ความเสียหายของทรัพย์สินที่ลงทุนเปลี่ยนแปลงไปอย่างมีนัยสำคัญ โดยบริษัทอาจพิจารณาลงทุนในตราสารหนี้อื่นแทน และ/หรือเพิ่มเติมจากตราสารที่ระบุไว้ข้างต้น ซึ่งตราสารดังกล่าวจะอยู่ภายใต้การดูแลของกองทุนของบริษัทจัดการ โดยประมาณการอัตราผลตอบแทนของตราสารที่ลงทุนอาจมีการเปลี่ยนแปลงได้ ทั้งนี้ การเปลี่ยนแปลงดังกล่าวอาจทำให้ผู้ถือหน่วยลงทุนไม่ได้รับผลตอบแทนตามอัตราที่ประมาณการไว้ อย่างไรก็ตาม ในกรณีที่มีการเปลี่ยนแปลงสัดส่วนการลงทุนของเงินลงทุนในส่วนที่ 2.1 จะส่งผลให้เงินลงทุนในส่วนที่ 2.2 เปลี่ยนแปลงไปด้วย

2.2 ลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) ประเภทสัญญาออพชัน (Option) หรือวอร์แรนต์ (Warrant) ที่มีการจ่ายผลตอบแทนอ้างอิงกับการเปลี่ยนแปลงราคาของกองทุน Invesco QQQ Trust, Series 1 ที่กำหนดเงื่อนไขในการจ่ายผลตอบแทน ประมาณร้อยละ 2.75-3.25 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน

รายละเอียดและเงื่อนไขของสัญญาออพชันหรือวอร์แรนต์ที่กองทุนลงทุน

สินทรัพย์อ้างอิง (Underlying)	Invesco QQQ Trust, Series 1
สกุลเงิน	สกุลเงินดอลลาร์สหรัฐ (USD)
อายุตราสาร	ประมาณ 2 ปี (วันเริ่มต้นสัญญา ถึง วันพิจารณาสินทรัพย์อ้างอิง)
วันเริ่มต้นสัญญา	วันที่กองทุนเริ่มลงทุนในสัญญาออพชันหรือวอร์แรนต์
วันพิจารณาสินทรัพย์อ้างอิง	วันสุดท้ายที่ประเมินระดับของสินทรัพย์อ้างอิงตามสัญญา หากตรงกับวันหยุดจะใช้วันทำการถัดไปแทน
Barrier Price	60% ของราคาสินทรัพย์อ้างอิงเริ่มต้น (เหตุการณ์ Barrier Event จะเกิดขึ้นเมื่อ ณ วันใดวันหนึ่งราคาปิดของสินทรัพย์อ้างอิง (Underlying) ต่ำกว่าราคา Barrier (Barrier Price))
อัตราส่วนร่วม (Participation Rate: PR)	100% (อัตราส่วนร่วมในผลตอบแทน ที่กำหนดโดยคู่สัญญาหรือผู้ออกตราสาร)
Put Strike Price (K _{Put})	100% ของราคาสินทรัพย์อ้างอิงเริ่มต้น
Call Strike Price (K _{Call})	60% ของราคาสินทรัพย์อ้างอิงเริ่มต้น
อัตราผลตอบแทนชดเชย (Rebate Rate)	10% (อัตราผลตอบแทนชดเชยจะเกิดขึ้นเมื่อ ณ วันใดวันหนึ่งราคาปิดของสินทรัพย์อ้างอิง (Underlying) ต่ำกว่าราคา Barrier (Barrier Price) โดยเริ่มตั้งแต่วันที่ทำการถัดจากวันเริ่มต้นสัญญาถึงวันพิจารณาสินทรัพย์อ้างอิง)

ขนาดสัญญาของอปชั่นหรือวอร์แรนท์ (เงินต้น หรือ Nominal Amount)	ประมาณร้อยละ 50 ของจำนวนเงินที่ได้รับจากการเสนอขายหน่วยลงทุน โดยขนาดสัญญาของอปชั่นหรือวอร์แรนท์ จะถูกแปลงเป็นสกุลเงินดอลลาร์สหรัฐ ณ วันที่ลงทุน ณ วันครบกำหนดอายุตราสาร ผลตอบแทนจากการลงทุนในสัญญาของอปชั่นหรือวอร์แรนท์จะถูกแปลงเป็นสกุลเงินบาท ซึ่งจะขึ้นอยู่กับอัตราแลกเปลี่ยน ณ วันที่คำนวณผลตอบแทน กองทุนจึงมีความเสี่ยงที่จะได้รับผลตอบแทนสูงหรือต่ำกว่าที่ระบุไว้ได้
ข้อมูลสำคัญเกี่ยวกับสินทรัพย์อ้างอิง	กองทุน Invesco QQQ Trust, Series 1 เป็นกองทุนประเภท Exchange Traded Fund (ETF) ที่จดทะเบียนซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ NASDAQ ประเทศสหรัฐอเมริกา ซึ่งบริหารจัดการโดย Invesco Capital Management LLC (Invesco Capital Management LLC ไม่ได้มีความเกี่ยวข้องกับบริษัทจัดการ จึงทำหน้าที่ได้อย่างอิสระจากบริษัทจัดการ) กองทุน Invesco QQQ Trust, Series 1 จะลงทุนในหุ้นที่อยู่ในดัชนี NASDAQ-100 ในแบบเชิงรับ เพื่อสร้างผลตอบแทนให้ใกล้เคียงกับดัชนี NASDAQ-100 ดัชนี NASDAQ-100 จะประกอบไปด้วยหุ้นของบริษัทขนาดใหญ่ที่มีมูลค่าตลาดสูงที่สุดจำนวน 100 บริษัท และจดทะเบียนซื้อขายในตลาดหุ้น NASDAQ ทั้งนี้ กองทุน Invesco QQQ Trust, Series 1 และดัชนี NASDAQ-100 จะมีการปรับสมดุล (rebalanced) เป็นรายไตรมาส และสร้างใหม่ (reconstituted) เป็นรายปี ผู้ถือหน่วยลงทุนสามารถเข้าถึงข้อมูล Invesco QQQ Trust, Series 1 เพื่อศึกษาข้อมูลเพิ่มเติมได้ที่ https://www.invesco.com/qqq-etf/en/about.html
เหตุการณ์ที่ส่งผลกระทบต่อการลงทุน	กองทุนของสงวนสิทธิปรับเงื่อนไขการจ่ายผลตอบแทนหากเกิดเหตุการณ์ใดเหตุการณ์หนึ่ง โดยผู้แทนการคำนวณมูลค่ายุติธรรมของสัญญาของอปชั่นหรือวอร์แรนท์ (Calculation agent) จะคำนวณการจ่ายผลตอบแทนจากเหตุการณ์ที่เกิดขึ้นจริง ซึ่งผู้จัดการกองทุนจะพิจารณาพร้อมกับผู้แทนการคำนวณ โดยยึดถือผลประโยชน์ของผู้ถือหน่วยลงทุนเป็นสำคัญ เหตุการณ์ดังกล่าวมีดังนี้ 1) การยกเลิกสินทรัพย์อ้างอิงที่กองทุนใช้อ้างอิง 2) ผู้ประกาศสินทรัพย์อ้างอิงไม่สามารถคำนวณหรือไม่สามารถประกาศราคาสินทรัพย์อ้างอิงอย่างเป็นทางการได้ 3) การเปลี่ยนแปลงวิธีการคำนวณสินทรัพย์อ้างอิง 4) การเปลี่ยนแปลงกฎหมายหรือข้อบังคับที่ส่งผลกระทบต่อสินทรัพย์อ้างอิงหรือสัญญาของอปชั่นหรือวอร์แรนท์ 5) คู่สัญญาของอปชั่นหรือวอร์แรนท์ที่มีการจ่ายผลตอบแทนอ้างอิงกับระดับของสินทรัพย์อ้างอิง มีต้นทุนในการป้องกันความเสี่ยงเพิ่มขึ้น เช่น จากการเพิ่มขึ้นของอัตราดอกเบี้ย การซื้อขาย ค่าใช้จ่าย และค่าธรรมเนียมต่างๆ ทั้งนี้ เป็นไปตามเงื่อนไขที่ระบุในหนังสือชี้ชวนของธนาคารผู้ค้า
ผู้ออกสัญญาของอปชั่นหรือวอร์แรนท์	ธนาคารพาณิชย์และ/หรือสถาบันการเงินที่มีอันดับความน่าเชื่อถือไม่ต่ำกว่าอันดับที่สามารถลงทุนได้ (Investment Grade)

หมายเหตุ :

บริษัทจัดการของสงวนสิทธิเปลี่ยนแปลงค่าอัตราส่วนร่วม (Participation Rate: PR), Rebate Rate, Put Strike Price (K_{put}), Call Strike Price (K_{call}), Barrier Price เมื่อมีความจำเป็นและสมควร หากสถานะตลาดมีการเปลี่ยนแปลงหรือเป็นไปตามดุลยพินิจของผู้จัดการกองทุน เพื่อรักษาผลประโยชน์ของผู้ลงทุนหรือเพื่อเพิ่มผลตอบแทนโดยรวมให้กับผู้ลงทุน โดยจะแจ้งให้ผู้ลงทุนทราบในหนังสือชี้ชวนส่วนสรุปข้อมูลสำคัญ และส่วนข้อมูลกองทุนรวมก่อนการเสนอขายหน่วยลงทุน

เงื่อนไขการจ่ายผลตอบแทน ณ วันครบอายุโครงการ

	เงื่อนไข	ผลตอบแทนที่คาดว่าจะได้รับ ก่อนหักค่าใช้จ่าย (ถ้ามี)
กรณีที่ 1	ไม่เคยเกิด Barrier Event ที่ต่ำกว่า 60% ของราคาสินทรัพย์อ้างอิงเริ่มต้น และ ราคาสินทรัพย์อ้างอิง (Underlying) ณ วันพิจารณาสินทรัพย์อ้างอิง เพิ่มขึ้นมากกว่า +0% เมื่อเทียบกับราคา ณ วันเริ่มต้นสัญญา	ได้รับผลตอบแทนจากการลงทุนในกองทุน Invesco QQQ Trust, Series 1 และตราสารหนี้และ/หรือเงินฝาก <u>แต่</u> ไม่ได้รับผลตอบแทนจากการลงทุนในสัญญาของอปชั่นหรือวอร์แรนท์
กรณีที่ 2	ไม่เคยเกิด Barrier Event ที่ต่ำกว่า 60% ของราคาสินทรัพย์อ้างอิงเริ่มต้น และ ราคาสินทรัพย์อ้างอิง (Underlying) ณ วันพิจารณาสินทรัพย์อ้างอิง ลดลงแต่ยังอยู่ในระดับ $\geq 60\%$ ของราคา ณ วันเริ่มต้นสัญญา (ผลตอบแทนติดลบไม่เกิน 40%)	ได้รับผลตอบแทนจากการลงทุนในกองทุน Invesco QQQ Trust, Series 1 และตราสารหนี้และ/หรือเงินฝาก <u>และ</u> ผลตอบแทนจากสัญญาของอปชั่นหรือวอร์แรนท์

	เงื่อนไข	ผลตอบแทนที่คาดว่าจะได้รับ ก่อนหักค่าใช้จ่าย (ถ้ามี)
		= เงินต้น x PR x [(Put Strike Price หรือ K_{Put} - ราคาสินทรัพย์อ้างอิง ณ วันพิจารณาสินทรัพย์อ้างอิง หรือ U_t) / ราคาสินทรัพย์อ้างอิง ณ วันเริ่มต้นสัญญา หรือ U_0] x อัตราแลกเปลี่ยน
กรณีที่ 3	เกิด Barrier Event โดยราคาสินทรัพย์อ้างอิง (Underlying) ณ วันใดวันหนึ่ง ลดลงต่ำกว่าระดับ 60% ของราคา ณ วันเริ่มต้นสัญญา (ผลตอบแทนติดลบเกิน 40%)	ได้รับผลตอบแทนจากการลงทุนในกองทุน Invesco QQQ Trust, Series 1 และตราสารหนี้และ/หรือเงินฝาก และอัตราผลตอบแทนชดเชย (Rebate Rate) 10% และผลตอบแทนจากสัญญาออปชั่นหรือออร์เรนจ์ = เงินต้น x [ค่าที่สูงสุดระหว่าง 0 หรือ PR x (ราคาสินทรัพย์อ้างอิง ณ วันพิจารณาสินทรัพย์อ้างอิง หรือ U_t - Call Strike Price หรือ K_{Call}) / ราคาสินทรัพย์อ้างอิง ณ วันเริ่มต้นสัญญา หรือ U_0] x อัตราแลกเปลี่ยน

หมายเหตุ:

- กองทุนอาจไม่ได้รับผลตอบแทนตามที่คาดหมายไว้ หากผู้ออกตราสารหรือคู่สัญญาที่กองทุนลงทุนไม่สามารถชำระเงินต้น ดอกเบี้ย และ/หรือผลตอบแทนอื่นใดตามที่ตกลงกันได้ไว้ได้ ดังนั้น ผู้ลงทุนควรต้องศึกษาและทำความเข้าใจรายละเอียดลักษณะของกองทุนอย่างถี่ถ้วนก่อนตัดสินใจลงทุน
- การลงทุนและผลตอบแทนจากการลงทุนในสัญญาออปชั่นหรือออร์เรนจ์ จะได้รับเมื่อถึงจนครบอายุสัญญา โดยจะอยู่ในรูปของสกุลเงินดอลลาร์สหรัฐ (USD) ซึ่งมีความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยนเมื่อแปลงเป็นสกุลเงินบาท
- ในการพิจารณาว่าเข้าเงื่อนไขการได้รับผลตอบแทนตามกรณีใด กองทุนจะพิจารณาค่าการเปลี่ยนแปลงของสินทรัพย์อ้างอิงทุกสิ้นวันทำการ

สูตรการคำนวณผลตอบแทนจากสัญญาออปชั่นหรือออร์เรนจ์

กรณีที่ 2

$$N \times \left[PR \times \text{Max} \left(0 ; \frac{K_{Put} - U_F}{U_0} \right) \right]$$

กรณีที่ 3

$$N \times \left[\text{Rebate} + PR \times \text{Max} \left(0 ; \frac{U_F - K_{Call}}{U_0} \right) \right]$$

โดยที่

N = เงินต้น (Nominal Amount)

PR = อัตราส่วนร่วม (Participation Rate)

Rebate = อัตราผลตอบแทนชดเชย (Rebate Rate)

K_{Put} = Put Strike Price of the Underlying

K_{Call} = Call Strike Price of the Underlying

U_0 = ราคาสินทรัพย์อ้างอิง ณ วันเริ่มต้นสัญญา (Initial Spot Price)

U_t = ราคาสินทรัพย์อ้างอิง ณ วันพิจารณาสินทรัพย์อ้างอิง

ในกรณีที่เกิดเหตุการณ์ใดๆ ซึ่งอาจมีผลกระทบต่อเงื่อนไขและการคำนวณผลตอบแทนจากการลงทุนในสัญญาออปชั่นหรือออร์เรนจ์ เช่น คู่สัญญามีการยกเลิกสัญญาอันเนื่องมาจากสถานะตลาดมีการผันผวนอย่างรุนแรงจนไม่สามารถออกสัญญาออปชั่นหรือออร์เรนจ์ให้กองทุนภายใต้เงื่อนไขเดิมได้ กองทุนจึงต้องเปลี่ยนคู่สัญญาใหม่ เป็นต้น การคำนวณผลตอบแทนดังกล่าวจะเป็นไปตามข้อตกลงที่ระบุไว้ในสัญญาที่กองทุนลงทุน ซึ่งบริษัทจัดการจะแจ้งเงื่อนไขดังกล่าวให้ผู้ถือหุ้นฯ ลงทุนทราบภายใน 15 วันนับตั้งแต่วันที่เกิดเหตุการณ์นั้นๆ ขึ้น โดยจะแจ้งผ่านเว็บไซต์ของบริษัทจัดการ

เงื่อนไขของสัญญาออปชั่นหรือออร์เรนจ์จะเป็นไปตามสัญญาที่กองทุนได้ทำการตกลงร่วมกันกับทางธนาคารคู่ค้า ทั้งนี้ หากเกิดเหตุการณ์ที่เกี่ยวข้องกับสินทรัพย์อ้างอิง และ/หรือบริษัทผู้ให้บริการสินทรัพย์อ้างอิงอย่างมีนัยสำคัญ เช่น หลักการการคำนวณราคามีการเปลี่ยนแปลง สินทรัพย์อ้างอิงถูกยกเลิก และ/หรือบริษัทผู้ให้บริการสินทรัพย์อ้างอิงปิดกิจการ เป็นต้น ซึ่งอาจเป็นเหตุให้สัญญามีอันต้องสิ้นสภาพก่อนกำหนด ธนาคารคู่ค้าจะทำการคำนวณราคาเพื่อใช้ในการยกเลิกสัญญาที่กำหนด

ธนาคารคู่ค้าในฐานะนายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ และเป็นผู้กำหนดราคาในตลาดรองโดยคำนึงถึงสถานะตลาด และไม่รับรองว่าจะมีการซื้อขายหลักทรัพย์ในราคาดังกล่าว ทั้งนี้ ธนาคารคู่ค้าอาจจะปรับหรือยุติการทำราคาโดยไม่ต้องแจ้งให้ทราบล่วงหน้า

ธนาคารคู่ค้าและบริษัทในเครืออาจมีบทบาทต่างๆ ที่เกี่ยวข้องกับสัญญาออปชั่นหรือออร์เรนจ์ ซึ่งอาจมีความขัดแย้งทางผลประโยชน์ที่เกิดขึ้นจากบทบาทที่ดำเนินการเกี่ยวกับสัญญาออปชั่นหรือออร์เรนจ์

ธนาคารคู่ค้าขอสงวนสิทธิ์ในการเปลี่ยนแปลงหรือยุติการแต่งตั้งตัวแทนการคำนวณ (Calculation Agent) โดยมีเงื่อนไขว่าจะมีตัวแทนการคำนวณตลอดเวลา ทั้งนี้ การยุติดังกล่าวจะแจ้งให้กับกองทุนทราบตามที่ระบุไว้ในโดยตัวแทนการคำนวณอาจมอบหมายภาระหน้าที่และหน้าที่ใดๆ ของตนให้กับบุคคลที่สามตามที่เห็นสมควร

อาจมีเหตุการณ์ที่กระทบต่อตลาดหลักทรัพย์ (Market Disruption Event) ที่เกี่ยวข้องกับกองทุน ETF ในตลาดหลักทรัพย์ที่มีการซื้อขายกองทุน ETF หรือในสัญญาออพชั่นหรือวอร์แรนท์ที่เกี่ยวข้องกับกองทุน ETF ในตลาดหลักทรัพย์ที่เกี่ยวข้อง หรือเหตุการณ์ใดๆ ที่ตัวแทนการคำนวณพิจารณาว่ากระทบต่อตลาดหรือมูลค่าการซื้อขายของหลักทรัพย์ หรือเกิดเหตุการณ์ที่ทำให้ตลาดหลักทรัพย์สำหรับกองทุน ETF ดังกล่าว ไม่สามารถเปิดทำการซื้อขายได้ตามปกติหรือเหตุการณ์ที่ส่งผลกระทบต่อความสามารถคำนวณราคาปิดของหลักทรัพย์ ทั้งนี้ เป็นไปตามเงื่อนไขที่ระบุในหนังสือชี้ชวนของธนาคารผู้ค้า

หากเหตุการณ์ Adjustment Events เกิดขึ้น เช่น กองทุน ETF อาจถูกเพิกถอนจากตลาด การเปลี่ยนแปลงลักษณะโครงสร้างของกองทุน ETF การเปลี่ยนแปลงทางกฎหมาย เป็นต้น ธนาคารผู้ค้าอาจใช้ดุลยพินิจในการกำหนดให้ตัวแทนการคำนวณ (Calculation Agent) ทำการปรับเปลี่ยนดังกล่าว ตามเงื่อนไขของสัญญาตามที่เห็นว่าจำเป็นหรือเหมาะสม หรือธนาคารผู้ค้าอาจยกเลิกสัญญาออพชั่นหรือวอร์แรนท์ โดยตัวแทนการคำนวณจะต้องแจ้งให้ธนาคารผู้ค้าทราบโดยเร็วเมื่อเกิดเหตุการณ์ Adjustment Events ทั้งนี้ เป็นไปตามเงื่อนไขที่ระบุในหนังสือชี้ชวนของธนาคารผู้ค้า

ทั้งนี้ ในบางสถานการณ์สัญญาออพชั่นหรือวอร์แรนท์อาจถูกไถ่ถอนก่อนกำหนด (Early Termination) เช่น ความไม่ชอบด้วยกฎหมาย เกิดการแทรกแซงโดยทางการ หรือการคว่ำบาตรในธุรกรรมเพื่อป้องกันความเสี่ยง และเหตุผลเกี่ยวกับภาษี นอกจากนี้ อาจมีการยกเลิกและไถ่ถอนสัญญาออพชั่นหรือวอร์แรนท์ก่อนกำหนดในกรณีอื่นๆ ตามที่ตัวแทนการคำนวณ (Calculation Agent) กำหนด หรือตามที่ระบุไว้เป็นอย่างอื่นตามข้อกำหนดของสัญญา ตามที่ธนาคารผู้ค้าระบุไว้ในหนังสือชี้ชวน

ตัวอย่างเงื่อนไขการจ่ายผลตอบแทนที่กองทุนได้รับจากการลงทุนในสัญญาออพชั่นหรือวอร์แรนท์

ข้อมูลสำคัญที่ผู้ลงทุนควรทราบเพื่อประกอบการพิจารณาข้อมูลในส่วนนี้

รายละเอียดเกี่ยวกับสินทรัพย์อ้างอิง (Underlying), ค่าอัตราส่วนร่วม (Participation Rate: PR), อัตราผลตอบแทนชดเชย (Rebate Rate), Put Strike Price (K_{Put}), Call Strike Price (K_{Call}), Barrier Price ในตัวอย่างต่อไปนี้ เป็นเพียงข้อมูลตัวอย่างที่จัดทำขึ้นเพื่อใช้ในการคำนวณเท่านั้น ทั้งนี้ รายละเอียดของสัญญาออพชั่นหรือวอร์แรนท์ที่กองทุนจะลงทุนจริงอาจมีความแตกต่างจากตัวอย่างนี้ได้ ซึ่งขึ้นอยู่กับสถานะตลาด สถานการณ์การลงทุน และ/หรือปัจจัยอื่นๆ ด้านการลงทุน โดยจะเป็นไปตามดุลยพินิจของบริษัทจัดการ ซึ่งบริษัทจัดการจะแจ้งให้ผู้ถือหน่วยลงทุนทราบผ่านทางเว็บไซต์ของบริษัทจัดการและ/หรือช่องทางที่เหมาะสมภายหลังจากดำเนินการลงทุนในสัญญาออพชั่นหรือวอร์แรนท์แล้ว

สมมติให้

ราคาสินทรัพย์อ้างอิง ณ วันเริ่มต้นสัญญา Initial Spot Price (U_0)	100
ราคาสินทรัพย์อ้างอิง ณ วันพิจารณาสินทรัพย์อ้างอิง (U_T)	ราคาปิดของสินทรัพย์อ้างอิง ณ วันพิจารณาสินทรัพย์อ้างอิง
Put Strike Price of the Underlying (K_{Put})	100% ของราคาสินทรัพย์อ้างอิง ณ วันเริ่มต้นสัญญา
Call Strike Price of the Underlying (K_{Call})	60% ของราคาสินทรัพย์อ้างอิง ณ วันเริ่มต้นสัญญา
Barrier Price of the Underlying ($U_{Barrier}$)	60% ของราคาสินทรัพย์อ้างอิง ณ วันเริ่มต้นสัญญา
เหตุการณ์ Barrier Event	เหตุการณ์ Barrier Event เกิดขึ้นเมื่อราคาสินทรัพย์อ้างอิง (Underlying) ณ วันใดวันหนึ่ง ลดลงเกิน Barrier Price (60% ของราคาสินทรัพย์อ้างอิง ณ วันเริ่มต้นสัญญา)
PR	100%
Rebate Rate	10%

ตัวอย่างการคำนวณผลตอบแทน

สมมติฐาน:

- เงินลงทุนในสัญญาออพชั่นหรือวอร์แรนท์ คือ 1,000,000 บาท
- อัตราส่วนร่วม (Participation Rate : PR) จากการลงทุนในสัญญาออพชั่นหรือวอร์แรนท์ คือ ร้อยละ 100
- อัตราผลตอบแทนชดเชย (Rebate Rate) จากการลงทุนในสัญญาออพชั่นหรือวอร์แรนท์ คือ ร้อยละ 10
- Put Strike Price of the Underlying (K_{Put}) คือ 100
- Call Strike Price of the Underlying (K_{Call}) คือ 60
- ระดับราคาของสินทรัพย์อ้างอิงตามตารางดังนี้

กรณีที่	ราคาสินทรัพย์อ้างอิง ณ วันเริ่มต้นสัญญา	ราคาสินทรัพย์อ้างอิง ในระหว่างอายุสัญญา	ราคาสินทรัพย์อ้างอิง ณ วันพิจารณาสินทรัพย์อ้างอิง (U_T)
1	100	ลดลงหรือเพิ่มขึ้น โดยลดลงไม่เกิน 60 จากวันเริ่มต้นสัญญา	110 (เพิ่มขึ้นมากกว่า +0% เมื่อเทียบกับราคา ณ วันเริ่มต้นสัญญา)
2	100 ($K_{Put} = 100, U_0 = 100$)	ลดลงหรือเพิ่มขึ้น โดยลดลงไม่เกิน 60 จากวันเริ่มต้นสัญญา	90 (ลดลงแต่ยังอยู่ในระดับ $\geq 60\%$ ของราคา ณ วันเริ่มต้นสัญญา) (หรือผลตอบแทนคิดลบไม่เกิน 40%)
3	100 ($K_{Call} = 60, U_0 = 100$)	ลดลงหรือเพิ่มขึ้น โดย ณ วันใดวันหนึ่ง ลดลงต่ำกว่าระดับ 60 ของราคา ณ วันเริ่มต้นสัญญา	กรณีที่ 3.1 50 (ลดลงต่ำกว่าระดับ 60% ณ วันพิจารณา) (หรือผลตอบแทนคิดลบเกิน 40%) กรณีที่ 3.2

กรณี	ราคาสินทรัพย์อ้างอิง ณ วันเริ่มต้นสัญญา	ราคาสินทรัพย์อ้างอิง ในระหว่างอายุสัญญา	ราคาสินทรัพย์อ้างอิง ณ วันพิจารณาสินทรัพย์อ้างอิง (U_t)
			120 (เพิ่มขึ้นมากกว่าระดับ 60% ณ วันพิจารณา)

* ค่าอัตราส่วนร่วม (Participation Rate: PR), อัตราผลตอบแทนชดเชย (Rebate Rate), Put Strike Price (K_{Put}), Call Strike Price (K_{Call}), Barrier Price เป็นตัวเลขสมมติ เพื่อให้ผู้ถือหน่วยลงทุนมีความเข้าใจในสินค้าหรือตัวแปรเท่านั้น

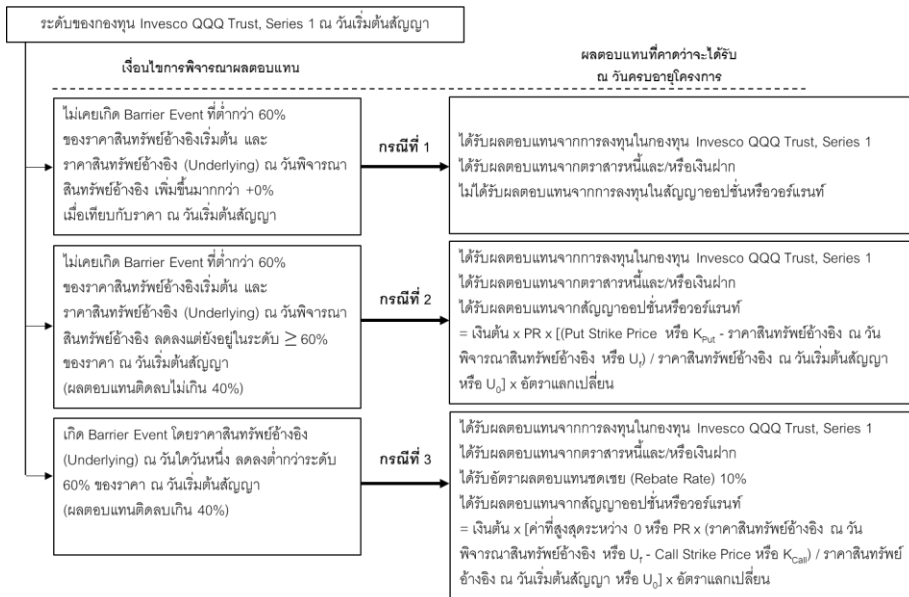
ตัวอย่างผลตอบแทนของสัญญาออพชั่นหรือวอร์แรนท์ที่คาดว่าจะได้รับจากการลงทุนในแต่ละกรณี (ภายใต้สมมติฐานว่าอัตราแลกเปลี่ยนไม่มีการเปลี่ยนแปลง)

กรณี	เงื่อนไข	เงินลงทุน (บาท)	ผลตอบแทนของสัญญาออพชั่นหรือวอร์แรนท์
1	ราคาสินทรัพย์อ้างอิง (Underlying) ณ วันพิจารณาสินทรัพย์อ้างอิง เพิ่มขึ้นมากกว่า +0% เมื่อเทียบกับราคา ณ วันเริ่มต้นสัญญา	1,000,000	ไม่ได้รับผลตอบแทนจากการลงทุนในสัญญาออพชั่นหรือวอร์แรนท์
2	ราคาสินทรัพย์อ้างอิง (Underlying) ณ วันพิจารณาสินทรัพย์อ้างอิงลดลง แต่ยังอยู่ในระดับ $\geq 60\%$ ของราคา ณ วันเริ่มต้นสัญญา (ผลตอบแทนติดลบไม่เกิน 40%)	1,000,000	ได้รับผลตอบแทนจากสัญญาออพชั่นหรือวอร์แรนท์ $= \text{เงินต้น} \times \text{PR} \times [(\text{Put Strike Price หรือ } K_{Put} - \text{ราคาสินทรัพย์อ้างอิง ณ วันพิจารณาสินทรัพย์อ้างอิง หรือ } U_t) / \text{ราคาสินทรัพย์อ้างอิง ณ วันเริ่มต้นสัญญา หรือ } U_0]$ $= 1,000,000 \times 100\% \times [(100 - 90)/100]$ $= 100,000 \text{ บาท}$ อัตราผลตอบแทนจากสัญญาออพชั่นหรือวอร์แรนท์ = 10%
3	ราคาสินทรัพย์อ้างอิง (Underlying) ณ วันใดวันหนึ่ง ลดลงต่ำกว่าระดับ 60% ของราคา ณ วันเริ่มต้นสัญญา	1,000,000	
3.1	ราคาสินทรัพย์อ้างอิง (Underlying) ณ วันใดวันหนึ่ง ลดลงต่ำกว่าระดับ 60% ของราคา ณ วันเริ่มต้นสัญญา และราคาสินทรัพย์อ้างอิง ณ วันพิจารณา ลดลงต่ำกว่าระดับ 60% ณ วันพิจารณา (หรือผลตอบแทนติดลบเกิน 40%)	1,000,000	1) ได้รับอัตราผลตอบแทนชดเชย (Rebate Rate) 10% $= 1,000,000 \times 10\%$ $= 100,000 \text{ บาท}$ และ 2) ผลตอบแทนจากสัญญาออพชั่นหรือวอร์แรนท์ $= \text{เงินต้น} \times [\text{ค่าที่สูงสุดระหว่าง 0 หรือ PR} \times (\text{ราคาสินทรัพย์อ้างอิง ณ วันพิจารณาสินทรัพย์อ้างอิง หรือ } U_t - \text{Call Strike Price หรือ } K_{Call}) / \text{ราคาสินทรัพย์อ้างอิง ณ วันเริ่มต้นสัญญา หรือ } U_0]$ $= 1,000,000 \times [\text{ค่าที่สูงสุดระหว่าง 0 หรือ } 100\% \times (50 - 60)/100]$ $= 1,000,000 \times 0$ $= 0 \text{ บาท}$ อัตราผลตอบแทนจากสัญญาออพชั่นหรือวอร์แรนท์ = 0%
3.2	ราคาสินทรัพย์อ้างอิง (Underlying) ณ วันใดวันหนึ่ง ลดลงต่ำกว่าระดับ 60% ของราคา ณ วันเริ่มต้นสัญญา (หรือผลตอบแทนติดลบเกิน 40%) และราคาสินทรัพย์อ้างอิง ณ วันพิจารณา เพิ่มขึ้นมากกว่าระดับ 60%	1,000,000	1) ได้รับอัตราผลตอบแทนชดเชย (Rebate Rate) 10% $= 1,000,000 \times 10\%$ $= 100,000 \text{ บาท}$ และ 2) ผลตอบแทนจากสัญญาออพชั่นหรือวอร์แรนท์ $= \text{เงินต้น} \times [\text{ค่าที่สูงสุดระหว่าง 0 หรือ PR} \times (\text{ราคาสินทรัพย์อ้างอิง ณ วันพิจารณาสินทรัพย์อ้างอิง หรือ } U_t - \text{Call Strike Price หรือ } K_{Call}) / \text{ราคาสินทรัพย์อ้างอิง ณ วันเริ่มต้นสัญญา หรือ } U_0]$ $= 1,000,000 \times [\text{ค่าที่สูงสุดระหว่าง 0 หรือ } 100\% \times (120 - 60)/100]$ $= 1,000,000 \times 0.6$ $= 600,000 \text{ บาท}$ อัตราผลตอบแทนจากสัญญาออพชั่นหรือวอร์แรนท์ = 60%

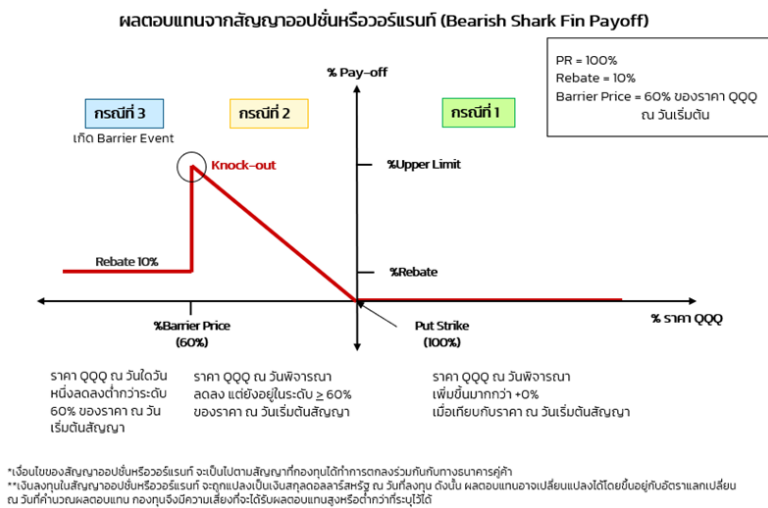
หมายเหตุ:

- (1) ข้อมูลและตัวอย่างตามสมมติฐานนี้เป็นเพียงข้อมูลที่จัดทำขึ้นเพื่อให้ผู้ลงทุนมีความเข้าใจในกลไกการลงทุนและเงื่อนไขของผลตอบแทนจากการลงทุนในสัญญาออพชั่นหรือวอร์เรนที่กองทุนลงทุน ซึ่งเป็นเพียงตัวอย่างการคำนวณเพื่อประกอบการอธิบายเท่านั้น มิได้เป็นการรับประกันว่าผู้ลงทุนจะได้รับผลตอบแทนตามที่แสดงไว้
- (2) จำนวนเงินการจ่ายผลตอบแทนของสัญญาออพชั่นหรือวอร์เรน เป็นจำนวนเงินก่อนหักค่าใช้จ่าย และการเปลี่ยนแปลงของอัตราแลกเปลี่ยน
- (3) ค่าอัตราส่วนร่วม (Participation Rate: PR), Rebate Rate, Put Strike Price (K_{Put}), Call Strike Price (K_{Call}), Barrier Price เป็นตัวเลขสมมติ เพื่อให้ผู้ถือหน่วยลงทุนมีความเข้าใจในสินค้าหรือตัวแปรเท่านั้น

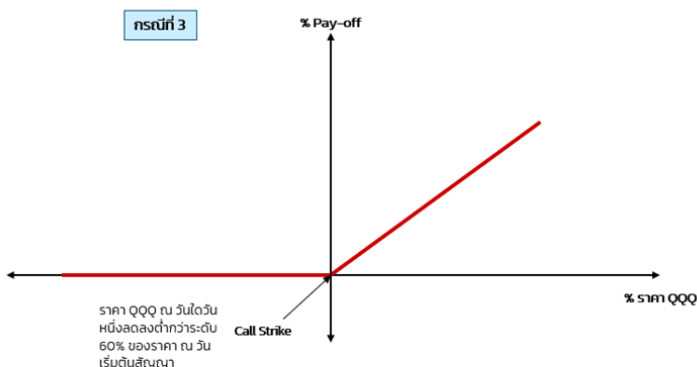
ตัวอย่างแผนภาพของรูปแบบการจ่ายผลตอบแทน



ตัวอย่างแผนภาพของรูปแบบผลตอบแทนจากสัญญาออพชั่นหรือวอร์เรน



ผลตอบแทนจากสัญญาออพชั่นหรือวอร์เรน แบบ Call Option Payoff Diagram



ข้อมูลสำคัญเกี่ยวกับสินทรัพย์อ้างอิง

ชื่อกองทุนรวมต่างประเทศ	Invesco QQQ Trust, Series 1
ประเภทกองทุน	Exchange Traded Fund (ETF)
ตลาดรอง	จดทะเบียนซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ NASDAQ ประเทศสหรัฐอเมริกา
บริหารจัดการโดย	Invesco Capital Management LLC
นโยบายการลงทุน	กองทุนจะลงทุนในหุ้นตามดัชนี Nasdaq-100 ที่จดทะเบียนซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ NASDAQ ประเทศสหรัฐอเมริกา โดยใช้นโยบายเชิงรับ เพื่อสร้างผลตอบแทนให้ใกล้เคียงกับดัชนี Nasdaq-100
ดัชนี NASDAQ-100	เป็นดัชนีที่ประกอบไปด้วยหุ้นของบริษัทขนาดใหญ่ที่มีมูลค่าตลาดสูงสุดจำนวน 100 บริษัท (ซึ่งไม่ใช่สถาบันการเงิน) และซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ NASDAQ
วันที่จัดตั้ง	10 มีนาคม 2542
อายุกองทุน	ไม่กำหนด
ผู้ดูแลผลประโยชน์	The Bank of New York Mellon
Ticker	QQQ
วันทำการซื้อขาย	ทุกวันทำการ
แหล่งข้อมูล	https://www.invesco.com/qqq-etf/en/about.html
ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (ร้อยละต่อปีของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน)	
ค่าธรรมเนียมการจัดการ (Management Fee)	0.20%
ค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายทั้งหมด (Total Expense Ratio)	0.20%

ความเสี่ยงของกองทุน Invesco QQQ Trust, Series 1

- การลงทุนในกองทุนอาจมีความเสี่ยงจากการที่มูลค่าของหลักทรัพย์ที่กองทุนลงทุนมีความผันผวน เนื่องจากการเปลี่ยนแปลงของสถานะทางการเงินของผู้ออกตราสาร มูลค่าหุ้นหรือปัจจัยอื่นๆ ทั้งนี้ ส่วนประกอบและน้ำหนักของหลักทรัพย์ในดัชนี รวมถึงส่วนประกอบและน้ำหนักของหลักทรัพย์ที่กองทุนลงทุนอาจเปลี่ยนแปลงได้ในบางช่วงเวลา
- กองทุนอาจมีความเสี่ยงจากการลงทุนในตราสารทุนที่เป็นส่วนประกอบของดัชนีซึ่งกระจุกตัวในบางหมวดอุตสาหกรรม เช่น อุตสาหกรรมเทคโนโลยี และความเสี่ยงเฉพาะที่มีผลต่อผลการดำเนินงานของหลักทรัพย์ที่มีการกระจุกตัวของน้ำหนักในดัชนี รวมถึงการปรับลดลงของราคาหุ้นในหมวดอุตสาหกรรมและบริษัทที่มีการกระจุกตัวดังกล่าว ดังนั้นมูลค่าหน่วยลงทุนของกองทุนอาจได้รับผลกระทบในเชิงลบ
- บริษัทในอุตสาหกรรมเทคโนโลยีอาจได้รับผลกระทบในทางลบจากความล้มเหลวในการได้รับเงินลงทุน หรือความล่าช้าในการได้รับเงินลงทุน หรือการอนุมัติตามกฎระเบียบ การแข่งขันที่รุนแรงทั้งในประเทศและต่างประเทศ ความเข้ากันได้ของผลิตภัณฑ์ ความชอบของผู้บริโภค ค่าใช้จ่ายด้านทุนขององค์กร ความล่าช้าอย่างรวดเร็ว การวิจัยและพัฒนาสิ่งใหม่ๆ สินค้าและการแข่งขันด้านการบริการของบุคลากรที่มีคุณภาพ บริษัทในอุตสาหกรรมเทคโนโลยียังเผชิญกับการแข่งขันของเทคโนโลยีทางเลือก นอกจากนี้อุตสาหกรรมเทคโนโลยีที่มีการแข่งขันสูงอาจทำให้ราคาสินค้าและบริการเหล่านี้ถูกลงในอนาคต เทคโนโลยีบริษัทอาจมีสายผลิตภัณฑ์ ตลาด ทรัพยากรทางการเงิน หรือบุคลากรที่จำกัด บริษัทในอุตสาหกรรมเทคโนโลยีพึ่งพาสิทธิบัตรและสิทธิในทรัพย์สินทางปัญญา การสูญเสียหรือการด้อยค่าของสิทธิ์เหล่านี้ อาจส่งผลกระทบต่อความสามารถในการทำกำไรของบริษัท อุตสาหกรรมเทคโนโลยีมีการเปลี่ยนแปลงอย่างรวดเร็วและการเปลี่ยนแปลงที่สำคัญในเทคโนโลยีที่เห็นได้จากการก้าวที่เพิ่มขึ้นของการอัปเดตทางเทคโนโลยี มาตรฐานอุตสาหกรรมที่กำลังพัฒนา การปรับปรุงอย่างต่อเนื่องในความสามารถและคุณภาพของเทคโนโลยีดิจิทัล วงจรการพัฒนาใหม่ที่ สิ้นลงผลิตภัณฑ์และการปรับปรุงการพัฒนาในการส่งสัญญาณไร้สายที่เกิดขึ้นใหม่เทคโนโลยีและการเปลี่ยนแปลงในความต้องการและความพึงพอใจของลูกค้า ความสำเร็จ ของบริษัทในอุตสาหกรรมเทคโนโลยีขึ้นอยู่กับการนำเสนอผลิตภัณฑ์ใหม่ที่เหมาะสม

การกำหนดช่วงความกว้างของค่า Barrier Price, PR, Rebate Rate จะพิจารณาจากอัตราผลตอบแทนที่ได้รับจากการลงทุนในตราสารหนี้ และ/หรือเงินฝาก รวมถึงปัจจัยด้านต้นทุนในการลงทุนในสัญญาออปชั่นหรือออร์แรนท์ โดยตราสารที่มีคุณภาพดี ซึ่งมีโอกาสผิดนัดชำระหนี้ต่ำ มีผลต่อการกำหนดค่า Barrier Price ในระดับไม่กว้างมาก แต่หากตราสารที่มีคุณภาพด้อยลง จะมีผลต่อการกำหนดค่า Barrier Price ได้กว้างขึ้น

ทั้งนี้ จากข้อมูลสถิติการเคลื่อนไหวของ Invesco QQQ Trust, Series 1 (QQQ) ในอดีตที่ผ่านมา (ข้อมูลรายวันตั้งแต่วันที่ นับตั้งแต่วันที่ 10 มีนาคม 1999 ถึงวันที่ 11 กรกฎาคม 2023) มีโอกาสที่ผลตอบแทนในระยะเวลา 2 ปีใดๆ ของ Invesco QQQ Trust, Series 1 (QQQ) จะมีช่วงผลตอบแทนติดลบมากกว่า 40% คิดเป็น 7.1% ของจำนวนข้อมูลทั้งหมด จึงเป็นเหตุผลที่ค่า Barrier Price เป็นระดับเหมาะสม สอดรับกับอัตราผลตอบแทนที่ได้รับและต้นทุนค่าใช้จ่ายที่เกิดขึ้น เป็นการลดความเสี่ยงให้กับผู้ลงทุนในช่วงที่ตลาดผันผวน แต่ทั้งนี้ผลการดำเนินงานในอดีตมิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

กราฟแสดงการเปลี่ยนแปลงของ Invesco QQQ Trust, Series 1 ในช่วงระยะเวลา 5 ปีย้อนหลัง



ค่า Standard Deviation = 22.25 (ณ วันที่ 22 มิ.ย. 66)

* ที่มา: Bloomberg ข้อมูลย้อนหลัง 5 ปี ตั้งแต่ปี 2018 - 2023

** ความผันผวนของราคาหรือผลการดำเนินงานของสินค้าหรือตัวแปรที่สัญญาหรือตราสารอ้างอิง เป็นเพียงข้อมูลในอดีตหรือข้อมูลจำลองที่จัดทำขึ้นเพื่อให้ผู้ถือหน่วยลงทุนมีความเข้าใจในสินค้าหรือตัวแปรเท่านั้น ดังนั้น ราคา ผลการดำเนินงาน หรือความผันผวนของสินค้าหรือ ตัวแปรในอนาคตอาจเคลื่อนไหวในทิศทางที่ไม่เป็นไปตามข้อมูลในอดีตได้

คำอธิบาย

- **Maximum Drawdown** เปรอ์เซ็นต์ผลขาดทุนสูงสุดของกองทุนรวมในระยะเวลา 5 ปีย้อนหลัง (หรือตั้งแต่จัดตั้งกองทุนกรณีที่ยังไม่ครบ 5 ปี) โดยวัดจากระดับ NAV ต่อหน่วยที่จุดสูงสุดไปถึงจุดต่ำสุดในช่วงที่ NAV ต่อหน่วยปรับตัวลดลง ค่า Maximum Drawdown เป็นข้อมูลที่ช่วยให้ทราบถึงความเสี่ยงที่อาจจะขาดทุน จากการลงทุนในกองทุนรวม
- **Recovering Period** ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาตั้งแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลานานเท่าใด
- **FX Hedging** เปรอ์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน
- **อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน** ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตกองทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลาหนึ่ง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์กับผลรวมของมูลค่าการขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 1 ปีหารด้วยมูลค่า NAV ของกองทุนรวมเฉลี่ยในรอบระยะเวลาเดียวกัน กองทุนรวมที่มีค่า portfolio turnover สูง บ่งชี้ถึงการซื้อขายหลักทรัพย์บ่อยครั้งของผู้จัดการกองทุนและทำให้มีต้นทุนการซื้อขายหลักทรัพย์ที่สูง จึงต้องพิจารณาเปรียบเทียบกับผลการดำเนินงานของกองทุนรวมเพื่อประเมินความคุ้มค่าของการซื้อขายหลักทรัพย์ดังกล่าว
- **Yield to Maturity** อัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในตราสารหนี้โดยถือจนครบกำหนดอายุ ซึ่งคำนวณจากดอกเบี้ยที่จะได้รับในอนาคตตลอดอายุตราสารและเงินต้นที่จะได้รับคืนนำมาคิดลดเป็นมูลค่าปัจจุบัน โดยใช้วิธีอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมตราสารหนี้ คำนวณจากค่าเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักของ Yield to Maturity ของตราสารหนี้แต่ละตัวที่กองทุนมีการลงทุน และเนื่องจาก Yield to Maturity มีหน่วยมาตรฐานเป็นเปอร์เซ็นต์ต่อปี จึงสามารถนำไปใช้เปรียบเทียบกับอัตราผลตอบแทนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีนโยบายถือครองตราสารหนี้จนครบกำหนดอายุและมีลักษณะการลงทุนที่ใกล้เคียงกันได้

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน เอ็มเอฟซี จำกัด (มหาชน)

เลขที่ 199 อาคารคอลลัมน์ทาวเวอร์ ชั้น จี และชั้น 21-23

ถนนรัชดาภิเษก เขตคลองเตย กรุงเทพฯ 10110

โทรศัพท์: 0-2649-2000 www.mfcfund.com