

## กองทุนเปิด BCAP Mid Small CG ETF (BMSCG)

### ประเภทกองทุนรวม/ กลุ่มกองทุนรวม

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

### นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- ลงทุนในหุ้นที่เป็นส่วนประกอบของดัชนี BCAP Mid Small Cap CG Index TR รวมถึงหุ้นที่อยู่ระหว่างการเข้าหรือออกจากการเป็นหลักทรัพย์ที่เป็นส่วนประกอบของดัชนีอ้างอิงดังกล่าวด้วย กองทุนจะใช้กลยุทธ์การลงทุนเชิงรับ (Passive Management Strategy) โดยมุ่งหวังให้ผลประกอบการเคลื่อนไหวตามดัชนีชี้วัด โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน ซึ่งอาจพิจารณาเลือกใช้กลยุทธ์แบบ Full Replication หรือ Optimization
- กองทุนอาจพิจารณาลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) โดยมีวัตถุประสงค์เพื่อเป็นการเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน (Efficient Portfolio Management) ซึ่งรวมถึงการป้องกันความเสี่ยง (Hedging)
- กลยุทธ์การลงทุน มุ่งหวังให้ผลประกอบการเคลื่อนไหวตามดัชนีชี้วัด (Passive Management/Index Tracking)

### ระดับความเสี่ยง



เสี่ยงสูง

ลงทุนในตราสารทุนเป็นหลักโดยเฉลี่ยในรอบปีไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV

### ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน 21 มีนาคม 2561

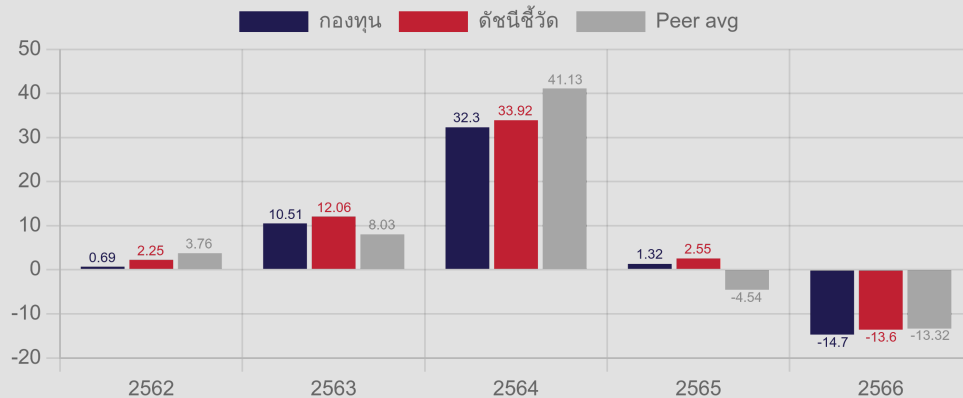
นโยบายการจ่ายเงินปันผล ไม่จ่าย

อายุกองทุน ไม่กำหนด

### ผู้จัดการกองทุน

นายเมธี เมฆอรุณเรือง (ตั้งแต่วันที่ 21 มี.ค. 2561)

### ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (% ต่อปี)



หมายเหตุ : ในปีที่กองทุนจดทะเบียนทรัพย์สิน หากกองทุนมีผลการดำเนินงานไม่ครบ 1 ปีปฏิทิน จะแสดงผลการดำเนินงานของปีปฏิทินแรกตั้งแต่วันที่กองทุนจดทะเบียนทรัพย์สินจนถึงวันที่การสุดท้ายของปีปฏิทิน

### ดัชนีชี้วัด

ดัชนี BCAP Mid Small Cap CG Index TR 100.00%

### ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปีกลม (%ต่อปี)

	YTD	3เดือน	6เดือน	1ปี	3ปี	5ปี	10ปี	ตั้งแต่จัดตั้ง
กองทุน	-2.45	1.93	-7.06	-19.06	2.39	2.85	N/A	-1.29
ดัชนีชี้วัด	-2.33	2.32	-6.43	-18.03	3.65	4.23	N/A	0.06
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	-2.13	1.25	-6.70	-17.77	2.71	4.22	N/A	N/A
ความผันผวนกองทุน	14.30	13.92	14.10	14.81	13.77	18.08	N/A	17.48
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	14.41	14.01	14.18	14.89	13.81	18.16	N/A	17.56

### คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวมมิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต : ได้รับการรับรองจาก CAC

ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือบริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่องได้ที่หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



www.bcacp.co.th

**การซื้อขายหน่วยลงทุน**

วันทำการซื้อ/ขายคืน : ทุกวันทำการของตลาดหลักทรัพย์

- ผู้ร่วมค้ำหน่วยลงทุนสามารถสั่งซื้อ/ขายคืนหน่วยลงทุนได้ที่บริษัทจัดการได้ทุกวันทำการของตลาดหลักทรัพย์ฯ

- ผู้สนใจลงทุนทั่วไปสามารถสั่งซื้อ/ขายคืนหน่วยลงทุนโดยผ่านผู้ร่วมค้ำหน่วยลงทุนด้วยวิธีการส่ง/รับมอบตะกร้าหลักทรัพย์ ตามขั้นตอนและวิธีการรับซื้อคืนที่ผู้ร่วมค้ำหน่วยลงทุนกำหนด

- ผู้สนใจลงทุนทั่วไปและผู้ร่วมค้ำหน่วยลงทุนสามารถซื้อ/ขายคืนหน่วยลงทุนผ่านตลาดหลักทรัพย์ฯ โดยปฏิบัติตามกฎ ระเบียบ และวิธีปฏิบัติของตลาดหลักทรัพย์ฯ

มูลค่าขั้นต่ำในการซื้อครั้งแรก : 20,000 บาท และเพิ่มเป็นทวีคูณของ 1,000 บาท

มูลค่าขั้นต่ำในการซื้อครั้งถัดไป : ไม่กำหนด

จำนวนหน่วยลงทุนขั้นต่ำของการซื้อครั้งถัดไป : สำหรับผู้ร่วมค้ำหน่วยลงทุน : 1 หน่วย

ของการซื้อขาย (creation unit : CU) และเพิ่มขึ้นเป็นทวีคูณของ 1 หน่วยของการซื้อขาย

**การขายหน่วยลงทุน**

มูลค่าขั้นต่ำในการขายคืน : ไม่กำหนด

ยอดคงเหลือขั้นต่ำ : ไม่กำหนด

จำนวนหน่วยลงทุนขั้นต่ำของการขายคืน : สำหรับผู้ร่วมค้ำหน่วยลงทุน : 1 หน่วยของการ

ซื้อขาย (creation unit : CU) และเพิ่มขึ้นเป็นทวีคูณของ 1 หน่วยของการซื้อขาย

ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน : ภายใน 5 วันทำการนับตั้งแต่วันที่ถัดจากวันส่งคำสั่งขายคืน

หน่วยลงทุน โดยบริษัทจัดการจะชำระเป็นตะกร้าหลักทรัพย์ตามอัตราส่วนและราย

ละเอียดของหลักทรัพย์ที่บริษัทจัดการกำหนด

**ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุน (% ต่อปีของ NAV)**

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	1.3375%	1.07%
รวมค่าใช้จ่าย	1.9795%	1.42745%

หมายเหตุ - ค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายข้างต้นได้รวมภาษีมูลค่าเพิ่มและภาษีอื่นใดในตนเองเรียบร้อยแล้ว (ถ้ามี)  
 - บริษัทจัดการจะนำค่าธรรมเนียมการจัดการดังกล่าวไปบริจาคในอัตราร้อยละ 40 ของค่าธรรมเนียมการจัดการที่เรียกเก็บจากกองทุน ให้กับหน่วยงานที่ส่งเสริมธรรมาภิบาลไทย และหรือหน่วยงานที่ส่งเสริมการต่อต้านคอร์รัปชัน และหรือองค์กรอื่นใดที่เกี่ยวข้องกับหน่วยงานดังกล่าว  
 - ค่าใช้จ่ายข้างต้นเป็นอัตราตามรอบปีบัญชีปัจจุบัน ทั้งนี้ สามารถศึกษาข้อมูลเพิ่มเติมได้ที่หนังสือชี้ชวนส่วนข้อมูลกองทุนรวม

**ข้อมูลความเสี่ยงเชิงสถิติ**

Maximum drawdown	-49.14 %
Recovering Period	10 เดือน
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน	0.32 เท่า
Sharpe Ratio	0.11
Alpha	-1.27
Beta	1.00
Tracking Error	0.11 %
Tracking Difference	-1.03 %

**ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วยลงทุน (% ต่อมูลค่าซื้อขาย)**

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การขาย	1.07%	ปัจจุบันไม่เรียกเก็บ
การรับซื้อคืน	1.07%	ปัจจุบันไม่เรียกเก็บ
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า	ไม่มี	ไม่มี
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก	ไม่มี	ไม่มี
การโอน	ตามที่นายทะเบียนเรียกเก็บ	ปัจจุบันไม่เรียกเก็บ

หมายเหตุ - ค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายข้างต้นได้รวมภาษีมูลค่าเพิ่มและภาษีอื่นใดในตนเองเรียบร้อยแล้ว (ถ้ามี) ทั้งนี้ สามารถศึกษาข้อมูลเพิ่มเติมได้ที่หนังสือชี้ชวนส่วนข้อมูลกองทุนรวม

**การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม**

**5 อันดับแรก**

หมวดอุตสาหกรรม	สัดส่วน (%)
1. พัฒนาอสังหาริมทรัพย์	14.46
2. พลังงานและสาธารณูปโภค	11.47
3. อาหารและเครื่องดื่ม	10.82
4. เงินทุนและหลักทรัพย์	7.36
5. ขนส่งและโลจิสติกส์	7.17

**สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน**

ประเภททรัพย์สินที่ลงทุน	สัดส่วน (%)
1. หุ้นสามัญ	99.46
2. เงินฝากธนาคาร	1.32

**ทรัพย์สินที่ลงทุนสูงสุด 5 อันดับแรก**

ทรัพย์สิน 5 อันดับแรกที่มีมูลค่าการลงทุนสูงสุด	น้ำหนักการลงทุน (%)
1. บริษัท ศรีตรังแอโกรอินดัสทรี จำกัด (มหาชน) (STA)	3.09
2. บริษัท กันกุลเอ็นจิเนียริง จำกัด (มหาชน) (GUNKUL)	2.88
3. บริษัท ศรีตรังโกลฟส์ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) (STGT)	2.74
4. บริษัท สดาร์ ปีโตรเลียม รีไฟน์นิ่ง จำกัด (มหาชน) (SPRC)	2.72
5. บริษัท แสนสิริ จำกัด (มหาชน) (SIRI)	2.69

## คำอธิบาย

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

**Recovering Period** ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาตั้งแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้เวลานานเท่าใด

**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 แสดงว่าหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนมากกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด

**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 อาคารสิลมคอมเพล็กซ์ ชั้น 24 ห้องเลขที่ A-C ถนนสิลม แขวงสิลม เขตบางรัก กรุงเทพฯ 10500