

กองทุนเปิด BCAP MSCI Thailand ETF (BMSCITH)

ประเภทกองทุนรวม/ กลุ่มกองทุนรวม

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

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- กองทุนจะใช้กลยุทธ์การบริหารกองทุนเชิงรับ (Passive Management Strategy) โดยมุ่งหวังให้ผลประกอบการเคลื่อนไหวตามดัชนีชี้วัด โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชี ไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน โดยลงทุนในหลักทรัพย์ที่เป็นส่วนประกอบของดัชนี MSCI Thailand ex Foreign Board Index ซึ่งรวมถึงหลักทรัพย์ที่อยู่ระหว่างการเข้าหรือออกจากการเป็นหลักทรัพย์ที่เป็นองค์ประกอบของดัชนีอ้างอิงด้วย โดยมุ่งเน้นที่จะลงทุนในหุ้นเต็มอัตรา (Fully Invested) ซึ่งอาจพิจารณาเลือกใช้กลยุทธ์แบบ Full Replication หรือ Optimization
- กองทุนอาจจะลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) เพื่อลดความเสี่ยง (Hedging) หรือเพื่อเป็นการเพิ่มประสิทธิภาพในการบริหารกองทุน (efficient portfolio management)
- กลยุทธ์การลงทุน มุ่งหวังให้ผลประกอบการเคลื่อนไหวตามดัชนีชี้วัด (Passive Management/Index Tracking)

ระดับความเสี่ยง



เสี่ยงสูง

ลงทุนในตราสารทุนเป็นหลักโดยเฉลี่ยในรอบปีไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน 02 มิถุนายน 2559

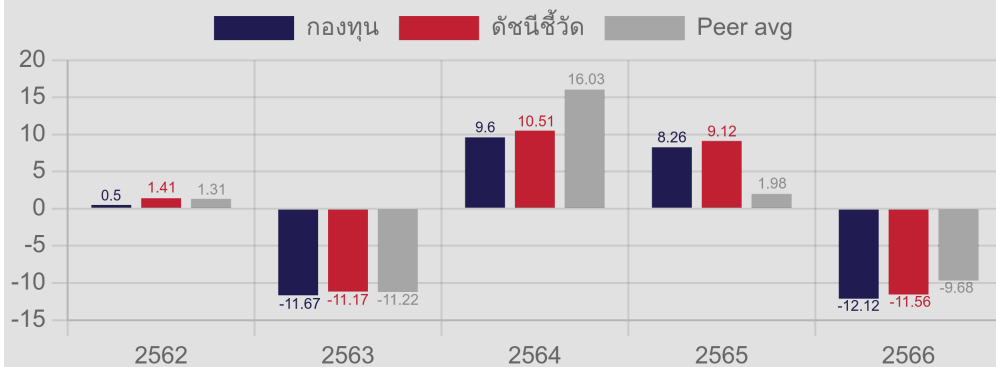
นโยบายการจ่ายเงินปันผล จ่าย

อายุกองทุน ไม่กำหนด

ผู้จัดการกองทุน

นายเมธี เมฆอรุณเรือง (ตั้งแต่วันที่ 20 พ.ย. 2560)

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (% ต่อปี)



ดัชนีชี้วัด

ดัชนี MSCI Thailand ex Foreign Board 100.00%

ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด (% ต่อปี)

	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี
กองทุน	-1.93	-1.93	-4.67	-11.03
ดัชนีชี้วัด	-1.77	-1.77	-4.33	-10.55
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	-2.36	-2.36	-5.22	-8.63
ความผันผวนกองทุน	10.78	10.78	11.99	11.56
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	10.85	10.85	12.05	11.62

	3 ปี	5 ปี	10 ปี	ตั้งแต่จัดตั้ง
กองทุน	-2.02	-2.79	N/A	1.46
ดัชนีชี้วัด	-1.31	-2.07	N/A	2.22
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	-2.16	-2.71	N/A	N/A
ความผันผวนกองทุน	11.66	18.12	N/A	16.18
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	11.71	18.18	N/A	16.22

คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวมมิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต : ได้รับการรับรองจาก CAC
 ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือ บริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่อง ได้ที่หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



www.bcaph.co.th

การซื้อขายหน่วยลงทุน

วันทำการซื้อ/ขายคืน : ทุกวันทำการของตลาดหลักทรัพย์ฯ

- ผู้ร่วมค้ำหน่วยลงทุนสามารถสั่งซื้อ/ขายคืนหน่วยลงทุนได้ที่บริษัทจัดการได้ทุกวันทำการของตลาดหลักทรัพย์ฯ

- ผู้สนใจลงทุนทั่วไปสามารถสั่งซื้อ/ขายคืนหน่วยลงทุนโดยผ่านผู้ร่วมค้ำหน่วยลงทุนด้วยวิธีการส่ง/รับมอบ ตักร้าหลักทรัพย์ ตามขั้นตอนและวิธีการรับซื้อคืนที่ผู้ร่วมค้ำหน่วยลงทุนกำหนด

- ผู้สนใจลงทุนทั่วไปและผู้ร่วมค้ำหน่วยลงทุนสามารถซื้อ/ขายคืนหน่วยลงทุนผ่านตลาดหลักทรัพย์ฯ โดยปฏิบัติตามกฎ ระเบียบ และวิธีปฏิบัติของตลาดหลักทรัพย์ฯ

มูลค่าขั้นต่ำในการซื้อครั้งแรก : เป็นไปตามที่ผู้ร่วมค้ำ **มูลค่าขั้นต่ำในการขายคืน :** ไม่กำหนด

หน่วยลงทุน หรือตลาดหลักทรัพย์ฯกำหนด

ยอดคงเหลือขั้นต่ำ : ไม่กำหนด

มูลค่าขั้นต่ำในการซื้อครั้งถัดไป : เป็นไปตามที่ผู้ร่วม

จำนวนหน่วยลงทุนขั้นต่ำของการขายคืน : สำหรับผู้

ค้ำหน่วยลงทุน หรือตลาดหลักทรัพย์ฯกำหนด

ร่วมค้ำหน่วยลงทุน : 1 หน่วยของการซื้อขาย

จำนวนหน่วยลงทุนขั้นต่ำของการซื้อครั้งถัดไป :

(creation unit : CU) และเพิ่มขึ้นเป็นทวีคูณของ 1

สำหรับผู้ร่วมค้ำหน่วยลงทุน : 1 หน่วยของการซื้อขาย หน่วยของการซื้อขาย

ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน : ภายใน 5 วันทำการ

(creation unit : CU) และเพิ่มขึ้นเป็นทวีคูณของ 1

หน่วยของการซื้อขาย

นับตั้งแต่วันที่ถัดจากวันส่งคำสั่งขายคืนหน่วยลงทุน

โดยบริษัทจัดการจะชำระเป็นตักร้าหลักทรัพย์ตาม

อัตราส่วนและรายละเอียดของหลักทรัพย์ที่บริษัท

จัดการกำหนด

ข้อมูลความเสี่ยงเชิงสถิติ

Maximum drawdown	-42.18 %
Recovering Period	N/A
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน	0.10 เท่า
Sharpe Ratio	-0.25
Alpha	-0.71
Beta	0.99
Tracking Error	0.09 %
Tracking Difference	-0.48 %

การจัดสรรการลงทุนในต่างประเทศ

% NAV

-

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุน (% ต่อปีของ NAV)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	2.00%	0.428%
รวมค่าใช้จ่าย	5.00%	0.68545%

หมายเหตุ

- ค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายข้างต้นได้รวมภาษีมูลค่าเพิ่มและภาษีอื่นใดในตนเองเรียบร้อยแล้ว (ถ้ามี)

- ค่าใช้จ่ายข้างต้นเป็นอัตราตามรอบปีบัญชีปัจจุบัน ทั้งนี้ สามารถศึกษาข้อมูลเพิ่มเติมได้ที่หนังสือชี้ชวนส่วนข้อมูลกองทุนรวม

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วยลงทุน (% ต่อมูลค่าซื้อขาย)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การขาย	1.00%	ปัจจุบันไม่เรียกเก็บ
การรับซื้อคืน	1.00%	ปัจจุบันไม่เรียกเก็บ
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า	ไม่มี	ไม่มี
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก	ไม่มี	ไม่มี
การโอน	ตามที่นายทะเบียนเรียกเก็บ	ปัจจุบันไม่เรียกเก็บ

หมายเหตุ

- ค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายข้างต้นได้รวมภาษีมูลค่าเพิ่มและภาษีอื่นใดในตนเองเรียบร้อยแล้ว (ถ้ามี) ทั้งนี้ สามารถศึกษาข้อมูลเพิ่มเติมได้ที่หนังสือชี้ชวนส่วนข้อมูลกองทุนรวม

การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม

5 อันดับแรก

% NAV

1. พลังงานและสาธารณูปโภค	22.38
2. พาณิชยกรรม	12.79
3. การแพทย์	11.11
4. เทคโนโลยีสารสนเทศและการสื่อสาร	9.73
5. ขนส่งและโลจิสติกส์	9.60

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน

% NAV

- 1. หุ้นสามัญ 99.14
- 2. เงินฝากธนาคาร 0.10

ทรัพย์สินที่ลงทุนสูงสุด 5 อันดับแรก

% NAV

- 1. บริษัท ปตท. จำกัด (มหาชน) (PTT) 8.45
- 2. บริษัท ซีพี ออลล์ จำกัด (มหาชน) (CPALL) 7.96
- 3. บริษัท กรุงเทพดุสิตเวชการ จำกัด(มหาชน) (BDMS) 7.88
- 4. บริษัท ท่าอากาศยานไทย จำกัด (มหาชน) (AOT) 6.96
- 5. บริษัท แอดวานซ์ อินโฟร์ เซอร์วิส จำกัด (มหาชน) (ADVANC) 6.13

อันดับความน่าเชื่อถือของตราสารหนี้ (%)

-

คำอธิบาย

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

Recovering Period ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาตั้งแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้เวลานานเท่าใด

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลานึง 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