

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน เอ็มเอฟซี จำกัด (มหาชน)

กองทุนเปิดเอ็มเอฟซี มิด สมอล แคป หุ้นระยะยาว

MFC Mid Small Cap Long Term Equity Fund

ชนิดหุ้นระยะยาว : MIDSMALLTF

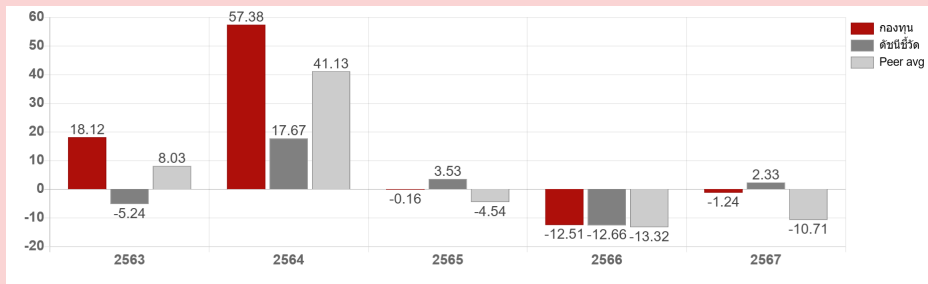
ประเภทกองทุนรวม/กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมตราสารทุน
- กองทุนรวมหุ้นระยะยาว ที่จัดตั้งขึ้นก่อนวันที่ 1 มกราคม พ.ศ. 2563
- กลุ่มกองทุนรวม: Equity Small - Mid Cap

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- ลงทุนในตราสารทุนของบริษัทขนาดกลางและขนาดเล็กที่จดทะเบียนใน SET และ/หรือ MAI ที่มีปัจจัยพื้นฐานดี และมีแนวโน้มการเจริญเติบโตสูงในระยะปานกลางถึงระยะยาว โดยมีอัตราส่วนการลงทุนโดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน
- กองทุนอาจลงทุนใน derivatives เพื่อ Efficient Portfolio Management
- กองทุนมุ่งหวังให้ผลประกอบการสูงกว่าดัชนีชี้วัด (Active Management)

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (%ต่อปี)

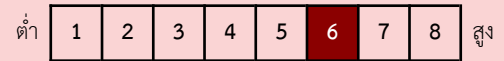


ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด (%ต่อปี)

	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี
กองทุน	-16.49	-5.26	-17.49	-17.14
ดัชนีชี้วัด	-12.49	-6.80	-16.28	-8.95
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	-20.23	-9.48	-24.98	-27.80
ความผันผวนกองทุน	19.61	19.27	18.01	16.64
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	22.08	24.42	19.13	15.70
	3 ปี	5 ปี	10 ปี	ตั้งแต่จัดตั้ง
กองทุน	-12.58	8.46	-	0.96
ดัชนีชี้วัด	-7.39	1.41	-	-1.47
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	-16.43	1.01	-	-
ความผันผวนกองทุน	14.88	16.76	-	16.59
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	12.98	13.71	-	15.66

* ผลตอบแทนที่มีอายุเกินหนึ่งปีจะแสดงเป็นผลตอบแทนต่อปี

ระดับความเสี่ยง



เสี่ยงสูง

ลงทุนในตราสารทุน โดยเฉลี่ยในรอบปีไม่น้อยกว่า 65% ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม :

วันจดทะเบียนกองทุน	24 พ.ย. 2560
วันเริ่มต้น class	24 พ.ย. 2560
นโยบายการจ่ายเงินปันผล	จ่าย
อายุกองทุน	ไม่กำหนด

ผู้จัดการกองทุนรวม :

- นายวิญญู ศรีวิริยานนท์ (ตั้งแต่ 16 พ.ค. 2568)

ดัชนีชี้วัด :

ดัชนีผลตอบแทนรวมตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET TRI) สัดส่วน 100%

คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวม มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต : ได้รับการรับรองจาก CAC

จัดอันดับกองทุน Morningstar : ★★★★★

ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือ

บริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่อง

ได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



www.mfcfund.com

การซื้อขายหน่วยลงทุน	การขายคืนหน่วยลงทุน	
วันทำการซื้อ :	-	วันทำการขายคืน : ทุกวันทำการ
เวลาทำการ :	- น.	เวลาทำการ : 08:30 - 15:30 น.
การซื้อขายครั้งแรกขั้นต่ำ :	1,000 บาท	การขายคืนขั้นต่ำ : ไม่กำหนด
การซื้อขายครั้งถัดไปขั้นต่ำ :	1,000 บาท	ยอดคงเหลือขั้นต่ำ : ไม่กำหนด
		ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน : T+5*

หมายเหตุ :

- บริษัทจัดการจะไม่เปิดเสนอขายหน่วยลงทุนชนิดหุ้นระยะยาวอีก ตั้งแต่วันที่ 1 มกราคม พ.ศ. 2563 เป็นต้นไป
- ระหว่างวันที่ 13 พ.ค. - 30 มิ.ย. 68 บริษัทจัดการจะเปิดรับคำสั่งสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนไปยังกองทุน Thai ESGX โดยทำการสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนด้วยวิธีการชำระราคาด้วยหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินอื่นแทนเงินเท่านั้น ทั้งนี้ บริษัทจัดการจะเปิดรับคำสั่งสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนทุกวันจันทร์ถึงวันศุกร์ ภายในเวลา 15.30 น. และจะทำการสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนทุกวันศุกร์ (Trade date) ซึ่งคำสั่งสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนที่เกิดขึ้นภายหลังจากระยะเวลาดังกล่าว จะถือเป็นรายการสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนในวันศุกร์ถัดไป ทั้งนี้ คำสั่งสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนของกองทุน LTF ภายใต้งานจัดการที่เกิดขึ้นหลังเวลา 15.30 น. ของวันที่ 27 มิ.ย.68 ถึงวันที่ 30 มิ.ย.68 เวลา 15.30 น. บริษัทจัดการจะทำการสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนในวันที่ 30 มิ.ย.68 (Trade date)
- T+5 คือ 5 วันทำการหลังจากวันทำการขายคืน (ปัจจุบัน 3 วันทำการหลังจากวันทำการขายคืน)

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	2.1400	1.6050
รวมค่าใช้จ่าย	5.6710	1.8538

หมายเหตุ :

- ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว
- การรวมค่าใช้จ่ายที่เก็บจริง คิดตามรอบบัญชีของกองทุน

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การขาย	1.00	ไม่มี
การรับซื้อคืน	3.00	ไม่มี
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า	ไม่มี	ดูหมายเหตุเพิ่มเติม
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก	ไม่มี	ดูหมายเหตุเพิ่มเติม
การโอนหน่วย	ไม่มี	ไม่มี

หมายเหตุ :

- ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว
- บริษัทจัดการขอสงวนสิทธิ์ในการคิดค่าธรรมเนียมการขายหน่วยลงทุนกับผู้ซื้อหรือผู้ถือหน่วยลงทุนแต่ละกลุ่มหรือแต่ละคน ไม่เท่ากันได้
- ผู้ถือหน่วยลงทุนจะสับเปลี่ยนเข้าที่ราคาขาย ซึ่งเท่ากับ มูลค่าหน่วยลงทุนที่ใช้เพื่อการคำนวณราคาขาย + ค่าธรรมเนียมการขาย (ถ้ามี)
- ผู้ถือหน่วยลงทุนจะสับเปลี่ยนออกที่ราคาซื้อคืน ซึ่งเท่ากับ มูลค่าหน่วยลงทุนที่ใช้เพื่อการคำนวณราคาซื้อคืน - ค่าธรรมเนียมการรับซื้อคืน (ถ้ามี)
- ผู้ถือหน่วยลงทุนสามารถโอนย้ายหน่วยลงทุนมายังกองทุนรวมหุ้นระยะยาวภายใต้การจัดการของ บลจ. ได้ โดยมีค่าธรรมเนียม เท่ากับ มูลค่าหน่วยลงทุนที่ใช้เพื่อการคำนวณราคาขาย + ค่าธรรมเนียมการขาย (ถ้ามี)
- ผู้ถือหน่วยลงทุนสามารถโอนย้ายหน่วยลงทุนไปยังกองทุนรวมหุ้นระยะยาวภายใต้การจัดการของ บลจ.อื่น ได้ โดยมีค่าธรรมเนียม (คิดจริง) 1.50% ของมูลค่าหน่วยลงทุนของวันทำการล่าสุดก่อนวันทำการโอนย้าย (วัน T-1)
- ผู้ถือหน่วยลงทุนไม่สามารถนำหน่วยลงทุนของกองทุนรวมไปโอนหรือจำหน่ายได้
- บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ

ข้อมูลเชิงสถิติ

Maximum Drawdown	-37.86%
Recovering Period	N/A
Sharpe Ratio	-1.01
Alpha	-5.19%
Beta	0.86
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน	2.31 เท่า

การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม 5 อันดับแรก

กลุ่มอุตสาหกรรม	%NAV
อาหารและเครื่องดื่ม	25.89
ธนาคาร	22.32
เงินทุนและหลักทรัพย์	7.40
เทคโนโลยีสารสนเทศและการสื่อสาร	6.08
พาณิชย์	5.92

ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก

Holding	%NAV
บมจ.ทีเอสโก้ไฟแนนเชียลกรุ๊ป	8.91
บมจ.เอ็นเอสแอล ฟู้ดส์	8.84
บมจ.ทุนธนาชาติ	8.69
บมจ.อิชิตัน กรุ๊ป	6.23
บมจ.เงินติดล้อ	5.81

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน

Breakdown	%NAV
หุ้นสามัญ	87.13
เงินฝากธนาคาร และอื่นๆ	12.87

คำอธิบาย

- **Maximum Drawdown:** เปรอ์เซ็นต์ผลขาดทุนสูงสุดของกองทุนรวมในระยะเวลา 5 ปีย้อนหลัง (หรือตั้งแต่จัดตั้งกองทุนกรณีที่ยังไม่ครบ 5 ปี) โดยวัดจากระดับ NAV ต่อหน่วยที่จุดสูงสุดไปจนถึงจุดต่ำสุดในช่วงที่ NAV ต่อหน่วยปรับตัวลดลง ค่า Maximum Drawdown เป็นข้อมูลที่ช่วยให้ทราบถึงความเสี่ยงที่อาจจะขาดทุน จากการลงทุนในกองทุนรวม
- **Recovering Period:** ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาตั้งแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลานานเท่าใด
- **FX Hedging:** เปรอ์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน
- **อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน:** ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตกองทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลานึง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์กับผลรวมของมูลค่าการขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 1 ปีหารด้วยมูลค่า NAV ของกองทุนรวมเฉลี่ยในรอบระยะเวลาเดียวกัน กองทุนรวมที่มีค่า portfolio turnover สูง บ่งชี้ถึงการซื้อขายหลักทรัพย์บ่อยครั้งของผู้จัดการกองทุนและทำให้มีต้นทุนการซื้อขายหลักทรัพย์ที่สูง 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:** ระดับและทิศทางของการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุน โดยเปรียบเทียบกับอัตราการเปลี่ยนแปลงของตลาด Beta น้อยกว่า 1 แสดงว่าหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนน้อยกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด Beta มากกว่า 1 แสดงว่าหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนมากกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด
- **Tracking Error:** อัตราผลตอบแทนของกองทุนมีประสิทธิภาพในการเลียนแบบดัชนีชี้วัด โดยหาก tracking error ต่ำ หมายถึงกองทุนรวมมีประสิทธิภาพในการสร้างผลตอบแทนให้ใกล้เคียงกับดัชนีชี้วัด กองทุนรวมที่มีค่า tracking error สูง จะมีอัตราผลตอบแทนโดยเฉลี่ยห่างจากดัชนีชี้วัดมากขึ้น
- **Yield to Maturity:** อัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในตราสารหนี้โดยถือจนครบกำหนดอายุ ซึ่งคำนวณจากดอกเบี้ยที่จะได้รับในอนาคตตลอดอายุตราสารและเงินต้นที่จะได้รับคืน นำมาคิดลดเป็นมูลค่าปัจจุบัน โดยใช้วัดอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมตราสารหนี้ คำนวณจากค่าเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักของ Yield to Maturity ของตราสารหนี้แต่ละตัวที่กองทุนมีการลงทุน และเนื่องจาก Yield to Maturity มีหน่วยมาตรฐานเป็นเปอร์เซ็นต์ต่อปี จึงสามารถนำไปใช้เปรียบเทียบอัตราผลตอบแทนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีนโยบายถือครองตราสารหนี้จนครบกำหนดอายุและมีลักษณะการลงทุนที่ใกล้เคียงกันได้

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน เอ็มเอฟซี จำกัด (มหาชน)

เลขที่ 199 อาคารคอลลัมน์ทาวเวอร์ ชั้น จี และชั้น 21-23

ถนนรัชดาภิเษก เขตคลองเตย กรุงเทพฯ 10110

โทรศัพท์: 0-2649-2000 www.mfcfund.com