

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน เอ็มเอฟซี จำกัด (มหาชน)

## กองทุนเปิดเอ็มเอฟซี เซ็ต 50 หุ้นระยะยาว

MFC Set 50 Long Term Equity Fund

ชนิดเพื่อการลงทุน : MS50MF

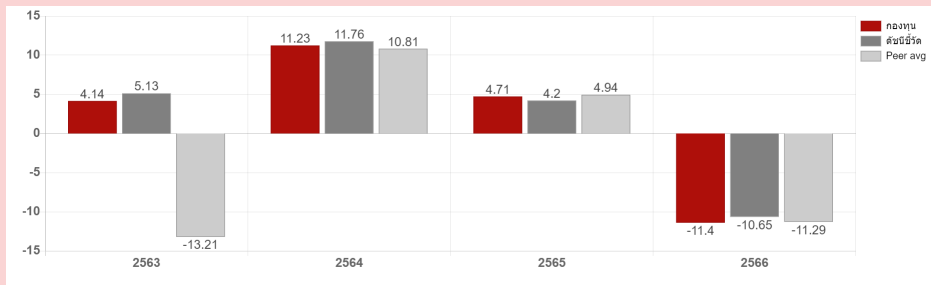
### ประเภทกองทุนรวม/กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมตราสารทุน
- กลุ่มกองทุนรวม: SET 50 Index Fund

### นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- ลงทุนในหุ้นสามัญที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ เพื่อให้สามารถสร้างผลตอบแทนที่ใกล้เคียงกับดัชนี SET 50 โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน
- กองทุนมุ่งหวังให้ผลประกอบการเคลื่อนไหวตามดัชนีชี้วัด (Passive Management / Index Tracking)

### ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (%ต่อปี)



### ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด (%ต่อปี)

	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี
กองทุน	-2.64	2.21	-0.66	-7.18
ดัชนีชี้วัด	-2.41	2.41	-0.22	-6.35
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	-2.61	2.24	-0.52	-6.96
ความผันผวนกองทุน	11.97	12.01	11.71	12.24
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	12.42	12.59	12.06	12.51

	3 ปี	5 ปี	10 ปี	ตั้งแต่จัดตั้ง
กองทุน	-1.92	-	-	1.21
ดัชนีชี้วัด	-1.54	-	-	1.75
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	-1.80	-	-	-
ความผันผวนกองทุน	11.86	-	-	15.26
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	12.03	-	-	15.65

\* ผลตอบแทนที่มีอายุเกินหนึ่งปีจะแสดงเป็นผลตอบแทนต่อปี

### ระดับความเสี่ยง



ลงทุนในตราสารทุน โดยเฉลี่ยในรอบปีไม่น้อยกว่า 65% ของ NAV

### ข้อมูลกองทุนรวม :

วันจดทะเบียนกองทุน	3 พ.ค. 2561
วันเริ่มต้น class	1 ก.ค. 2563
นโยบายการจ่ายเงินปันผล	จ่าย
อายุกองทุน	ไม่กำหนด

### ผู้จัดการกองทุนรวม :

- นายประวีร์ อัจฉิมกุล (ตั้งแต่ 17 ธ.ค. 2562)
- นายรุ่งโรจน์ นิลนพคุณ (ตั้งแต่ 25 ก.ค. 2566)

### ดัชนีชี้วัด :

ดัชนีผลตอบแทนรวม SET50 (SET50 TRI) สัดส่วน 100%

### คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวม มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต : ได้รับการรับรองจาก CAC

จัดอันดับกองทุน Morningstar : ★★★

ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือ

บริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่อง

ได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



www.mfcfund.com

การซื้อขายหน่วยลงทุน		การขายคืนหน่วยลงทุน	
วันทำการซื้อ :	ทุกวันทำการ	วันทำการขายคืน :	ทุกวันทำการ
เวลาทำการ :	08:30 - 15:30 น.	เวลาทำการ :	08:30 - 15:30 น.
การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ :	1,000 บาท	การขายคืนขั้นต่ำ :	ไม่กำหนด
การซื้อครั้งถัดไปขั้นต่ำ :	1,000 บาท	ยอดคงเหลือขั้นต่ำ :	ไม่กำหนด
		ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน :	T+3
			3 วันทำการนับแต่วันรับซื้อคืนหน่วยลงทุน

### ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)<sup>1</sup>

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	2.1400	0.4280
รวมค่าใช้จ่าย <sup>2</sup>	5.6710	0.7456

#### หมายเหตุ :

- ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว
- การรวมค่าใช้จ่ายที่เก็บจริง คิดตามรอบปีบัญชีของกองทุน

### ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)<sup>1</sup>

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การขาย <sup>2</sup>	1.00	ไม่มี
การรับซื้อคืน	3.00	ไม่มี
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า <sup>3</sup>	ไม่มี	ไม่มี
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก <sup>4</sup>	ไม่มี	ไม่มี
การโอนหน่วย	50 บาท/รายการ	50 บาท/รายการ

#### หมายเหตุ :

- ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว
- บริษัทจัดการขอสงวนสิทธิ์ในการคิดค่าธรรมเนียมการขายหน่วยลงทุนกับผู้สั่งซื้อหรือผู้ถือหน่วยลงทุนแต่ละกลุ่มหรือแต่ละคนไม่เท่ากันได้
- ผู้ถือหน่วยลงทุนจะสับเปลี่ยนเข้าที่ราคาขาย ซึ่งเท่ากับ มูลค่าหน่วยลงทุนที่ใช้เพื่อการคำนวณราคาขาย + ค่าธรรมเนียมการขาย (ถ้ามี)
- ผู้ถือหน่วยลงทุนจะสับเปลี่ยนออกที่ราคาซื้อ ซึ่งเท่ากับ มูลค่าหน่วยลงทุนที่ใช้เพื่อการคำนวณราคาซื้อ - ค่าธรรมเนียมการรับซื้อคืน (ถ้ามี)
- ค่าใช้จ่ายในการซื้อขายหลักทรัพย์ 0.10% ของมูลค่าซื้อขาย (เก็บจริง)

### ข้อมูลเชิงสถิติ

Maximum Drawdown	-17.13%
Recovering Period	N/A
Sharpe Ratio	-0.20
Alpha	-0.39%
Beta	0.97
Tracking Error	0.27%
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน	0.08 เท่า

### การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม 5 อันดับแรก

กลุ่มอุตสาหกรรม	%NAV
พลังงาน	24.83
ธนาคาร	12.22
ขนส่ง	10.00
เทคโนโลยีสารสนเทศและการสื่อสาร	9.22
พาณิชย์	8.63

### สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน

Breakdown	%NAV
หุ้นสามัญ	98.56
เงินฝากธนาคาร และอื่นๆ	1.44

### ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก

Holding	%NAV
บมจ.ปตท.	8.29
บมจ.ท่าอากาศยานไทย	8.18
บมจ.เดลินิวส์ อิเล็คโทรนิคส์ (ประเทศไทย)	7.47
บมจ.ปตท.สำรวจและผลิตปิโตรเลียม	5.35
บมจ.แอดวานซ์ อินโฟร์ เซอร์วิส	5.08

## 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 ซึ่งคำนวณจากดอกเบี้ยที่จะได้รับในอนาคตตลอดอายุตราสารและเงินต้นที่จะได้รับคืนนำมาคิดลดเป็นมูลค่าปัจจุบัน 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](http://www.mfcfund.com)