



กองทุนรวมที่มีความเสี่ยงสูงหรือซับซ้อน

หนังสือชี้ชวนส่วนสรุปข้อมูลสำคัญ Factsheet

ข้อมูล ณ วันที่ 13 กุมภาพันธ์ 2566

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน เอ็มเอฟซี จำกัด (มหาชน)

IPO วันที่ 15 – 23 กุมภาพันธ์ 2566

กองทุนเปิดเอ็มเอฟซี Complex Structured Return 1YC ห้ามขายผู้ลงทุนรายย่อย

MFC Complex Structured Return 1YC Not for Retail Investors

MSHARC1YC

ประเภทกองทุนรวม/กลุ่มกองทุนรวม

- ประเภทกองทุน : กองทุนรวมผสม กองทุนที่ลงทุนแบบมีความเสี่ยงทั้งในและต่างประเทศ
- กลุ่มกองทุนรวม : Miscellaneous

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- กองทุนจะลงทุนในตราสารหนี้และ/หรือเงินฝากทั้งในและ/หรือต่างประเทศที่มีอันดับความน่าเชื่อถืออยู่ในอันดับที่สามารถลงทุนได้ (Investment Grade) ประมาณร้อยละ 98.48 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน โดยมีเป้าหมายเพื่อให้เงินลงทุนเติบโตเป็นร้อยละ 100 ของเงินลงทุนทั้งหมดเมื่อครบอายุโครงการ โดยมีการป้องกันความเสี่ยงด้านอัตราแลกเปลี่ยน (Hedging) สำหรับการลงทุนในตราสารหนี้ และหรือเงินฝากต่างประเทศทั้งจำนวน
- ลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) ประเภทสัญญาออพชั่น (Option) หรือวอร์แรนต์ (Warrant) ที่มีการจ่ายผลตอบแทนอ้างอิงกับกองทุน iShares MSCI ACWI ETF (ACWI) ตามเงื่อนไขการจ่ายผลตอบแทนเพื่อเปิดโอกาสให้กองทุนสามารถแสวงหาผลตอบแทนส่วนเพิ่มจากการเปลี่ยนแปลงของกองทุน iShares MSCI ACWI ETF (ACWI) โดยจะลงทุนประมาณร้อยละ 1.52 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน ทั้งนี้จะไม่ป้องกันความเสี่ยงด้านอัตราแลกเปลี่ยนสำหรับการลงทุนในสัญญาออพชั่นหรือวอร์แรนต์
- อาจลงทุนในตราสารที่มีสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแฝง (Structured Note) รวมทั้งอาจลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเพื่อการเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน (Efficient Portfolio Management)
- กองทุนมีกลยุทธ์การลงทุนครั้งเดียว (buy-and-hold)

ผลการดำเนินงานย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (%ต่อปี)

-

ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด (%ต่อปี)

-

ระดับความเสี่ยง

ต่ำ	1	2	3	4	5	6	7	8	สูง
-----	---	---	---	---	---	---	---	---	-----

เสี่ยงปานกลางค่อนข้างสูง

ลงทุนในตราสารหนี้ ตราสารหนี้ และ/หรือทรัพย์สินทางเลือก โดยมีสัดส่วนการลงทุนในตราสารหนี้ต่ำกว่า 80% ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน	ภายใน 2 วันทำการหลังจากวันสุดท้ายของการ IPO
นโยบายการจ่ายเงินปันผล	ไม่จ่าย
อายุกองทุน	ประมาณ 1 ปี โดยไม่ต่ำกว่า 11 เดือน และไม่เกิน 1 ปี 1 เดือน

ผู้จัดการกองทุนรวม

- คุณธนัย ลิขิตชัยสกุล - เริ่มบริหารจัดการตั้งแต่วันที่จดทะเบียนกองทุน
- คุณพิพัฒน์ นรานันท์ - เริ่มบริหารจัดการตั้งแต่วันที่จดทะเบียนกองทุน

ดัชนีชี้วัด :

- ไม่มี เนื่องจากกองทุนไม่สามารถวัดผลการดำเนินงานได้ เพราะอัตราผลตอบแทนของกองทุนขึ้นอยู่กับเงื่อนไขการจ่ายผลตอบแทนของสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ซึ่งเป็นลักษณะเฉพาะเจาะจงที่สร้างขึ้นสำหรับกองทุนนี้โดยเฉพาะ

คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวม มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต : ได้รับการรับรองจาก CAC

ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือ

บริหารความเสี่ยงด้านสภาพ

คล่องได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



www.mfcfund.com

การซื้อหน่วยลงทุน

การขายคืนหน่วยลงทุน

วันทำการซื้อ:	ระหว่างวันที่ 15 – 23 ก.พ. 66	วันทำการขายคืน:	รับซื้อคืนหน่วยลงทุน เมื่อครบอายุโครงการ
เวลาทำการ:	08:30 – 15:30 น.	เวลาทำการ:	-
การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ:	500,000 บาท	การขายคืนขั้นต่ำ:	ไม่กำหนด
การซื้อครั้งถัดไปขั้นต่ำ:	ไม่กำหนด	ยอดคงเหลือขั้นต่ำ:	ไม่กำหนด
		ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน:	T+5 คือ 5 วันทำการนับแต่วันรับซื้อคืนหน่วยลงทุน

หมายเหตุ:

เมื่อครบกำหนดอายุโครงการ บริษัทจัดการจะจัดให้มีการดำเนินการรับซื้อคืนหน่วยลงทุนโดยอัตโนมัติทั้งหมดภายใน 2 วันทำการก่อนวันครบกำหนดอายุโครงการ และจะชำระเงินค่าขายคืนหน่วยลงทุนให้แก่ผู้ถือหน่วยลงทุนภายใน 5 วันทำการนับตั้งแต่วันที่ถัดจากวันทำการขายคืนหน่วยลงทุนโดยอัตโนมัติ โดยการนำเงินเข้าบัญชีเงินฝากประเภทออมทรัพย์หรือประเภทกระแสรายวันของผู้ถือหน่วยลงทุน ณ ธนาคารที่บริษัทจัดการกำหนดหรือเป็นเช็คขีดคร่อมเฉพาะสั่งจ่ายผู้ถือหน่วยลงทุน ตามที่ผู้ถือหน่วยลงทุนได้แจ้งความประสงค์ไว้

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของมูลค่าจดทะเบียนกองทุนรวม)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	2.14	0.50
รวมค่าใช้จ่าย	2.889	0.55

หมายเหตุ:

- ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่มหรือภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว
- ค่าธรรมเนียมการจัดการกองทุน ในอัตราไม่เกินร้อยละ 2.14 ต่อปีของมูลค่าเงินลงทุนจดทะเบียนกองทุนรวม ทั้งนี้ ในกรณีที่อัตราผลตอบแทนที่กองทุนได้รับหลังหักค่าใช้จ่ายสูงกว่าอัตราผลตอบแทนเฉลี่ยต่อปีที่จะรับซื้อคืนอัตโนมัติ บริษัทจัดการขอสงวนสิทธิ์ที่จะคิดค่าธรรมเนียมการจัดการเพิ่มเติมจากที่ได้ประมาณการไว้ โดยจะไม่เกินอัตราค่าธรรมเนียมการจัดการรายปีข้างต้นทั้งนี้บริษัทจัดการจะแจ้งอัตราที่เรียกเก็บจริงให้ผู้ถือหน่วยทราบอีกครั้งหลังจากมีการลงทุนจริงบนเว็บไซต์

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การขาย	1.00	0.75
การรับซื้อคืน	ไม่มี	ไม่มี
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า	ไม่มี	ไม่มี
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก	ไม่มี	ไม่มี
การโอนหน่วย	ตามที่นายทะเบียนเรียกเก็บ	ตามที่นายทะเบียนเรียกเก็บ

หมายเหตุ:

- ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว
- บริษัทจัดการขอสงวนสิทธิ์ในการคิดค่าธรรมเนียมการขายกับผู้ซื้อหรือผู้ถือหน่วยลงทุนแต่ละกลุ่มหรือแต่ละคนไม่เท่ากันได้

ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก*

Holding	% NAV
หุ้นกู้ : ธนาคารทีเอสโก้ จำกัด (มหาชน)	18.71
หุ้นกู้ : บริษัทควอลิตี้เฮาส์ จำกัด (มหาชน)	18.71
หุ้นกู้ : บริษัท เซ็นทรัลพัฒนา จำกัด (มหาชน)	12.80
หุ้นกู้ : บริษัท โสม โปรดักส์ เซ็นเตอร์ จำกัด (มหาชน)	11.82
หุ้นกู้ : บริษัท ศุภาลัย จำกัด (มหาชน)	9.85

*ข้อมูลดังกล่าวเป็นการคาดการณ์การลงทุน ซึ่งอาจเปลี่ยนแปลงได้

ข้อมูลเชิงสถิติ

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

การจัดสรรการลงทุนในต่างประเทศ*

ประเทศ	% NAV
ไทย	98.48
สหรัฐอเมริกา	1.52

การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม*

กลุ่มอุตสาหกรรม	% NAV
อสังหาริมทรัพย์และก่อสร้าง	49.73
ธุรกิจการเงิน	30.04
บริการ	11.82
ทรัพยากร	6.89

การจัดสรรการลงทุนตามอันดับความน่าเชื่อถือ (%)*

	ในประเทศ		International
	National	International	
GOV bond/AAA	-	-	-
AA	24.62	-	-
A	52.19	-	-
BBB	21.67	-	-

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน*

Holding	% NAV
หุ้นกู้เอกชน	98.48
สัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Warrant)	1.52

รายละเอียดการลงทุน :

ส่วนที่ 1 : กองทุนจะลงทุนในตราสารหนี้และ/หรือเงินฝากทั้งในและ/หรือต่างประเทศ ที่มีอันดับความน่าเชื่อถืออยู่ในอันดับที่สามารถลงทุนได้ (Investment Grade) ประมาณร้อยละ 98.48 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน โดยมีเป้าหมายเพื่อให้เงินลงทุนเติบโตเป็นร้อยละ 100 ของเงินลงทุนทั้งหมด

ประมาณการตราสารและสัดส่วนที่คาดว่าจะลงทุนในส่วนของตราสารหนี้และ/หรือเงินฝาก

ตราสารที่ลงทุน*	อันดับความน่าเชื่อถือของผู้ออกตราสาร	สัดส่วนการลงทุนโดยประมาณ	ผลตอบแทนของตราสารในรูปของเงินบาทโดยประมาณ (ต่อปี)	เงินต้นและผลตอบแทน (ต่อปี) ที่คาดว่าจะได้รับ
หุ้นกู้ : บริษัท เซ็นทรัลพัฒนา จำกัด (มหาชน)	TRIS : AA	12.80%	1.75%	13.02%
หุ้นกู้ : บริษัท โฮม โปรดักส์ เซ็นเตอร์ จำกัด (มหาชน)	TRIS : AA-	11.82%	1.85%	12.04%
หุ้นกู้ : บริษัท เอเชีย พลัส กรุ๊ป โฮลดิ้งส์ จำกัด (มหาชน)	TRIS : A	4.93%	2.20%	5.04%
หุ้นกู้ : บริษัท ศุภาลัย จำกัด (มหาชน)	TRIS : A	9.85%	2.20%	10.06%
หุ้นกู้ : ธนาคารทีเอสโก้ จำกัด (มหาชน)	TRIS : A	18.71%	1.90%	19.07%
หุ้นกู้ : บริษัทควอลิตี้เฮาส์ จำกัด (มหาชน)	TRIS : A-	18.71%	2.15%	19.11%
หุ้นกู้ : บริษัท พีทีจี เอ็นเนอยี จำกัด (มหาชน)	TRIS : BBB+	6.89%	3.00%	7.10%
หุ้นกู้ : บริษัท เอสซี แอสเสท คอร์ปอเรชั่น จำกัด (มหาชน)	TRIS : BBB+	8.37%	2.25%	8.56%
หุ้นกู้ : บริษัท ศรีสวัสดิ์ คอร์ปอเรชั่น จำกัด (มหาชน)	TRIS : BBB+	3.94%	2.30%	4.03%
หุ้นกู้ : บริษัท เมืองไทย แคปปิตอล จำกัด (มหาชน)	TRIS : BBB+	2.46%	2.30%	2.52%
รวม		98.48 %		100.55%
หักค่าใช้จ่ายโดยประมาณ				0.55%
เงินต้นและผลตอบแทนจากการลงทุนใน ส่วนที่ 1 หลังจากหักค่าใช้จ่ายของกองทุนโดยประมาณ				100%

*บริษัทจัดการจะใช้ดุลยพินิจในการเปลี่ยนแปลงทรัพย์สินที่ลงทุนหรือสัดส่วนการลงทุนได้ต่อเมื่อเป็นการดำเนินการภายใต้สถานการณ์ที่จำเป็นและสมควรเพื่อรักษาผลประโยชน์ของผู้ลงทุนเป็นสำคัญ โดยไม่ทำให้ความเสี่ยงของทรัพย์สินที่ลงทุนเปลี่ยนแปลงไปอย่างมีนัยสำคัญ โดยบริษัทอาจพิจารณาการลงทุนในตราสารหนี้อื่นแทน และ/หรือเพิ่มเติมจากตราสารที่ระบุไว้ข้างต้น ซึ่งตราสารดังกล่าวจะอยู่ภายใต้กรอบการลงทุนของบริษัทจัดการ โดยประมาณการอัตราผลตอบแทนของตราสารที่ลงทุนอาจมีการเปลี่ยนแปลงได้ ทั้งนี้ การเปลี่ยนแปลงดังกล่าวอาจทำให้ผู้ถือหน่วยลงทุนไม่ได้รับผลตอบแทนตามอัตราที่ประมาณการไว้ อย่างไรก็ตาม ในกรณีที่มีการเปลี่ยนแปลงสัดส่วนการลงทุนของเงินลงทุนในส่วนที่ 1 จะส่งผลให้เงินลงทุนในส่วนที่ 2 เปลี่ยนแปลงไปด้วย

ส่วนที่ 2 : เงินลงทุนที่เหลือประมาณร้อยละ 1.52 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน จะลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) ประเภทสัญญาออปชั่น (Option) หรือวอร์แรนท์ (Warrant) ที่มีการจ่ายผลตอบแทนอ้างอิงกับค่าการเปลี่ยนแปลงของกองทุน iShares MSCI ACWI ETF (ACWI)

รายละเอียดและเงื่อนไขของสัญญาออปชั่นหรือวอร์แรนท์ที่กองทุนลงทุน

สินทรัพย์อ้างอิง	iShares MSCI ACWI ETF (ACWI)
สกุลเงิน	สกุลเงินดอลลาร์สหรัฐ (USD)
อายุตราสาร	ประมาณ 1 ปี (วันเริ่มต้นสัญญา ถึง วันพิจารณาสินทรัพย์อ้างอิง)
วันเริ่มต้นสัญญา	วันที่กองทุนเริ่มลงทุนในสัญญาออปชั่นหรือวอร์แรนท์
วันพิจารณาสินทรัพย์อ้างอิง	วันสุดท้ายที่ประเมินระดับของสินทรัพย์อ้างอิงตามสัญญา หากตรงกับวันหยุดจะใช้วันทำการถัดไปแทน (ภายในระยะเวลาไม่เกิน 30 วันก่อนวันครบอายุโครงการ)
อัตราส่วนร่วม (Participation Rate: PR)	40% (อัตราการมีส่วนร่วมในผลตอบแทน ที่กำหนดโดยคู่สัญญาหรือผู้ออกตราสาร)
อัตราผลตอบแทนชดเชย (Rebate Rate)	0.25% (อัตราผลตอบแทนชดเชยที่จะได้รับเมื่อค่าการเปลี่ยนแปลงของกองทุนอ้างอิง ณ วันทำการใด เพิ่มขึ้นมากกว่า (ค่า Barrier) โดยเริ่มตั้งแต่วันที่ทำการถัดจากวันเริ่มต้นสัญญาถึงวันพิจารณาสินทรัพย์อ้างอิง)
Barrier level	15% (กรอบสูงสุดของค่าการเปลี่ยนแปลงของกองทุนอ้างอิงที่คาดการณ์ไว้ (การเพิ่มขึ้นมากกว่าร้อยละ 15 เมื่อเทียบกับค่าการเปลี่ยนแปลงของกองทุนอ้างอิง ณ วันเริ่มต้นสัญญา))
ขนาดสัญญาออปชั่นหรือวอร์แรนท์	ประมาณร้อยละ 100 ของจำนวนเงินที่ได้รับจากการเสนอขายหน่วยลงทุน โดยขนาดสัญญาออปชั่นหรือวอร์แรนท์จะถูกแปลงเป็นสกุลเงินดอลลาร์สหรัฐ ณ วันที่ลงทุน ดังนั้น ผลตอบแทนจากการลงทุนในสัญญาออปชั่นหรือวอร์แรนท์ในสกุลเงินบาทจึงขึ้นอยู่กับอัตราแลกเปลี่ยน ณ วันที่คำนวณผลตอบแทน กองทุนจึงมีความเสี่ยงที่จะได้รับผลตอบแทนสูงหรือต่ำกว่าที่ระบุไว้ได้
ข้อมูลสำคัญเกี่ยวกับสินทรัพย์อ้างอิง	iShares MSCI ACWI ETF (ACWI) มีวัตถุประสงค์เพื่อมุ่งสร้างผลตอบแทนก่อนหักค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายให้ใกล้เคียงกับผลตอบแทนของดัชนี MSCI ACWI (USD) ซึ่งมีวิธีการคำนวณดัชนีจากมูลค่าหลักทรัพย์ตามราคาตลาดที่มีการปรับค่าการกระจายหุ้นรายย่อย (Free float-adjusted market capitalization index) โดยสะท้อนผลการดำเนินงานของตลาดหุ้นทั้งในกลุ่มประเทศที่พัฒนาแล้ว (Developed Markets) รวมถึงประเทศในกลุ่มตลาดเกิดใหม่ (Emerging Markets) ซึ่งดัชนีอ้างอิงดังกล่าวอาจประกอบด้วยตราสารทุนที่มีมูลค่าตามราคาตลาดสูงและปานกลาง (Large and mid-capitalization) โดย iShares MSCI ACWI ETF (ACWI) บริหารจัดการโดย BlackRock Fund Advisors ซึ่งไม่ได้มีความเกี่ยวข้องกับบริษัทจัดการ จึงทำหน้าที่ได้อย่างอิสระจากบริษัทจัดการ ผู้ถือหน่วยลงทุนสามารถเข้าถึงข้อมูล iShares MSCI ACWI ETF (ACWI) เพื่อศึกษาข้อมูลเพิ่มเติมได้ที่ https://www.ishares.com/us/products/239600/ishares-msci-acwi-etf
เหตุการณ์ที่ส่งผลกระทบต่อการลงทุน	กองทุนสงวนสิทธิ์ปรับเงื่อนไขการจ่ายผลตอบแทนหากเกิดเหตุการณ์ใดเหตุการณ์หนึ่ง โดยผู้แทนการคำนวณมูลค่ายุติธรรมของสัญญาออปชั่นหรือวอร์แรนท์ (Calculation agent) จะคำนวณการจ่ายผลตอบแทนจากเหตุการณ์ที่เกิดขึ้นจริง ซึ่งผู้จัดการกองทุนจะพิจารณาร่วมกับผู้แทนการคำนวณ โดยยึดถือผลประโยชน์ของผู้ถือหน่วยลงทุนเป็นสำคัญ เหตุการณ์ดังกล่าวมีดังนี้ 1) การยกเลิกสินทรัพย์อ้างอิงที่กองทุนใช้อ้างอิง

	<p>2) ผู้ประกาศสินทรัพย์อ้างอิงไม่สามารถคำนวณหรือไม่สามารถประกาศราคาสินทรัพย์อ้างอิงอย่างเป็นทางการได้</p> <p>3) การเปลี่ยนแปลงวิธีการคำนวณสินทรัพย์อ้างอิง</p> <p>4) การเปลี่ยนแปลงกฎหมายหรือข้อบังคับที่ส่งผลกระทบต่อสินทรัพย์อ้างอิงหรือสัญญาออพชั่นหรือวอร์แรนท์</p> <p>5) คู่สัญญาออพชั่นหรือวอร์แรนท์ที่มีการจ่ายผลตอบแทนอ้างอิงกับระดับของสินทรัพย์อ้างอิง มีต้นทุนในการป้องกันความเสี่ยงเพิ่มขึ้น เช่น จากการเพิ่มขึ้นของอัตราการเสียภาษีอากร ค่าใช้จ่าย และค่าธรรมเนียมต่างๆ</p> <p>ทั้งนี้ เป็นไปตามเงื่อนไขที่ระบุในหนังสือชี้ชวนของธนาคารผู้ค้า</p>
ผู้ออกสัญญาออพชั่นหรือวอร์แรนท์	ธนาคารพาณิชย์และหรือสถาบันการเงินที่มีอันดับความน่าเชื่อถือไม่ต่ำกว่าอันดับที่สามารถลงทุนได้ (Investment Grade)

บริษัทจัดการขอสงวนสิทธิเปลี่ยนแปลงอัตราส่วนร่วมและหรืออัตราผลตอบแทนชดเชยและหรือค่า Barrier เมื่อมีความจำเป็นและสมควร เพื่อรักษาผลประโยชน์ของผู้ลงทุนหรือเพื่อเพิ่มผลตอบแทนโดยรวมให้กับผู้ลงทุน โดยจะแจ้งให้ผู้ลงทุนทราบในหนังสือชี้ชวนส่วนสรุปข้อมูลสำคัญ และส่วนข้อมูลกองทุนรวมก่อนการเสนอขายหน่วยลงทุน

หากสถานะตลาดมีการเปลี่ยนแปลงหรือเป็นไปตามดุลยพินิจของผู้จัดการกองทุน ส่งผลให้อัตราส่วนร่วมและหรืออัตราผลตอบแทนชดเชยและหรือค่า Barrier ณ วันที่ลงทุนมากกว่าที่ระบุไว้ในหนังสือชี้ชวนส่วนสรุปข้อมูลสำคัญ บริษัทจัดการขอสงวนสิทธิปรับอัตราส่วนร่วมและหรืออัตราผลตอบแทนชดเชยและหรือค่า Barrier เพิ่มขึ้น

เงื่อนไขการจ่ายเงินต้นและผลตอบแทนของกองทุน ณ วันครบอายุโครงการ

	เงื่อนไข	ผลตอบแทน ณ วันครบกำหนดอายุโครงการ
กรณีที่ 1	ค่าการเปลี่ยนแปลงของสินทรัพย์อ้างอิง ณ วันพิจารณาสินทรัพย์อ้างอิง $\leq 0\%$	ได้รับเงินต้นคืนเต็มจำนวนเพียงอย่างเดียว ไม่ได้รับผลตอบแทนจากการลงทุนในสัญญาออพชั่นหรือวอร์แรนท์
กรณีที่ 2	1) ค่าการเปลี่ยนแปลงของสินทรัพย์อ้างอิง ณ วันทำการวันใดวันหนึ่งตลอดอายุสัญญาออพชั่น ปรับเพิ่มขึ้นมากกว่า $+15\%$ เมื่อเทียบกับระดับสินทรัพย์อ้างอิง ณ วันเริ่มต้นสัญญา หรือ 2) ค่าการเปลี่ยนแปลงของสินทรัพย์อ้างอิง ณ วันพิจารณาสินทรัพย์อ้างอิง ปรับเพิ่มขึ้นมากกว่า $+15\%$ เมื่อเทียบกับระดับสินทรัพย์อ้างอิง ณ วันเริ่มต้นสัญญา	ได้รับเงินต้นคืนเต็มจำนวน + ผลตอบแทนชดเชยจากสัญญาออพชั่นหรือวอร์แรนท์ ผลตอบแทนชดเชยจากสัญญาออพชั่นหรือวอร์แรนท์ = (Rebate Rate x เงินต้น) x ค่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราแลกเปลี่ยน
กรณีที่ 3	ค่าการเปลี่ยนแปลงของสินทรัพย์อ้างอิง ณ วันพิจารณาสินทรัพย์อ้างอิง $> 0\%$ แต่ $\leq 15\%$ ของระดับสินทรัพย์อ้างอิง ณ วันเริ่มต้นสัญญา	ได้รับเงินต้นคืนเต็มจำนวน + ผลตอบแทนจากการลงทุนในสัญญาออพชั่นหรือวอร์แรนท์ = (PR x ค่าการเปลี่ยนแปลงของสินทรัพย์อ้างอิง x เงินต้น) x ค่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราแลกเปลี่ยน

ในการพิจารณาว่าเข้าเงื่อนไขการได้รับผลตอบแทนตามกรณีใด กองทุนจะพิจารณาค่าการเปลี่ยนแปลงของสินทรัพย์อ้างอิงทุกสิ้นวันทำการ

ในกรณีที่เกิดเหตุการณ์ใดๆ ซึ่งอาจมีผลกระทบต่อเงื่อนไขและการคำนวณผลตอบแทนจากการลงทุนใน สัญญาออพชั่นหรือวอร์เรนธ์ เช่น คู่สัญญาที่มีการยกเลิกสัญญาอันเนื่องมาจากภาวะตลาดมีการผันผวนอย่างรุนแรงจนไม่สามารถออกสัญญาออพชั่นหรือวอร์เรนธ์ที่กองทุนภายใต้เงื่อนไขเดิมได้ กองทุนจึงต้องเปลี่ยนคู่สัญญาใหม่ เป็นต้น การคำนวณผลตอบแทนดังกล่าวจะเป็นไปตามข้อตกลงที่ระบุไว้ในสัญญาออพชั่นหรือวอร์เรนธ์ที่กองทุนลงทุน ซึ่งบริษัทจัดการจะแจ้งเงื่อนไขดังกล่าวให้แก่ผู้ถือหน่วยลงทุนทราบภายใน 15 วัน นับตั้งแต่วันที่เกิดเหตุการณ์นั้นๆ ขึ้น โดยจะแจ้งผ่านเว็บไซต์ของบริษัทจัดการ

เงื่อนไขของสัญญาออพชั่นหรือวอร์เรนธ์จะเป็นไปตามสัญญาที่กองทุนได้ทำการตกลงร่วมกันกับทางธนาคารคู่ค้า ทั้งนี้ หากเกิดเหตุการณ์ที่เกี่ยวข้องกับสินทรัพย์อ้างอิงและ/หรือ บริษัทผู้ให้บริการสินทรัพย์อ้างอิงอย่างมีนัยสำคัญ เช่น หลักการการคำนวณราคามีการเปลี่ยนแปลง สินทรัพย์อ้างอิงถูกยกเลิกและ/หรือ บริษัทผู้ให้บริการสินทรัพย์อ้างอิงปิดกิจการ เป็นต้น ซึ่งอาจเป็นเหตุให้สัญญาออพชั่นมีอันต้องสิ้นสภาพก่อนกำหนด ธนาคารคู่ค้าจะทำการคำนวณราคาสัญญาออพชั่นเพื่อใช้ในการยกเลิกสัญญาก่อนกำหนด

ธนาคารคู่ค้าในฐานะนายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ และเป็นผู้กำหนดราคาในตลาดรองโดยคำนึงถึงภาวะตลาด และไม่รับรองว่าจะมีการซื้อขายหลักทรัพย์ในราคาดังกล่าว ทั้งนี้ ธนาคารคู่ค้าอาจระงับหรือยุติการจัดทำราคาโดยไม่ต้องแจ้งให้ทราบล่วงหน้า

ธนาคารคู่ค้าและบริษัทในเครืออาจมีบทบาทต่าง ๆ ที่เกี่ยวข้องกับ Warrant ซึ่งอาจมีความขัดแย้งทางผลประโยชน์ที่เกิดขึ้นจากบทบาทที่ดำเนินการเกี่ยวกับ Warrant

ธนาคารคู่ค้าขอสงวนสิทธิ์ในการเปลี่ยนแปลงหรือยุติการแต่งตั้งตัวแทนการคำนวณ (Calculation Agent) โดยมีเงื่อนไขว่าจะมีตัวแทนการคำนวณตลอดเวลา ทั้งนี้การยุติดังกล่าวจะแจ้งให้กับกองทุนทราบตามที่ระบุไว้ โดยตัวแทนการคำนวณอาจมอบหมายภาระหน้าที่และหน้าที่ใด ๆ ของตนให้กับบุคคลที่สามตามที่เห็นสมควร

อาจมีเหตุการณ์ที่กระทบต่อตลาดหลักทรัพย์ (Market Disruption Event) ที่เกี่ยวข้องกับหน่วย ETF ในตลาดหลักทรัพย์ที่มีการซื้อขายหน่วย ETF หรือในสัญญาซื้อขายล่วงหน้าหรือสัญญาออพชั่นที่เกี่ยวข้องกับหน่วย ETF ในตลาดหลักทรัพย์ที่เกี่ยวข้อง หรือเหตุการณ์ใดๆ ที่ตัวแทนการคำนวณพิจารณาว่ากระทบต่อตลาดหรือมูลค่าการซื้อขายของหลักทรัพย์ หรือเกิดเหตุการณ์ที่ทำให้ตลาดหลักทรัพย์สำหรับ ETF ดังกล่าว ไม่สามารถเปิดทำการซื้อขายได้ตามปกติหรือเหตุการณ์ที่ส่งผลกระทบต่อทำให้ไม่สามารถคำนวณราคาปิดของหลักทรัพย์ ทั้งนี้ เป็นไปตามเงื่อนไขที่ระบุในหนังสือชี้ชวนของธนาคารคู่ค้า

หากเหตุการณ์ Adjustment Events เกิดขึ้น เช่น ETF อาจถูกเพิกถอนจากตลาด การเปลี่ยนแปลงลักษณะโครงสร้างของกองทุน ETF การเปลี่ยนแปลงทางกฎหมาย เป็นต้น ธนาคารคู่ค้าอาจใช้ดุลยพินิจในการกำหนดให้ตัวแทนการคำนวณ (Calculation Agent) ทำการปรับเปลี่ยนดังกล่าว ตามเงื่อนไขของ Warrant ตามที่เห็นว่าจำเป็นหรือเหมาะสม หรือ ธนาคารคู่ค้าอาจยกเลิก warrant โดยตัวแทนการคำนวณจะต้องแจ้งให้ธนาคารคู่ค้าทราบโดยเร็วเมื่อเกิดเหตุการณ์ Adjustment Events ทั้งนี้ เป็นไปตามเงื่อนไขที่ระบุในหนังสือชี้ชวนของธนาคารคู่ค้า

ทั้งนี้ ในบางสถานการณ์สัญญาออพชั่นหรือวอร์เรนธ์อาจถูกไถ่ถอนก่อนกำหนด เช่น ความไม่ชอบด้วยกฎหมาย และเหตุผลเกี่ยวกับภาษี นอกจากนี้ อาจมีการยกเลิกและไถ่ถอนสัญญาออพชั่นหรือวอร์เรนธ์ก่อนกำหนดในกรณีอื่น ๆ ตามที่ตัวแทนการคำนวณ (Calculation Agent) กำหนด หรือตามที่ระบุไว้เป็นอย่างอื่นตามข้อกำหนดของสัญญา ตามที่ธนาคารคู่ค้าระบุไว้ในหนังสือชี้ชวน

ตัวอย่างการคำนวณผลตอบแทน

สมมติฐาน:

- เงินลงทุนทั้งหมด 1,000,000 บาท
- อัตราส่วนร่วม (Participation Rate : PR) จากการลงทุนในสัญญาออพชั่นหรือวอร์เรนธ์ คือ ร้อยละ 40
- อัตราผลตอบแทนชดเชย (Rebate Rate) จากการลงทุนในสัญญาออพชั่นหรือวอร์เรนธ์ คือ ร้อยละ 0.25

ประเภทหลักทรัพย์	สัดส่วนการลงทุน	อัตราผลตอบแทน ณ วันครบอายุกองทุน	เงินต้นและผลตอบแทน (ต่อปี) ที่คาดว่าจะได้รับ
ส่วนที่ 1: ตราสารหนี้และ/หรือเงินฝากทั้งในและ/หรือต่างประเทศ	98.48%	ประมาณ 2.10%	100.55%

หัก ค่าใช้จ่ายโดยประมาณ*			0.55%
เงินต้นและผลตอบแทนจากการลงทุนใน ส่วนที่ 1 หลังจากหักค่าใช้จ่ายของกองทุนโดยประมาณ			100%
ส่วนที่ 2 : สัญญาออพชั่นหรือวอร์แรนท์	1.52%	ตัวอย่างผลตอบแทนจากสัญญาออพชั่นปรากฏตามตาราง ด้านล่าง	

* ค่าใช้จ่ายของกองทุน (รวมค่าธรรมเนียมการจัดการ) สามารถเปลี่ยนแปลงตามความเหมาะสม ในกรณีที่กองทุนได้รับผลตอบแทนสูงกว่าที่ได้เปิดเผยไว้ตอน
เสนอขายหน่วยลงทุน บริษัทจัดการอาจเรียกเก็บค่าธรรมเนียมการจัดการเพิ่มเติมได้ โดยรวมแล้วไม่เกินร้อยละ 2.14 ต่อปีของจำนวนเงินที่ได้รับจากการ
เสนอขายหน่วยลงทุน

** กองทุนอาจไม่ได้รับเงินต้นและผลตอบแทนตามที่คาดหมายไว้ หากผู้ออกตราสารหรือธนาคารที่กองทุนลงทุนไม่สามารถชำระคืนเงินต้น ดอกเบี้ย รวมทั้ง
ผลตอบแทนอื่นใดตามที่ตกลงกันได้

*** ค่าอัตราส่วนร่วมเป็นตัวเลขสมมติ เพื่อให้ผู้ถือหน่วยลงทุนมีความเข้าใจในสินค้าหรือตัวแปรเท่านั้น

- อัตราส่วนร่วม (Participation Rate : PR) จากการลงทุนในสัญญาออพชั่นหรือวอร์แรนท์ คือ ร้อยละ 40

- อัตราผลตอบแทนขดเซย (Rebate Rate) จากการลงทุนในสัญญาออพชั่นหรือวอร์แรนท์ คือ ร้อยละ 0.25

- ระดับของสินทรัพย์อ้างอิง ACWI ตามตารางดังนี้

กรณี	ระดับสินทรัพย์ อ้างอิง ณ วันเริ่มต้น สัญญา	ระดับสินทรัพย์อ้างอิง สูงสุดในระหว่างอายุสัญญา	ระดับสินทรัพย์อ้างอิง ณ วันพิจารณาสินทรัพย์อ้างอิง
1	80	≤ 92 (เพิ่มขึ้นไม่เกิน 15% จากวันเริ่มต้นสัญญา)	น้อยกว่า 80 (ลดลง ≤ 0% จากวันเริ่มต้นสัญญา)
2	80	> 92 (เพิ่มขึ้นมากกว่า 15% จากวันเริ่มต้นสัญญา)	ไม่นำมาพิจารณา
3	80	อยู่ในช่วง 80 - 92 (ลดลงไม่เกิน 0% หรือเพิ่มขึ้นไม่เกิน 15% จากวันเริ่มต้น สัญญา)	92 (เพิ่มขึ้น 15% จากวันเริ่มต้นสัญญา)

* ค่าอัตราส่วนร่วมเป็นตัวเลขสมมติ เพื่อให้ผู้ถือหน่วยลงทุนมีความเข้าใจในสินค้าหรือตัวแปรเท่านั้น

ตัวอย่างผลตอบแทนที่คาดว่าจะได้รับจากการลงทุนในแต่ละกรณี (ภายใต้สมมติฐานว่าอัตราแลกเปลี่ยนไม่มีการเปลี่ยนแปลง)

กรณี	เงื่อนไข	เงินต้น (บาท) (1)	ผลตอบแทนขดเซย/ผลตอบแทน จากสัญญาออพชั่นหรือวอร์แรนท์ (บาท) (2)	รวมเงินต้นและผลตอบแทน ทั้งหมดเมื่อครบอายุ โครงการ* (บาท) (1)+(2)
1	ค่าการเปลี่ยนแปลงของสินทรัพย์อ้างอิง ณ วันพิจารณาสินทรัพย์อ้างอิง ≤ 0%	1,000,000	ไม่ได้รับผลตอบแทนจากการลงทุน ในสัญญาวอร์แรนท์	1,000,000

2	1) ค่าการเปลี่ยนแปลงของสินทรัพย์อ้างอิง ณ วันทำการวันใดวันหนึ่งตลอดอายุสัญญา ออปชั่น ปรับเพิ่มขึ้นมากกว่า +15% เมื่อเทียบกับระดับสินทรัพย์อ้างอิง ณ วันเริ่มต้นสัญญา หรือ 2) ค่าการเปลี่ยนแปลงของสินทรัพย์อ้างอิง ณ วันพิจารณาสินทรัพย์อ้างอิง ปรับเพิ่มขึ้นมากกว่า +15% เมื่อเทียบกับระดับสินทรัพย์อ้างอิง ณ วันเริ่มต้นสัญญา	1,000,000	ได้รับผลตอบแทน จากการลงทุนในสัญญา วอร์เรนธ์ 2,500 บาท $0.25\% \times 1,000,000 = 2,500$	1,002,500 (หรือคิดเป็น 0.25%)
3	ค่าการเปลี่ยนแปลงของสินทรัพย์อ้างอิง ณ วันพิจารณาสินทรัพย์อ้างอิง > 0% แต่ ≤ 15% ของระดับสินทรัพย์อ้างอิง ณ วัน เริ่มต้นสัญญา	1,000,000	ได้รับผลตอบแทน จากการลงทุนใน สัญญาวอร์เรนธ์ 60,000 บาท $40\% \times [92/80] - 1 \times 1,000,000 = 60,000$	1,060,000 (หรือคิดเป็น 6.00%)

หมายเหตุ: ตัวเลขเงินต้นและผลตอบแทนเป็นเพียงตัวอย่างการคำนวณเพื่อประกอบการอธิบายเท่านั้น มิได้เป็นการรับประกันว่าผู้ลงทุนจะได้รับผลตอบแทนตามที่แสดงไว้

* จำนวนเงินการจ่ายเงินต้นและผลตอบแทนเป็นจำนวนเงินหลังหักค่าใช้จ่ายแล้ว

** ค่าอัตราส่วนร่วมเป็นตัวเลขสมมติ เพื่อให้ผู้ถือหน่วยลงทุนมีความเข้าใจในสินค้าหรือตัวแปรเท่านั้น

ตัวอย่างผลตอบแทนที่คาดว่าจะได้รับจากการลงทุนในแต่ละกรณี (กรณีอัตราแลกเปลี่ยนมีการเปลี่ยนแปลง)

สมมติฐานการเปลี่ยนแปลงของอัตราแลกเปลี่ยนค่าเงินบาทเมื่อเทียบกับดอลลาร์สหรัฐ (USD)

1.1 กรณีที่ค่าเงินบาทแข็งค่าขึ้นเมื่อเทียบกับค่าเงินดอลลาร์สหรัฐ

1.2 กรณีที่ค่าเงินบาทอ่อนค่าลงเมื่อเทียบกับค่าเงินดอลลาร์สหรัฐ

	1.1 กรณีที่ค่าเงินบาทแข็งค่าขึ้นเมื่อเทียบกับค่าเงินดอลลาร์สหรัฐ	1.2 กรณีที่ค่าเงินบาทอ่อนค่าลงเมื่อเทียบกับค่าเงินดอลลาร์สหรัฐ
อัตราแลกเปลี่ยนค่าเงินบาทเมื่อเทียบกับดอลลาร์สหรัฐ (USD) ณ วันเริ่มต้นสัญญา	35 บาท ต่อ 1 ดอลลาร์	35 บาท ต่อ 1 ดอลลาร์
อัตราแลกเปลี่ยนค่าเงินบาทเมื่อเทียบกับดอลลาร์สหรัฐ (USD) ณ วันพิจารณาสินทรัพย์อ้างอิง	30 บาท ต่อ 1 ดอลลาร์	40 บาท ต่อ 1 ดอลลาร์

ณ วันที่ลงทุน ขนาดสัญญา 1,000,000 บาท

การเปลี่ยนแปลงของอัตราแลกเปลี่ยนค่าเงินบาทเมื่อเทียบกับดอลลาร์สหรัฐ	เงินต้น (บาท)	ผลตอบแทนชดเชย/ ผลตอบแทนจากสัญญาออปชั่นหรือวอร์เรนธ์ (บาท)	รวมเงินต้นและผลตอบแทนทั้งหมดที่คาดว่าจะได้รับเมื่อครบอายุโครงการ*
1.1 ค่าเงินบาทแข็งค่าขึ้นเมื่อเทียบกับดอลลาร์สหรัฐ จาก	1,000,000 บาท	กรณีที่ 1 ไม่ได้รับผลตอบแทนจากการลงทุนใน	1,000,000 บาท

35 บาท ต่อ 1 ดอลลาร์ เป็น 30 บาท ต่อ 1 ดอลลาร์	1,000,000 บาท	สัญญาออร์เรนจ์ กรณีที่ 2 ได้รับผลตอบแทนชดเชย 2,150 บาท คำนวณจาก 1. ค่าการเปลี่ยนแปลงของอัตรา แลกเปลี่ยน $30/35=0.86$ 2. ผลตอบแทนชดเชย $(0.25\% \times 1,000,000 \text{ บาท}) \times 0.86$ $= 2,150 \text{ บาท}$	$1,000,000 + 2,150$ $= 1,002,150 \text{ บาท}$ (คิดเป็น 0.215% ต่อปี)
1.2 ค่าเงินบาทอ่อนค่าลงเมื่อ เทียบกับดอลลาร์สหรัฐ จาก 35 บาท ต่อ 1 ดอลลาร์ เป็น 40 บาท ต่อ 1 ดอลลาร์	1,000,000 บาท	กรณีที่ 3 ได้รับผลตอบแทน จากการลงทุนในสัญญา ออปชั่นหรือออร์เรนจ์ 51,600 บาท คำนวณจาก 1. ค่าการเปลี่ยนแปลงของอัตรา แลกเปลี่ยน $30/35=0.86$ 2. ค่าการเปลี่ยนแปลงของสินทรัพย์อ้างอิง $ (92/80) - 1 = 0.15$ 3. ผลตอบแทน ผลตอบแทนจากสัญญา = $PR \times \text{ค่าการเปลี่ยนแปลงของสินทรัพย์อ้างอิง} \times \text{เงินต้น}$ $(40\% \times 0.15 \times 1,000,000) \times 0.86$ $= 51,600 \text{ บาท}$	$1,000,000 + 51,600$ $= 1,051,600 \text{ บาท}$ (คิดเป็น 5.16% ต่อปี)
	1,000,000 บาท	กรณีที่ 1 ไม่ได้รับผลตอบแทนจากการลงทุนใน สัญญาออร์เรนจ์	1,000,000 บาท
	1,000,000 บาท	กรณีที่ 2 ได้รับผลตอบแทนชดเชย 2,850 บาท คำนวณจาก 1. ค่าการเปลี่ยนแปลงของอัตรา แลกเปลี่ยน $40/35=1.14$ 2. ผลตอบแทนชดเชย $(0.25\% \times 1,000,000 \text{ บาท}) \times 1.14$ $= 2,850 \text{ บาท}$	$1,000,000 + 2,850$ $= 1,002,850 \text{ บาท}$ (คิดเป็น 0.285% ต่อปี)

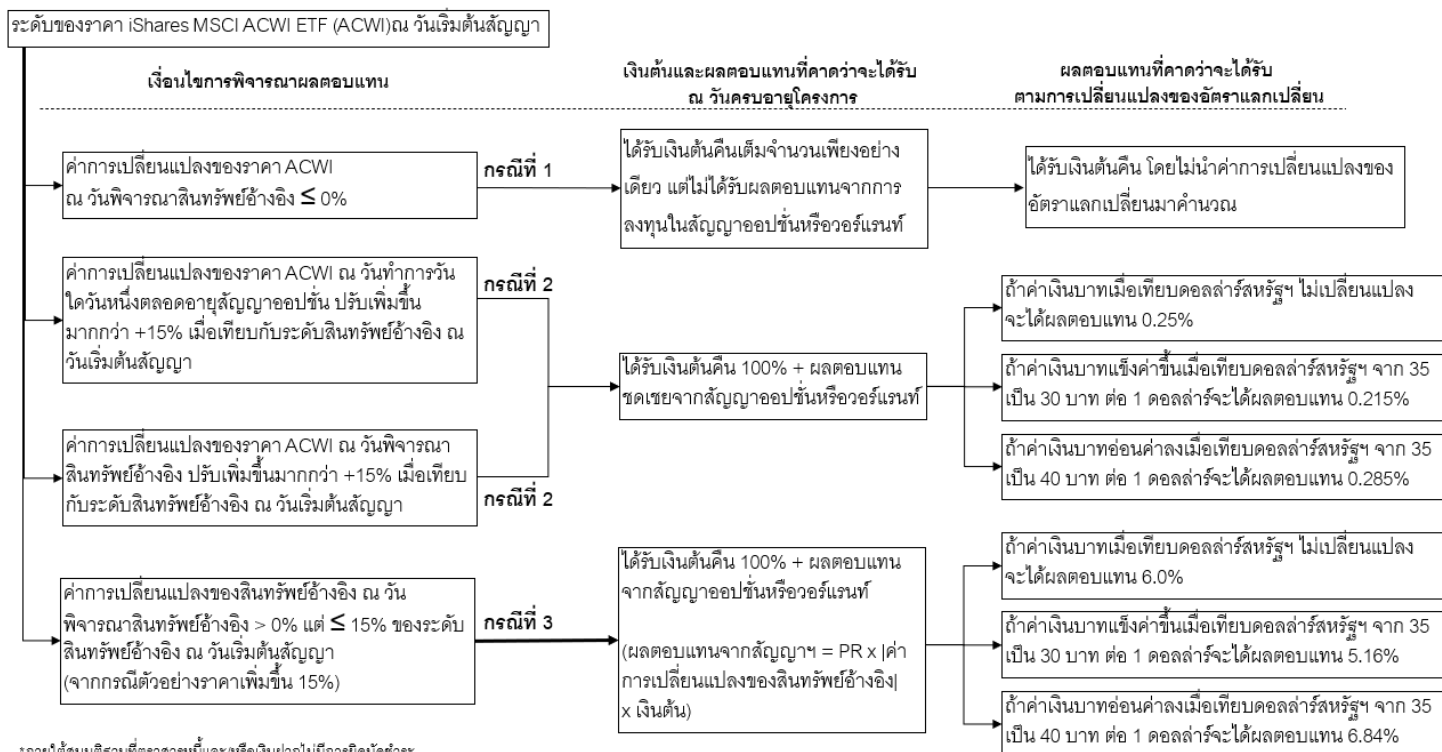
	1,000,000 บาท	<p>กรณีที่ 3</p> <p>ได้รับผลตอบแทน จากการลงทุนในสัญญา ออปชั่นหรือวอร์แรนท์</p> <p>68,400 บาท</p> <p>คำนวณจาก</p> <ol style="list-style-type: none"> ค่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราแลกเปลี่ยน 40/35 = 1.14 ค่าการเปลี่ยนแปลงของสินทรัพย์อ้างอิง $(92/80) - 1 = 0.15$ ผลตอบแทน <p>ผลตอบแทนจากสัญญาฯ = PR x ค่าการเปลี่ยนแปลงของสินทรัพย์อ้างอิง x เงินต้น</p> <p>$(40\% \times 0.15 \times 1,000,000) \times 1.14$</p> <p>= 68,400 บาท</p>	<p>1,000,000 + 68,400</p> <p>= 1,068,400 บาท</p> <p>(คิดเป็น 6.84% ต่อปี)</p>
--	---------------	---	---

หมายเหตุ: ตัวเลขเงินต้นและผลตอบแทนเป็นเพียงตัวอย่างการคำนวณเพื่อประกอบการอธิบายเท่านั้น มิได้เป็นการรับประกันว่าผู้ลงทุนจะได้รับผลตอบแทนตามที่แสดงไว้

* จำนวนเงินการจ่ายเงินต้นและผลตอบแทนเป็นจำนวนเงินหลังหักค่าใช้จ่ายแล้ว

** ค่าอัตราส่วนร่วมเป็นตัวเลขสมมติ เพื่อให้ผู้ถือหน่วยลงทุนมีความเข้าใจในสินค้าหรือตัวแปรเท่านั้น

ตัวอย่างแผนภาพของรูปแบบการจ่ายเงินต้นและผลตอบแทน



ข้อมูลสำคัญเกี่ยวกับสินทรัพย์อ้างอิง

iShares MSCI ACWI ETF (ACWI) มีวัตถุประสงค์เพื่อมุ่งสร้างผลตอบแทนก่อนหักค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายให้ใกล้เคียงกับผลตอบแทนของดัชนี MSCI ACWI (USD) ซึ่งมีวิธีการคำนวณดัชนีจากมูลค่าหลักทรัพย์ตามราคาตลาดที่มีการปรับค่าการกระจายหุ้นรายย่อย (Free float-adjusted market capitalization index) โดยสะท้อนผลการดำเนินงานของตลาดหุ้นทั้งในกลุ่มประเทศที่พัฒนาแล้ว (Developed Markets) รวมถึงประเทศในกลุ่มตลาดเกิดใหม่ (Emerging Markets) ซึ่งดัชนีอ้างอิงดังกล่าวอาจประกอบด้วยตราสารทุนที่มีมูลค่าตามราคาตลาดสูงและปานกลาง (Large and mid-capitalization) โดย iShares MSCI ACWI ETF (ACWI) บริหารจัดการโดย BlackRock Fund Advisors ซึ่งไม่ได้มีความเกี่ยวข้องกับบริษัทจัดการ จึงทำหน้าที่ได้อย่างอิสระจากบริษัทจัดการ ผู้ถือหน่วยลงทุนสามารถเข้าถึงข้อมูล iShares MSCI ACWI ETF (ACWI) เพื่อศึกษาข้อมูลเพิ่มเติมได้ที่ <https://www.ishares.com/us/products/239600/ishares-msci-acwi-etf>

กราฟแสดงการเปลี่ยนแปลงของ iShares MSCI ACWI ETF (ACWI) ในช่วงระยะเวลา 5 ปีย้อนหลัง



ค่า Standard Deviation = 17.45 (ณ วันที่ 20 ธ.ค. 65)

* ที่มา: Bloomberg ข้อมูลย้อนหลัง 5 ปี ตั้งแต่ปี 2018 - 2022

** ความผันผวนของราคาหรือผลการดำเนินงานของสินค้าหรือตัวแปรที่สัญญาหรือตราสารอ้างอิง เป็นเพียงข้อมูลในอดีตหรือข้อมูลจำลองที่จัดทำขึ้นเพื่อให้ผู้ถือหน่วยลงทุนมีความเข้าใจในสินค้าหรือตัวแปรเท่านั้น ดังนั้น ราคา ผลการดำเนินงาน หรือความผันผวนของสินค้าหรือ ตัวแปรในอนาคตอาจเคลื่อนไหวในทิศทางที่ไม่เป็นไปตามข้อมูลในอดีตได้

คำอธิบาย

- **Maximum Drawdown** เปรอ์เซ็นต์ผลขาดทุนสูงสุดของกองทุนรวมในระยะเวลา 5 ปีย้อนหลัง (หรือตั้งแต่จัดตั้งกองทุนกรณีที่ยังไม่ครบ 5 ปี) โดยวัดจากระดับ NAV ต่อหน่วยที่จุดสูงสุดไปจนถึงจุดต่ำสุดในช่วงที่ NAV ต่อหน่วยปรับตัวลดลง ค่า Maximum Drawdown เป็นข้อมูลที่ช่วยให้ทราบถึงความเสี่ยงที่อาจจะขาดทุน จากการลงทุนในกองทุนรวม
- **Recovering Period** ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาตั้งแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลาเท่าใด
- **FX Hedging** เปรอ์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน
- **อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน** ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตกองทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลานึง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์กับผลรวมของมูลค่าการขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 1 ปีหารด้วยมูลค่า NAV ของกองทุนรวมเฉลี่ยในรอบระยะเวลาเดียวกัน กองทุนรวมที่มีค่า portfolio turnover สูง บ่งชี้ถึงการซื้อขายหลักทรัพย์บ่อยครั้งของผู้จัดการกองทุนและทำให้มีต้นทุนการซื้อขายหลักทรัพย์ที่สูง จึงต้องพิจารณาเปรียบเทียบกับผลการดำเนินงานของกองทุนรวมเพื่อประเมินความคุ้มค่าของการซื้อขายหลักทรัพย์ดังกล่าว
- **Yield to Maturity** อัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในตราสารหนี้โดยถือจนครบกำหนดอายุ ซึ่งคำนวณจากดอกเบี้ยที่ได้รับในอนาคตตลอดอายุตราสารและเงินต้นที่จะได้รับคืนนำมาคิดลดเป็นมูลค่าปัจจุบัน โดยใช้ตัวอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมตราสารหนี้ คำนวณจากค่าเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักของ Yield to Maturity ของตราสารหนี้แต่ละตัวที่กองทุนมีการลงทุน และเนื่องจาก Yield to Maturity มีหน่วยมาตรฐานเป็นเปอร์เซ็นต์ต่อปี จึงสามารถนำไปใช้เปรียบเทียบอัตราผลตอบแทนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีนโยบายถือครองตราสารหนี้จนครบกำหนดอายุและมีลักษณะการลงทุนที่ใกล้เคียงกันได้

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน เอ็มเอฟซี จำกัด (มหาชน)

เลขที่ 199 อาคารคอคลัมน์ทาวเวอร์ ชั้น จี และชั้น 21-23

ถนนรัชดาภิเษก เขตคลองเตย กรุงเทพฯ 10110

โทรศัพท์: 0-2649-2000 www.mfcfund.com

แบบลงนามรับทราบความเสี่ยง

MSHARC1YC

ข้าพเจ้าได้รับทราบและมีความเข้าใจเกี่ยวกับเงื่อนไขการจ่ายผลตอบแทนของกองทุนเป็นอย่างดีแล้วว่า กองทุนจะลงทุนดังนี้

ส่วนที่ 1 : กองทุนจะลงทุนในตราสารหนี้และ/หรือเงินฝาก ทั้งในและหรือต่างประเทศ ที่มีอันดับความน่าเชื่อถืออยู่ในอันดับที่สามารถลงทุนได้ (Investment Grade) ประมาณร้อยละ 98.00 - 99.00 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน โดยมีเป้าหมายเพื่อให้เงินลงทุนเติบโตเป็นร้อยละ 100 ของเงินลงทุนทั้งหมด

ส่วนที่ 2 : เงินลงทุนที่เหลือประมาณร้อยละ 1.00 - 2.00 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน จะลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) ประเภทสัญญาออปชั่น (Option) หรือวอร์แรนท์ (Warrant) ที่มีการจ่ายผลตอบแทนอ้างอิงกับค่าการเปลี่ยนแปลงของกองทุน iShares MSCI ACWI ETF (ACWI)

เงื่อนไขการจ่ายเงินต้นและผลตอบแทนของกองทุน ณ วันครบอายุโครงการ

	เงื่อนไข	ผลตอบแทน ณ วันครบกำหนดอายุโครงการ
กรณีที่ 1	ค่าการเปลี่ยนแปลงของสินทรัพย์อ้างอิง ณ วันพิจารณาสินทรัพย์อ้างอิง $\leq 0\%$	ได้รับเงินต้นคืนเต็มจำนวนเพียงอย่างเดียว ไม่ได้รับผลตอบแทนจากการลงทุนในสัญญาออปชั่นหรือวอร์แรนท์
กรณีที่ 2	1) ค่าการเปลี่ยนแปลงของสินทรัพย์อ้างอิง ณ วันทำการวันใดวันหนึ่งตลอดอายุสัญญาออปชั่น ปรับเพิ่มขึ้นมากกว่า $+15\%$ เมื่อเทียบกับระดับสินทรัพย์อ้างอิง ณ วันเริ่มต้นสัญญา หรือ 2) ค่าการเปลี่ยนแปลงของสินทรัพย์อ้างอิง ณ วันพิจารณาสินทรัพย์อ้างอิง ปรับเพิ่มขึ้นมากกว่า $+15\%$ เมื่อเทียบกับระดับสินทรัพย์อ้างอิง ณ วันเริ่มต้นสัญญา	ได้รับเงินต้นคืนเต็มจำนวน + ผลตอบแทนชดเชยจากสัญญาออปชั่นหรือวอร์แรนท์ ผลตอบแทนชดเชยจากสัญญาออปชั่นหรือวอร์แรนท์ = $(\text{Rebate Rate} \times \text{เงินต้น}) \times \text{ค่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราแลกเปลี่ยน}$
กรณีที่ 3	ค่าการเปลี่ยนแปลงของสินทรัพย์อ้างอิง ณ วันพิจารณาสินทรัพย์อ้างอิง $> 0\%$ แต่ $\leq 15\%$ ของระดับสินทรัพย์อ้างอิง ณ วันเริ่มต้นสัญญา	ได้รับเงินต้นคืนเต็มจำนวน + ผลตอบแทนจากการลงทุนในสัญญาออปชั่นหรือวอร์แรนท์ $= (\text{PR} \times \text{ค่าการเปลี่ยนแปลงของสินทรัพย์อ้างอิง} \times \text{เงินต้น}) \times \text{ค่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราแลกเปลี่ยน}$

ในการพิจารณาว่าเข้าเงื่อนไขการได้รับผลตอบแทนตามกรณีใด กองทุนจะพิจารณาค่าการเปลี่ยนแปลงของสินทรัพย์อ้างอิงทุกสิ้นวันทำการ กองทุนรวมนี้มีอายุโครงการประมาณ 1 ปี ผู้ถือหน่วยลงทุนจะต้องถือจนครบอายุโครงการจึงจะสามารถไถ่ถอนหน่วยลงทุนได้

ข้าพเจ้าตกลงยินยอมที่จะผูกพันตนเองตามข้อกำหนดและเงื่อนไขที่ปรากฏในหนังสือชี้ชวนของบริษัทจัดการทุกประการ

ข้าพเจ้าชื่อ เลขประจำตัวประชาชน / ทะเบียนนิติบุคคลเลขที่
 ขอยืนยันต่อบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน เอ็มเอฟซี จำกัด (มหาชน) ("บริษัทจัดการ") ว่าข้าพเจ้าเป็นผู้ลงทุนประเภทดังต่อไปนี้ (โปรดเลือกเพียงข้อเดียวเท่านั้น)

- ผู้มีเงินลงทุนสูง (โดยข้าพเจ้ามีการลงทุนในหน่วยลงทุนครั้งแรกตั้งแต่ 500,000 บาทขึ้นไป)
- ผู้ลงทุนสถาบัน ตามประกาศของคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยการกำหนดบทนิยามผู้ลงทุนสถาบันและผู้ลงทุนรายใหญ่
- ผู้ลงทุนรายใหญ่ แยกออกเป็น 2 กรณี ดังนี้
 - ข้าพเจ้าเป็นนิติบุคคล ข้าพเจ้ามีลักษณะดังนี้ ตามงบการเงินปีล่าสุดที่ผู้สอบบัญชีตรวจสอบแล้ว (โปรดเลือก และแนบเอกสารหลักฐานประกอบ)
 - มีส่วนของผู้ถือหุ้นตั้งแต่ 75 ล้านบาทขึ้นไป หรือ
 - มีเงินลงทุนโดยตรงในหลักทรัพย์หรือสัญญาซื้อขายล่วงหน้าตั้งแต่ 15 ล้านบาทขึ้นไป (ไม่นับรวมเงินฝาก)
 - ข้าพเจ้าเป็นบุคคลธรรมดา (นับรวมคู่สมรส) ข้าพเจ้ามีลักษณะดังนี้ (โปรดเลือก และแนบเอกสารหลักฐานประกอบ)
 - มีสินทรัพย์สุทธิตั้งแต่ 30 ล้านบาทขึ้นไป โดยไม่นับรวมมูลค่าอสังหาริมทรัพย์ที่ใช้เป็นที่พักอาศัยประจำ หรือ
 - มีรายได้ต่อปีตั้งแต่ 3 ล้านบาทขึ้นไป หรือ
 - มีเงินลงทุนในหลักทรัพย์หรือสัญญาซื้อขายล่วงหน้าตั้งแต่ 8 ล้านบาทขึ้นไป (ไม่นับรวมเงินฝาก)

นอกจากนี้ ข้าพเจ้าขอให้คำรับรองต่อบริษัทจัดการว่า ข้าพเจ้าได้รับและได้ศึกษาหนังสือชี้ชวน ข้อมูลของกองทุน และเอกสารอื่นใดที่ใช้ในการเสนอขายหน่วยลงทุนที่บริษัทจัดการได้จัดทำขึ้น รวมทั้งข้าพเจ้าได้รับทราบค่าเตือนและการเปิดเผยในเรื่องต่างๆ (เช่น ความเสี่ยงที่สำคัญของกองทุน เป็นต้น) เป็นอย่างดีแล้ว

สำหรับเจ้าหน้าที่
 ผู้ดูแลบัญชีลูกค้าได้ตรวจสอบความถูกต้องแล้ว
 ชื่อตัวแทน
 สาขา รหัสตัวแทน

ลงชื่อผู้ลงทุน
 (.....)
 วันที่