

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน เอ็มเอฟซี จำกัด (มหาชน)

## กองทุนเปิดเอ็มเอฟซีสปอต 33 ซีรีส์ 11

MFC SPOT 33 Series 11 Fund

SPOT33S11

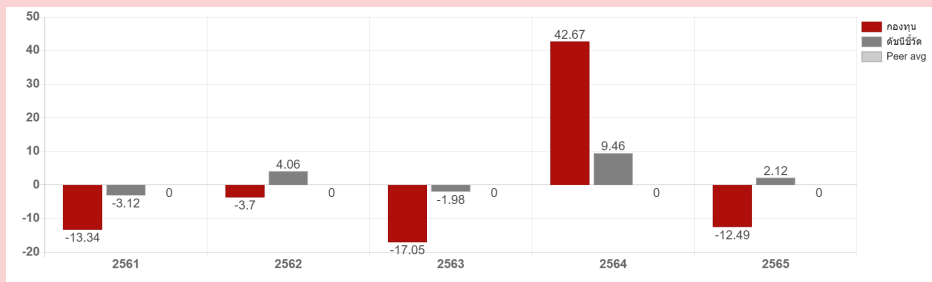
### ประเภทกองทุนรวม/กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมผสม
- กลุ่มกองทุนรวม: Miscellaneous

### นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- ลงทุนในตราสารทุนที่มีปัจจัยพื้นฐานดี ตราสารหนี้ที่ออกโดยสถาบันการเงินที่มีความมั่นคงสูง และได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถืออยู่ในระดับที่สามารถลงทุนได้ (Investment grade) ตราสารกึ่งหนี้กึ่งทุน ตราสารอนุพันธ์ โดยลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้าใน SET50 Index Futures และเงินฝาก
- กองทุนอาจลงทุนใน Derivatives เพื่อ Efficient Portfolio Management
- กองทุนมุ่งหวังให้ผลประกอบการสูงกว่าดัชนีชี้วัด (active management)

### ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (%ต่อปี)

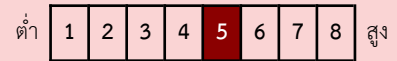


### ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด (%ต่อปี)

|                          | YTD   | 3 เดือน | 6 เดือน | 1 ปี           |
|--------------------------|-------|---------|---------|----------------|
| กองทุน                   | 6.83  | 7.54    | 8.43    | -11.58         |
| ดัชนีชี้วัด              | 0.15  | 2.67    | 4.19    | 2.57           |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน | -     | -       | -       | -              |
| ความผันผวนกองทุน         | 9.42  | 9.66    | 11.51   | 15.09          |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด    | 3.82  | 4.05    | 4.60    | 5.60           |
|                          | 3 ปี  | 5 ปี    | 10 ปี   | ตั้งแต่จัดตั้ง |
| กองทุน                   | 4.05  | -1.87   | -       | -1.56          |
| ดัชนีชี้วัด              | 3.78  | 1.55    | -       | 3.44           |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน | -     | -       | -       | -              |
| ความผันผวนกองทุน         | 19.18 | 16.25   | -       | 15.70          |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด    | 9.79  | 8.35    | -       | 7.80           |

\* ผลตอบแทนที่มีอายุเกินหนึ่งปีจะแสดงเป็นผลตอบแทนต่อปี

### ระดับความเสี่ยง



เสี่ยงปานกลาง ค่อนข้างสูง

ลงทุนในตราสารทุน ตราสารหนี้ และ/หรือทรัพย์สินทางเลือก โดยมีสัดส่วนการลงทุนในตราสารทุนน้อยกว่า 80% ของ NAV

### ข้อมูลกองทุนรวม :

วันจดทะเบียนกองทุน 27 มี.ค. 2556

นโยบายการจ่ายเงินปันผล ไม่จ่าย

อายุกองทุน ไม่กำหนด

### ผู้จัดการกองทุนรวม :

- นายวิรัช ธรรมสุจริต (ตั้งแต่ 1 ก.ย. 2563)
- นายรินทร์ จันทรเนตร (ตั้งแต่ 17 ก.ค. 2561)

### ดัชนีชี้วัด :

1. ดัชนีผลตอบแทนรวมตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET TRI) สัดส่วน 50%
2. ผลตอบแทนรวมสุทธิของดัชนีตราสารหนี้ภาคเอกชน Mark-to-Market ที่มีอันดับความน่าเชื่อถือของผู้ออกตราสารอยู่ในระดับ BBB ขึ้นไป ของสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย สัดส่วน 25%
3. อัตราดอกเบี้ยเงินฝากประจำ 1 ปี วงเงินน้อยกว่า 5 ล้านบาท เฉลี่ยของ 3 ธนาคารพาณิชย์ขนาดใหญ่ (ธนาคารกรุงเทพ ธนาคารกสิกรไทย ธนาคารไทยพาณิชย์) หลังหักภาษี สัดส่วน 25%

### คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวม มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต : ได้รับการรับรองจาก CAC จัดอันดับกองทุน Morningstar :

ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือบริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่องได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



www.mfcfund.com

| การซื้อขายหน่วยลงทุน       |                  | การขายคืนหน่วยลงทุน           |                                |
|----------------------------|------------------|-------------------------------|--------------------------------|
| วันทำการซื้อ :             | ทุกวันทำการ      | วันทำการขายคืน :              | ทุกวันทำการ                    |
| เวลาทำการ :                | 08:30 - 15:30 น. | เวลาทำการ :                   | 08:30 - 13:00 น.               |
| การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ :   | 10,000 บาท       | การขายคืนขั้นต่ำ :            | ไม่กำหนด                       |
| การซื้อครั้งถัดไปขั้นต่ำ : | 1,000 บาท        | ยอดคงเหลือขั้นต่ำ :           | ไม่กำหนด                       |
|                            |                  | ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน : | T+3                            |
|                            |                  |                               | 3 วันทำการนับจากวันทำการขายคืน |

## หมายเหตุ :

- เมื่อมูลค่าหน่วยลงทุนตั้งแต่ 10.65 บาท ขึ้นไป เป็นเวลา 5 วันทำการติดต่อกัน บริษัทจัดการจะดำเนินการรับซื้อคืนหน่วยลงทุนแบบอัตโนมัติ (Auto Redemption) ให้แก่ผู้ถือหน่วยลงทุน โดยมูลค่าหน่วยลงทุนที่คืนให้ผู้ถือหน่วยลงทุนต้องไม่ต่ำกว่าร้อยละ 106 ของมูลค่าที่ตราไว้ (10 บาท) ทั้งนี้ จะนำเงินของผู้ถือหน่วยลงทุนไปลงทุนต่อยังกองทุนเปิดเอ็มเอฟซี พันธบัตรตลาดเงิน ชนิดเพื่อการลงทุน

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

| ค่าธรรมเนียม               | สูงสุดไม่เกิน | เก็บจริง |
|----------------------------|---------------|----------|
| การจัดการ                  | 2.1400        | 1.6050   |
| รวมค่าใช้จ่าย <sup>2</sup> | 5.6389        | 1.8708   |

## หมายเหตุ :

- ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว
- การรวมค่าใช้จ่ายที่เก็บจริง คิดตามรอบปีบัญชีของกองทุน

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

| ค่าธรรมเนียม                             | สูงสุดไม่เกิน | เก็บจริง      |
|--|---------------|---------------|
| การขาย                                   | ไม่มี         | ไม่มี         |
| การรับซื้อคืน                            | ไม่มี         | ไม่มี         |
| การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า <sup>2</sup> | ไม่มี         | ไม่มี         |
| การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก <sup>3</sup>  | ไม่มี         | ไม่มี         |
| การโอนหน่วย                              | 50 บาท/รายการ | 50 บาท/รายการ |

## หมายเหตุ :

- ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว
- ผู้ถือหน่วยลงทุนจะสับเปลี่ยนเข้าที่ราคาขาย ซึ่งเท่ากับ มูลค่าหน่วยลงทุนที่ใช้เพื่อการคำนวณราคาขาย + ค่าธรรมเนียมการขาย (ถ้ามี)
- ผู้ถือหน่วยลงทุนจะสับเปลี่ยนออกที่ราคาซื้อคืน ซึ่งเท่ากับ มูลค่าหน่วยลงทุนที่ใช้เพื่อการคำนวณราคาซื้อคืน - ค่าธรรมเนียมการรับซื้อคืน (ถ้ามี)

## ข้อมูลเชิงสถิติ

|                            |              |
|----------------------------|--------------|
| Maximum Drawdown           | -41.90%      |
| Recovering Period          | 1 ปี 9 เดือน |
| Sharpe Ratio               | 0.26         |
| Alpha                      | 0.24%        |
| Beta                       | 1.07         |
| อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน | 2.12 เท่า    |

## การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม 5 อันดับแรก

| กลุ่มอุตสาหกรรม                | %NAV  |
|--------------------------------|-------|
| เงินทุนและหลักทรัพย์           | 18.21 |
| เทคโนโลยีสารสนเทศและการสื่อสาร | 10.89 |
| อาหารและเครื่องดื่ม            | 9.80  |
| ตลาดหลักทรัพย์ เอ็ม เอ ไอ      | 8.70  |
| พาณิชย์                        | 7.72  |

## สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน

| Breakdown              | %NAV  |
|------------------------|-------|
| หุ้นสามัญ              | 88.61 |
| เงินฝากธนาคาร และอื่นๆ | 11.39 |

## ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก

| Holding                     | %NAV  |
|-----------------------------|-------|
| บมจ.คันทรี กรุ๊ป โฮลดิ้งส์  | 14.44 |
| บมจ.ศรีน่านาพร มาร์เก็ตติ้ง | 6.18  |
| บมจ.ฟอรัท คอร์ปอเรชั่น      | 5.64  |
| บมจ.ไทยคม                   | 5.25  |
| บมจ.พริโม เซอร์วิส โซลูชั่น | 5.13  |

## 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



สแกนเพื่อซื้อกองทุน

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)