กองทุนเปิด ทิสโก้ หุ้นบิ๊ก
TISCO Big Equity Fund

TISCOBIG

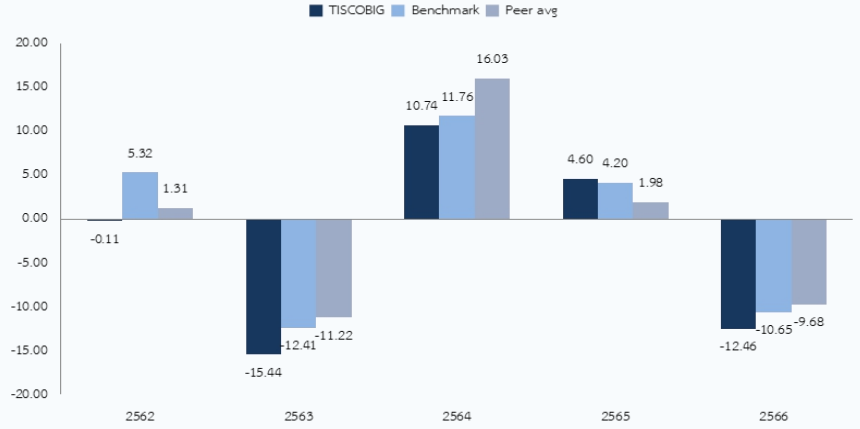
ประเภทกองทุนรวม/กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมตราสารทุน
- กลุ่ม Equity Large Cap

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- ลงทุนในหุ้นที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย 20 บริษัทแรก ซึ่งเรียงลำดับตามมูลค่าหลักทรัพย์ตามราคาตลาด ที่ผ่านหลักเกณฑ์การคัดเลือกหลักทรัพย์ให้เป็นส่วนประกอบของดัชนี SET50 โดยสัดส่วนการลงทุนในหุ้นแต่ละบริษัทขึ้นอยู่กับดุลยพินิจของบริษัทจัดการ ตามสภาวะการลงทุนหรือการคาดการณ์สภาวะการลงทุนในแต่ละขณะ ทั้งนี้ กองทุนอาจลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า เพื่อเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน
- มุ่งหวังให้ผลประกอบการสูงกว่าดัชนีชี้วัด (Active Management)

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (% ต่อปี)



ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด (%), (% ต่อปี*)

	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี*
กองทุน	0.40	2.38	5.30	-9.70
ดัชนีชี้วัด	-2.86	-0.46	1.94	-11.17
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	-3.91	-1.87	0.66	-10.52
ความผันผวนกองทุน	10.27	8.63	10.22	10.91
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	8.71	7.06	8.53	9.40
	3 ปี*	5 ปี*	10 ปี*	ตั้งแต่จัดตั้ง*
กองทุน	0.95	-4.01	n.a.	-1.24
ดัชนีชี้วัด	-0.18	-3.29	n.a.	0.32
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	-0.20	-3.57	0.36	n.a.
ความผันผวนกองทุน	11.24	18.63	n.a.	16.65
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	9.48	15.31	n.a.	13.71

ระดับความเสี่ยง

ต่ำ | 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | **6** | 7 | 8 | สูง

เสี่ยงสูง

ลงทุนในตราสารทุนเป็นหลัก โดยเฉลี่ยในรอบปีไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน	25 พ.ค. 60
วันเริ่มต้น class	
นโยบายการจ่ายเงินปันผล	ไม่จ่าย
อายุกองทุน	ไม่กำหนด

ผู้จัดการกองทุนรวม

นายณพัฒน์ ศรีวรพงษ์พันธ์ (ตั้งแต่ 1 ก.ย. 60)

น.ส. มัลลิกา นิยมในธรรม (ตั้งแต่ 18 ก.ย. 66)

ดัชนีชี้วัด

ดัชนีผลตอบแทนรวม SET50 (SET50 TRI) สัดส่วน 100%

คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวม มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต : ได้รับการรับรอง CAC

"ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือบริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่องได้ที่หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม"

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

www.tiscoasset.com

ประกาศความเป็นส่วนตัว (Privacy Notice)

การซื้อหน่วยลงทุน

วันทำการซื้อ : ทุกวันทำการ
เวลาทำการ : 8.30 น. - 15.00 น.
การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ : 1,000 บาท
การซื้อครั้งถัดไปขั้นต่ำ : 1,000 บาท

การขายคืนหน่วยลงทุน

วันทำการขายคืน : ทุกวันทำการ
เวลาทำการ : 8.30 น. - 15.00 น.
การขายคืนขั้นต่ำ : ไม่กำหนด
ยอดคงเหลือขั้นต่ำ : 100 หน่วย
ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน : T+3

หมายเหตุ : บริษัทจัดการขอสงวนสิทธิในการเปลี่ยนแปลงมูลค่าขั้นต่ำของการซื้อครั้งถัดไป ซึ่งจะคำนึงถึงประโยชน์ของผู้ถือหน่วยลงทุนเป็นสำคัญ โดยบริษัทจัดการจะประกาศการเปลี่ยนแปลงและแจ้งให้ผู้ถือหน่วยลงทุนทราบล่วงหน้าอย่างชัดเจนผ่านเว็บไซต์ของบริษัทจัดการ ภายในระยะเวลาที่ผู้ถือหน่วยลงทุนสามารถใช้ประโยชน์จากข้อมูลในการตัดสินใจลงทุนได้

ข้อมูลเชิงสถิติ

Maximum Drawdown	-39.01%
Recovering Period	-
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน	0.41 เท่า
Sharpe Ratio	-0.02
Alpha	1.13%
Beta	0.96

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	3.0000	1.6050
รวมค่าใช้จ่าย	5.0000	1.8360

หมายเหตุ : บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ และรวมค่าใช้จ่ายเป็นข้อมูลของรอบปีบัญชีล่าสุดหรือประมาณการเบื้องต้น (กรณียังไม่ครบรอบปีบัญชี)

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การขาย	2.50	1.00
การรับซื้อคืน	2.50	ปัจจุบันไม่เรียกเก็บ
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า	ไม่มี	ไม่มี
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก	ไม่มี	ไม่มี
การโอนหน่วย	30 บาทต่อ 10,000 หน่วย	ปัจจุบันไม่เรียกเก็บ

หมายเหตุ : บริษัทจัดการอาจเรียกเก็บค่าธรรมเนียมการขายและค่าธรรมเนียมการรับซื้อคืนกับผู้ลงทุนแต่ละกลุ่มไม่เท่ากัน ทั้งนี้ผู้ลงทุนสามารถดูรายละเอียดเพิ่มเติมได้ที่หนังสือชี้ชวนส่วนข้อมูลกองทุนรวม

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน

ประเภททรัพย์สิน	% NAV
เงินฝากธนาคาร	0.97
หุ้น	99.19
หนี้สินอื่น	-0.16

ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก

ชื่อทรัพย์สิน	% NAV
หุ้นสามัญของบริษัทเดลต้า อีเลคโทรนิคส์(ประเทศไทย) จำกัด(มหาชน)	11.38
หุ้นสามัญของบริษัท ปตท. จำกัด (มหาชน)	9.66
หุ้นสามัญของบริษัท ท่าอากาศยานไทย จำกัด (มหาชน)	8.74
หุ้นสามัญของบริษัท กัลฟ์ เอ็นเนอร์จี ดีเวลลอปเมนท์ จำกัด (มหาชน)	7.01
หุ้นสามัญของบริษัทปตท. สำรวจและผลิตปิโตรเลียม จำกัด (มหาชน)	6.11

การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม

กลุ่มอุตสาหกรรม	% NAV
พลังงานและสาธารณูปโภค	26.27
ธนาคาร	14.05
เทคโนโลยีสารสนเทศและการสื่อสาร	11.82
ชิ้นส่วนอิเล็กทรอนิกส์	11.38
พาณิชย์	8.93
ขนส่งและโลจิสติกส์	8.74
การแพทย์	7.82
วัสดุก่อสร้าง	4.38
พัฒนาอสังหาริมทรัพย์	3.55
อาหารและเครื่องดื่ม	2.26

คำอธิบาย

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

Recovering Period ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาตั้งแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลานานเท่าใด

FX Hedging เปอร์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตกองทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลาหนึ่ง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อหลักทรัพย์กับผลรวมของมูลค่าการขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 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

Yield to Maturity อัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในตราสารหนี้โดยถือจนครบกาหนดอายุ ซึ่งคำนวณจากดอกเบี้ยที่จะได้รับในอนาคตตลอดอายุตราสารและเงินต้นที่จะได้รับคืนนำมาคิดลดเป็นมูลค่าปัจจุบัน โดยใช้วัดอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมตราสารหนี้ คำนวณจากค่าเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักของ Yield to Maturity ของตราสารหนี้แต่ละตัวที่กองทุนมีการลงทุน และเนื่องจาก Yield to Maturity มีหน่วยมาตรฐานเป็นเปอร์เซ็นต์ต่อปี จึงสามารถนำไปใช้เปรียบเทียบอัตราผลตอบแทนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีนโยบายถือครองตราสารหนี้จนครบกำหนดอายุและมีลักษณะการลงทุนที่ใกล้เคียงกันได้

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ทิสโก้ จำกัด
โทรศัพท์ 02 633 6000 www.tiscoasset.com
48/16-17 อาคารทิสโก้ทาวเวอร์ ชั้น 9 ถนนสาทรเหนือ แขวงสีลม เขตบางรัก กรุงเทพฯ 10500