

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน เอ็มเอฟซี จำกัด (มหาชน)

กองทุนเปิดเอ็มเอฟซี เอเชีย อัลฟ่า

MFC Asia Alpha Fund

M-ASIA

ประเภทกองทุนรวม/กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมตราสารทุน
- กองทุนรวมฟีดเดอร์ (Feeder Fund) เป็นกองทุนที่มีความเสี่ยงต่างประเทศ
- กลุ่มกองทุนรวม : Asia Pacific Ex Japan

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- ลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนต่างประเทศเพียงกองทุนเดียว คือ Fullerton Lux Fund - Asia Absolute Alpha (กองทุนหลัก) ในชนิดหน่วยลงทุน (share class) "A USD Acc" ในสกุลเงินเหรียญดอลลาร์สหรัฐ ซึ่ง Fullerton Fund Management Company Ltd. เป็นผู้จัดการการลงทุนและ Lemanik Asset Management S.A. เป็นบริษัทจัดการ
- กองทุนหลักมีวัตถุประสงค์เพื่อสร้างผลตอบแทนที่เป็นบวกในระยะยาว ซึ่งรวมทั้งการเพิ่มค่าเงินลงทุนและรายได้ โดยกองทุนหลักจะลงทุนเป็นหลักโดยไม่จำกัดเพียงในตราสารทุน ใบสำคัญแสดงสิทธิที่จะซื้อหุ้น สัญญาซื้อขายล่วงหน้าอ้างอิงดัชนี เงินสดและเทียบเท่าเงินสด โดยกรอบการลงทุนรวมถึงแต่ไม่จำกัดในตราสารทุนและหลักทรัพย์ที่ใกล้เคียงกับตราสารทุนที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ของภูมิภาคเอเชียแปซิฟิก รวมถึงตราสารทุนและหลักทรัพย์ที่ใกล้เคียงกับตราสารทุนของบริษัทที่ดำเนินธุรกิจ มีการลงทุน หรือมีรายได้จากภูมิภาคเอเชียแปซิฟิก ซึ่งอาจจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ของภูมิภาคอื่น พอร์ตการลงทุนของกองทุนจะเป็นลักษณะ high conviction ซึ่งลงทุนแบบกระจุกตัวในหุ้น และไม่อ้างอิงกับดัชนีชี้วัดใดๆ กองทุนมุ่งเน้นลงทุนในบริษัทเติบโตที่มีพื้นฐานทางเศรษฐกิจที่ดี เพื่อให้ได้ผลตอบแทนส่วนเพิ่มของพอร์ตการลงทุน (alpha return) ผ่านการวิเคราะห์ปัจจัยพื้นฐานของบริษัทและกลุ่มอุตสาหกรรม และใช้วิธีวิเคราะห์แบบ bottom-up เพื่อให้ได้มาซึ่งบริษัทที่มีประวัติผลการดำเนินงานที่ดีและมีความสามารถในการแข่งขัน หรือมีศักยภาพในการเติบโต ซึ่งยังไม่สะท้อนในราคาหลักทรัพย์อย่างเต็มที่ ทั้งนี้ กระบวนการคัดเลือกหลักทรัพย์จะพิจารณาปัจจัยหลายๆ ด้าน ซึ่งรวมถึงแต่ไม่จำกัดเพียงโอกาสที่จะขาดทุนสูงสุดในภาวะตลาดขาลง
- ลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) เพื่อป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ และเพื่อเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน (Efficient portfolio management)
- กองทุนไทยมุ่งหวังให้ผลประกอบการเคลื่อนไหวตามกองทุนหลัก ส่วนกองทุนหลักมุ่งหวังให้ผลประกอบการเคลื่อนไหวแบบ active management

ระดับความเสี่ยง

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

เสี่ยงสูง

ลงทุนในหน่วยลงทุนตราสารทุนเป็นหลัก โดยเฉลี่ยในรอบปีไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน	ภายใน 2 วันทำการหลังจากวันสุดท้ายของการ IPO
นโยบายการจ่ายเงินปันผล	ไม่จ่าย
อายุกองทุน	ไม่กำหนด

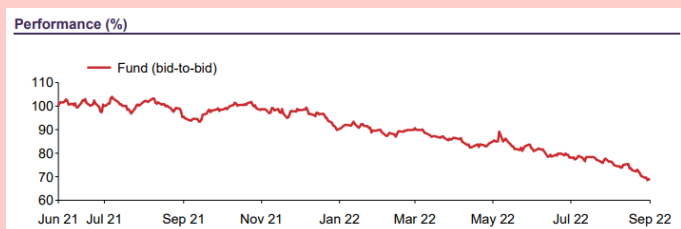
ผู้จัดการกองทุนรวม

- คุณชนากานต์ หังสสุต - เริ่มบริหารจัดการตั้งแต่วันที่จดทะเบียนกองทุน
- คุณฉัตรแพรว ศิริสกาวกุล - เริ่มบริหารจัดการตั้งแต่วันที่จดทะเบียนกองทุน

ดัชนีชี้วัด :

- ไม่มี เนื่องจากกองทุนหลักไม่มีดัชนีชี้วัดสำหรับวัดผลการดำเนินงานที่สะท้อนวัตถุประสงค์และนโยบายการลงทุนของกองทุนหลัก

ผลการดำเนินงานย้อนหลัง 5 ปีปฏิทินของกองทุนหลัก (%ต่อปี)



หมายเหตุ : วันเริ่มต้นของกองทุนหลัก (share class) "A USD Acc" - วันที่ 24 มิถุนายน 2564

ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุดของกองทุนไทย (%ต่อปี)

	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี
กองทุน				
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน				
ความผันผวนกองทุน				
	3 ปี	5 ปี	10 ปี	ตั้งแต่จัดตั้ง

กองทุน
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน
ความผันผวนกองทุน

หมายเหตุ : กองทุนอยู่ระหว่างการจัดตั้ง จึงยังไม่มีผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด

คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวม มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต : ได้รับการรับรองจาก CAC

ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือ

บริหารความเสี่ยงด้านสภาพ

คล่องได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



www.mfcfund.com

การซื้อหน่วยลงทุน

การขายคืนหน่วยลงทุน

วันทำการซื้อ:	ทุกวันทำการ	วันทำการขายคืน:	ทุกวันทำการ
เวลาทำการ:	08:30 – 15:30 น.	เวลาทำการ:	08:30 – 13:00 น.
การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ:	1,000 บาท	การขายคืนขั้นต่ำ:	ไม่กำหนด
การซื้อครั้งถัดไปขั้นต่ำ:	1,000 บาท	ยอดคงเหลือขั้นต่ำ:	ไม่กำหนด

ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน: T+5
คือ 5 วันทำการนับแต่วันรับซื้อคืนหน่วยลงทุน

หมายเหตุ

- กองทุนเปิดเสนอขายหน่วยลงทุนครั้งแรก (IPO) ระหว่างวันที่ 25 – 30 พฤศจิกายน 2565
- ตั้งแต่วันที่ 6 ธันวาคม 2565 เป็นต้นไป กองทุนเปิดให้สั่งซื้อ/ขายคืน/สับเปลี่ยนหน่วยลงทุน/ซื้อหน่วยลงทุนแบบสม่ำเสมอ

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	2.14	1.6050
รวมค่าใช้จ่าย	4.89	1.9581

หมายเหตุ:

ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)¹

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การขาย ²	2.00	1.0 (ช่วง IPO), 1.5 (หลัง IPO)
การรับซื้อคืน	2.00	ไม่เก็บ
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า ³	ไม่มี	ไม่มี
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก ⁴	ไม่มี	ไม่มี
การโอนหน่วย	ตามที่นายทะเบียนเรียกเก็บ	ตามที่นายทะเบียนเรียกเก็บ

หมายเหตุ:

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

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุนของกองทุนไทย*

Breakdown	% NAV
หน่วยลงทุนกองทุนต่างประเทศ	80.00
เงินฝากธนาคาร และอื่นๆ	20.00

ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรกของกองทุนไทย*

Holding	% NAV
Fullerton Lux Funds-Asia	80.00
Absolute Alpha (A USD Acc)	
อื่นๆ	20.00

ข้อมูลเชิงสถิติ

Maximum Drawdown	N/A
Recovering Period	N/A
FX Hedging	N/A
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน	N/A
Sharpe Ratio	N/A
Alpha	N/A
Beta	N/A

การจัดสรรการลงทุนในแต่ละประเทศ 5 อันดับแรกของกองทุนหลัก

ประเทศ	% NAV
จีน	20.40
สิงคโปร์	14.30
อินเดีย	10.30
ไต้หวัน	9.00
อเมริกา	7.60

ข้อมูลกองทุนหลัก ณ วันที่ 30 ก.ย. 65

การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม 5 อันดับแรกของกองทุนหลัก

Sector	% NAV
Communication Services	18.60
Consumer Discretionary	16.70
Information Technology	16.70
Industrial	9.90
Consumer Staples	3.90

ข้อมูลกองทุนหลัก ณ วันที่ 30 ก.ย. 65

ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรกของกองทุนหลัก

Holding	% NAV
Singapore Telecommunications	7.50
Taiwan Semiconductor Manufacturing	5.60
Alibaba Group Holding	4.30
PT Telkom Indonesia (Persero) Tbk	3.60
Tencent Holdings	3.30

ข้อมูลกองทุนหลัก ณ วันที่ 30 ก.ย. 65

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุนของกองทุนหลัก*

Breakdown	% NAV
หุ้นสามัญ	77.10
เงินสดและเทียบเท่าเงินสด และอื่นๆ	22.90

ข้อมูลกองทุนหลัก ณ วันที่ 30 ก.ย. 65

*ข้อมูลดังกล่าวเป็นการประมาณการลงทุนเบื้องต้น .ซึ่งอาจเปลี่ยนแปลงได้ตามการลงทุนจริง

การลงทุนในกองทุนต่างประเทศเกินกว่า 20% ของ NAV

ชื่อกองทุน:	Fullerton Lux Funds-Asia Absolute Alpha
ISIN Code:	LU0979878070
Bloomberg Ticker:	FUAAAAU LX

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 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 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 อาคารคอคอลน์ทาวเวอร์ ชั้น จี และชั้น 21-23

ถนนรัชดาภิเษก เขตคลองเตย กรุงเทพฯ 10110

โทรศัพท์: 0-2649-2000 www.mfcfund.com