

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน เอ็มเอฟซี จำกัด (มหาชน)

กองทุนเปิดเอ็มเอฟซี โกลบอล แคนนาบิส

MFC Global Cannabis Fund

MCANN

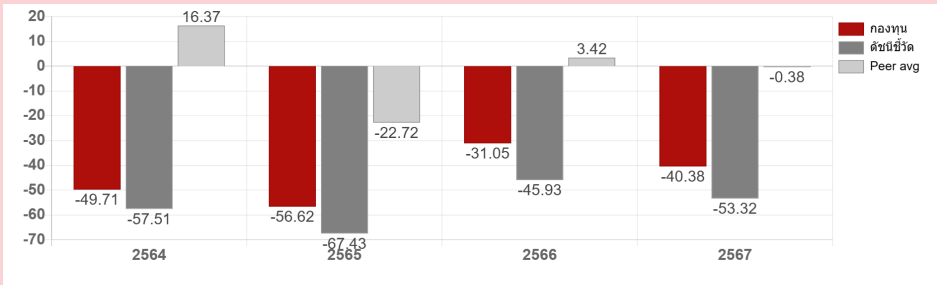
ประเภทกองทุนรวม/กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมตราสารทุน
- กลุ่มกองทุนรวม: Other Global Sector Equity

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- ลงทุนในตราสารทุน หน่วยลงทุนของกองทุนต่างประเทศ และ/หรือกองทุนรวมอิตาลีต่างประเทศที่มีนโยบายลงทุนในตราสารทุนต่างประเทศทั่วโลกของบริษัทที่ดำเนินธุรกิจเกี่ยวข้องกับผลิตภัณฑ์ทางกัญชา (Cannabis) หรือกัญชง (Hemp) ที่ถูกกฎหมาย
- กองทุนอาจลงทุนใน derivatives เพื่อป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน และเพื่อ Efficient Portfolio Management
- กองทุนมุ่งหวังให้ผลประกอบการสูงกว่าดัชนีชี้วัด (Active Management)

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (%ต่อปี)



ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด (%ต่อปี)

|                          | YTD    | 3 เดือน | 6 เดือน | 1 ปี   |
|--------------------------|--------|---------|---------|--------|
| กองทุน                   | -29.47 | -19.10  | -40.59  | -58.74 |
| ดัชนีชี้วัด              | -29.65 | -18.51  | -46.24  | -65.75 |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน | 3.83   | 0.01    | -2.22   | -0.05  |
| ความผันผวนกองทุน         | 44.78  | 47.97   | 42.69   | 44.90  |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด    | 55.13  | 60.96   | 54.72   | 52.17  |

|                          | 3 ปี   | 5 ปี | 10 ปี | ตั้งแต่จัดตั้ง |
|--------------------------|--------|------|-------|----------------|
| กองทุน                   | -42.05 | -    | -     | -49.10         |
| ดัชนีชี้วัด              | -53.90 | -    | -     | -59.60         |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน | -2.49  | -    | -     | -              |
| ความผันผวนกองทุน         | 48.29  | -    | -     | 45.27          |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด    | 56.36  | -    | -     | 55.20          |

\* ผลตอบแทนที่มีอายุเกินหนึ่งปีจะแสดงเป็นผลตอบแทนต่อปี

ระดับความเสี่ยง



ข้อมูลกองทุนรวม :

|                        |               |
|------------------------|---------------|
| วันจดทะเบียนกองทุน     | 29 เม.ย. 2564 |
| นโยบายการจ่ายเงินปันผล | ไม่จ่าย       |
| อายุกองทุน             | ไม่กำหนด      |

ผู้จัดการกองทุนรวม :

- นายธนัย ลิขิตชัยกุล (ตั้งแต่ 3 ก.ค. 2566)
- นายชาญวุฒิ รุ่งแสงมัญญ (ตั้งแต่ 29 เม.ย. 2564)

ดัชนีชี้วัด :

- 1) ETFMG Alternative Harvest ETF (MJ US Equity) สัดส่วน 70%
- 2) Amplify Seymour Cannabis ETF (CNBS US Equity) สัดส่วน 30%

หมายเหตุ: ปรับด้วยต้นทุนการป้องกันความเสี่ยงด้านอัตราแลกเปลี่ยนเพื่อคำนวณผลตอบแทนเป็นสกุลเงินบาท ณ วันที่ลงทุน สัดส่วน 85% และปรับด้วยอัตราแลกเปลี่ยนเพื่อคำนวณผลตอบแทนเป็นสกุลเงินบาท ณ วันคำนวณผลตอบแทน สัดส่วน 15% (มีผลตั้งแต่วันที่ 1 เมษายน 2568 เป็นต้นไป)

คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวมไม่ได้เป็นสัญญาณถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

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 - 15:00 น. |
| การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ :                                                                                                 | 1,000 บาท        | การขายคืนขั้นต่ำ :  | ไม่กำหนด         |
| การซื้อครั้งถัดไปขั้นต่ำ :                                                                                               | 500 บาท          | ยอดคงเหลือขั้นต่ำ : | ไม่กำหนด         |
| ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน :                                                                                            |                  |                     | T+5*             |
| หมายเหตุ :                                                                                                               |                  |                     |                  |
| • T+5 คือ 5 วันทำการนับจากวันคำนวณ NAV (ปัจจุบัน 5 วันทำการหลังจากวันทำการขายคืน โดยมีให้นับรวมวันหยุดทำการในต่างประเทศ) |                  |                     |                  |

| ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)                                                                     |               |          |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------|----------|
| ค่าธรรมเนียม                                                                                                              | สูงสุดไม่เกิน | เก็บจริง |
| การจัดการ                                                                                                                 | 2.1400        | 0.8025   |
| รวมค่าใช้จ่าย                                                                                                             | 4.8899        | 1.2312   |
| หมายเหตุ :                                                                                                                |               |          |
| • ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว                                                |               |          |
| • การปรับลดค่าธรรมเนียมการจัดการ จาก 1.605% เป็น 0.8025% มีผลตั้งแต่วันที่ 8 ส.ค. 2565 เป็นต้นไป จนกว่าจะมีการเปลี่ยนแปลง |               |          |
| • การรวมค่าใช้จ่ายที่เก็บจริง คิดตามรอบบัญชีของกองทุน                                                                     |               |          |

| ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)                                                                                       |               |                     |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------|---------------------|
| ค่าธรรมเนียม                                                                                                                                      | สูงสุดไม่เกิน | เก็บจริง            |
| การขาย                                                                                                                                            | 2.00          | 1.50                |
| การรับซื้อคืน                                                                                                                                     | 2.00          | ไม่มี               |
| การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า                                                                                                                       | ไม่มี         | ดูหมายเหตุเพิ่มเติม |
| การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก                                                                                                                        | ไม่มี         | ดูหมายเหตุเพิ่มเติม |
| การโอนหน่วย                                                                                                                                       | 50 บาท/รายการ | 50 บาท/รายการ       |
| หมายเหตุ :                                                                                                                                        |               |                     |
| • ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว                                                                        |               |                     |
| • ผู้ถือหน่วยลงทุนจะสับเปลี่ยนเข้าที่ราคาขาย ซึ่งเท่ากับ มูลค่าหน่วยลงทุนที่ใช้เพื่อการค้าขาย + ค่าธรรมเนียมการขาย (ถ้ามี)                        |               |                     |
| • ผู้ถือหน่วยลงทุนจะสับเปลี่ยนออกที่ราคารับซื้อคืน ซึ่งเท่ากับ มูลค่าหน่วยลงทุนที่ใช้เพื่อการค้าขายรับซื้อคืน - ค่าธรรมเนียมการรับซื้อคืน (ถ้ามี) |               |                     |
| • บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ                          |               |                     |

| สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน |       |
|--------------------------------|-------|
| Breakdown                      | %NAV  |
| หน่วยลงทุน                     | 89.89 |
| หุ้นสามัญ                      | 7.18  |
| เงินฝากธนาคาร และอื่นๆ         | 2.93  |

| ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก   |       |
|---------------------------------|-------|
| Holding                         | %NAV  |
| Amplify Alternative Harvest ETF | 61.51 |
| iShares Short Treasury Bond ETF | 15.49 |
| Amplify Seymour Cannabis ETF    | 12.89 |
| Jazz Pharmaceuticals PLC        | 7.18  |

| ข้อมูลเชิงสถิติ            |           |
|----------------------------|-----------|
| Maximum Drawdown           | -94.44%   |
| Recovering Period          | N/A       |
| FX Hedging                 | 96.75%    |
| Sharpe Ratio               | -1.16     |
| Alpha                      | 11.85%    |
| Beta                       | N/A       |
| อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน | 0.22 เท่า |

การลงทุนในกองทุนอื่นเกินกว่า 20% (กองทุนต่างประเทศ)

| ชื่อกองทุน                      | ISIN code    | Bloomberg code |
|---------------------------------|--------------|----------------|
| AMPLIFY ALTERNATIVE HARVEST ETF | US0321086318 | MJ US          |

คำอธิบาย

- **Maximum Drawdown:** เปอร์เซนต์ผลขาดทุนสูงสุดของกองทุนรวมในระยะเวลา 5 ปีย้อนหลัง (หรือตั้งแต่จัดตั้งกองทุนกรณีที่ยังไม่ครบ 5 ปี) โดยวัดจากระดับ NAV ต่อหน่วยที่จุดสูงสุดไปจนถึงจุดต่ำสุดในช่วงที่ NAV ต่อหน่วยปรับตัวลดลง ค่า Maximum Drawdown เป็นข้อมูลที่ช่วยให้ทราบถึงความเสี่ยงที่อาจจะขาดทุน จากการลงทุนในกองทุนรวม
- **Recovering Period:** ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาดังแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลานานเท่าใด
- **FX Hedging:** เปอร์เซนต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน
- **อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน:** ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตกองทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลาหนึ่ง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์ กับผลรวมของมูลค่าการขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 1 ปีหารด้วยมูลค่า NAV ของกองทุนรวมเฉลี่ยในรอบระยะเวลาเดียวกัน กองทุนรวมที่มีค่า portfolio turnover สูง บ่งชี้ถึงการซื้อขายหลักทรัพย์บ่อยครั้งของผู้จัดการกองทุนและทำให้มีต้นทุนการซื้อขายหลักทรัพย์ที่สูง จึงต้องพิจารณาเปรียบเทียบกับผลการดำเนินงานของกองทุนรวม เพื่อประเมินความคุ้มค่าของการซื้อขายหลักทรัพย์ดังกล่าว
- **Sharpe Ratio:** อัตราส่วนระหว่างผลตอบแทนส่วนเพิ่มของกองทุนรวมเปรียบเทียบกับความเสี่ยงจากการลงทุน โดยคำนวณจากผลต่างระหว่างอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวม กับอัตราผลตอบแทนที่ปราศจากความเสี่ยง (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 ซึ่งคำนวณจากดอกเบี้ยที่จะได้รับในอนาคตตลอดอายุตราสารและเงินต้นที่จะได้รับคืน นำมาคิดลดเป็นมูลค่าปัจจุบัน โดยใช้วัดอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมตราสารหนี้ คำนวณจากค่าเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักของ Yield to Maturity ของตราสารหนี้แต่ละตัวที่กองทุนมีการลงทุน และเนื่องจาก Yield to Maturity มีหน่วยมาตรฐานเป็นเปอร์เซนต์ต่อปี จึงสามารถนำไปใช้เปรียบเทียบอัตราผลตอบแทนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีนโยบายถือครองตราสารหนี้จนครบกำหนดอายุและมีลักษณะการลงทุนที่ใกล้เคียงกันได้

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน เอ็มเอฟซี จำกัด (มหาชน)  
เลขที่ 199 อาคารคอลัมน์ทาวเวอร์ ชั้น จี และชั้น 21-23  
ถนนรัชดาภิเษก เขตคลองเตย กรุงเทพฯ 10110  
โทรศัพท์: 0-2649-2000 [www.mfcfund.com](http://www.mfcfund.com)