

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน เอ็มเอฟซี จำกัด (มหาชน)



กองทุนเปิดเอ็มเอฟซีท็อป 25 หุ้นไทยเพื่อความยั่งยืน

MFC Equity Top 25 Thailand ESG Fund

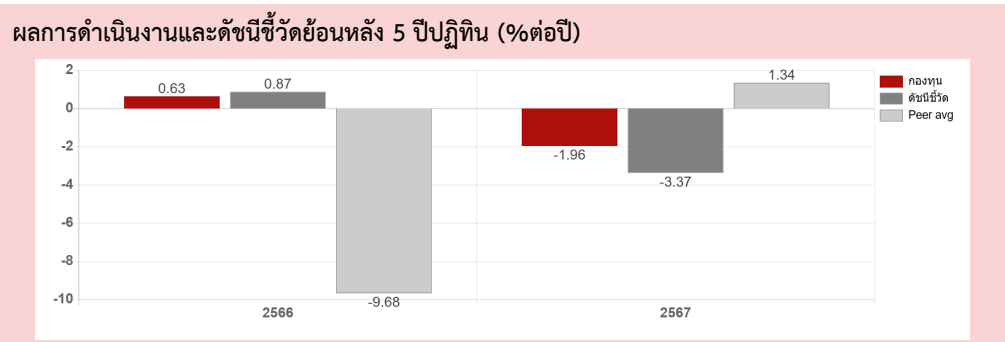
MT25-ThaiESG

ประเภทกองทุนรวม/กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมตราสารทุน
- กองทุนรวมไทยเพื่อความยั่งยืน (Thailand ESG Fund)/ กองทุนรวมเพื่อความยั่งยืน (SRI Fund)
- กลุ่มกองทุนรวม : Equity Large Cap

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- ลงทุนในตราสารทุนที่ผู้ออกเป็นภาครัฐไทยหรือกิจการที่จัดตั้งขึ้นตามกฎหมายไทย โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของ NAV ทั้งนี้ ทรัพย์สินที่จะลงทุนจะเป็นทรัพย์สินอย่างใดอย่างหนึ่งหรือหลายอย่างดังต่อไปนี้
 1. หุ้นที่จดทะเบียนใน SET และ/หรือ mai ที่มีความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน (Environmental, Social and Governance: ESG)
 2. หุ้นที่จดทะเบียนใน SET หรือ mai ที่มีลักษณะดังนี้
 - 2.1 เป็นหุ้นของบริษัทจดทะเบียนที่มีธรรมาภิบาล (Governance) โดยได้รับการประเมินการกำกับดูแลกิจการบริษัทจดทะเบียน (CGR) จากสมาคมส่งเสริมสถาบันกรรมการบริษัทไทย ตั้งแต่ 90 คะแนนขึ้นไป หรือเทียบเท่า
 - 2.2 มีการเปิดเผยเป้าหมายและแผนธุรกิจ/แผนการยกระดับ และรายงานความคืบหน้าการปฏิบัติตามเป้าหมายหรือแผน ผ่านช่องทางของ SET
 - 2.3 มีการเพิ่มประสิทธิภาพการสื่อสารกับผู้ลงทุน ตามที่ SET กำหนดทั้งนี้ กองทุนจะมุ่งเน้นการลงทุนในหุ้นเต็มอัตรา (Fully Invested) ตลอดเวลา โดยจะลงทุนในหุ้นสามัญและ/หรือหุ้นบุริมสิทธิของบริษัทที่จดทะเบียนใน SET และเป็นบริษัทที่เป็นองค์ประกอบของดัชนี SET ESG Index กองทุนจะวิเคราะห์และคัดเลือกหลักทรัพย์เพิ่มเติม ด้วยกลยุทธ์ ESG Screening และจะลงทุนในหุ้นของ 25 บริษัทแรกที่ผ่านมาเกณฑ์การคัดเลือกหลักทรัพย์ซึ่งเกณฑ์ดังกล่าวจะพิจารณามูลค่าหลักทรัพย์ตามราคาตลาด(Market Capitalization) การเปิดเผยข้อมูลด้านการบริหารจัดการสิ่งแวดล้อม สังคม และธรรมาภิบาล (ESG) และการได้รับ ESG Ratings หรือ ESG Scores ในระดับที่ไม่ต่ำกว่า A หรือที่ได้คะแนนเทียบเท่าจากสถาบันการจัดอันดับที่เป็นอิสระ
- กองทุนมีกลยุทธ์การลงทุนเพื่อมุ่งหวังให้ผลประโยชน์การเคลื่อนไหวสูงกว่าดัชนีชี้วัด (active management) โดยมีการบริหารจัดการในเชิงรุก ซึ่งมีวัตถุประสงค์ที่จะอ้างอิงดัชนีชี้วัดเพื่อเปรียบเทียบกับผลการดำเนินงานของกองทุนรวม (Performance Objective)



ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด (%ต่อปี)				
	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี
กองทุน	-3.64	8.15	5.74	-3.00
ดัชนีชี้วัด	-6.58	7.71	5.30	-5.66
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	-8.64	7.05	2.82	-6.20
ความผันผวนกองทุน	20.10	19.26	21.45	18.30
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	21.55	19.93	22.77	19.38
	3 ปี	5 ปี	10 ปี	ตั้งแต่จัดตั้ง
กองทุน	-	-	-	-2.94
ดัชนีชี้วัด	-	-	-	-5.39
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	-	-	-	-
ความผันผวนกองทุน	-	-	-	15.50
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	-	-	-	16.47

* ผลตอบแทนที่มีอายุเกินหนึ่งปีจะแสดงเป็นผลตอบแทนต่อปี

ระดับความเสี่ยง

ต่ำ

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

สูง

เสี่ยงสูง

ลงทุนในตราสารทุนเป็นหลัก โดยเฉลี่ยในรอบปีไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม :	
วันจดทะเบียนกองทุน	21 ธ.ค. 2566
นโยบายการจ่ายเงินปันผล	จ่าย
อายุกองทุน	ไม่กำหนดอายุโครงการ

- ผู้จัดการกองทุนรวม :
- นายประวีร์ อัจฉิมกุล (ตั้งแต่ 21 ธ.ค. 2566)
 - นายพิพัฒน์ นรนนท์ (ตั้งแต่ 21 ธ.ค. 2566)
- ดัชนีชี้วัด :
- ดัชนีผลตอบแทนรวม SET ESG (SETESG TRI) สัดส่วน 100%

คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวมมิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

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 - 15:30 น.
การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ :	500 บาท	การขายคืนขั้นต่ำ :	ไม่กำหนด
การซื้อครั้งถัดไปขั้นต่ำ :	500 บาท	ยอดคงเหลือขั้นต่ำ :	ไม่กำหนด
ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน :			T+5*

หมายเหตุ :

- T+5 คือ 5 วันทำการหลังจากวันทำรายการขายคืน (ปัจจุบัน 3 วันทำการหลังจากวันทำรายการขายคืน)

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)		
ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	2.1400	1.3375
รวมค่าใช้จ่าย	4.8899	1.5436

หมายเหตุ :

- ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว
- การรวมค่าใช้จ่ายที่เก็บจริง คิดตามรอบบัญชีของกองทุน

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)		
ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การขาย	2.00	ไม่มี
การรับซื้อคืน	2.00	0.50
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า	ไม่มี	ดูหมายเหตุเพิ่มเติม
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก	ไม่มี	ดูหมายเหตุเพิ่มเติม
การโอนหน่วย	ไม่มี	ไม่มี

หมายเหตุ :

- ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว
- บริษัทจัดการของสงวนสิทธิในการคิดค่าธรรมเนียมการขายหน่วยลงทุนและ/หรือค่าธรรมเนียมการรับซื้อคืนหน่วยลงทุนกับผู้สั่งซื้อหรือผู้ถือหน่วยลงทุนแต่ละกลุ่มไม่เท่ากันได้
- ค่าธรรมเนียมการรับซื้อคืน กรณีถือครองต่ำกว่า 5 ปี เก็บ 0.50% ถือครองครบ 5 ปี ไม่เก็บ
- ผู้ถือหน่วยลงทุนจะสับเปลี่ยนเข้าที่ราคาขาย ซึ่งเท่ากับ มูลค่าหน่วยลงทุนที่ใช้เพื่อการคำนวณราคาขาย + ค่าธรรมเนียมการขาย (ถ้ามี)
- ผู้ถือหน่วยลงทุนจะสับเปลี่ยนออกที่ราคารับซื้อคืน ซึ่งเท่ากับ มูลค่าหน่วยลงทุนที่ใช้เพื่อการคำนวณราคารับซื้อคืน - ค่าธรรมเนียมการรับซื้อคืน (ถ้ามี)
- ผู้ถือหน่วยลงทุนสามารถโอนย้ายหน่วยลงทุนมายังกองทุนรวมไทยเพื่อความยั่งยืนภายใต้การจัดการของ บลจ. ได้ โดยมีค่าธรรมเนียม เท่ากับ มูลค่าหน่วยลงทุนที่ใช้เพื่อการคำนวณราคาขาย + ค่าธรรมเนียมการขาย (ถ้ามี)
- ผู้ถือหน่วยลงทุนสามารถโอนย้ายหน่วยลงทุนไปยังกองทุนรวมไทยเพื่อความยั่งยืนภายใต้การจัดการของ บลจ.อื่น ได้ โดยมีค่าธรรมเนียม (คิดจริง) 0.50% ของมูลค่าหน่วยลงทุนของวันทำการล่าสุดก่อนวันทำรายการโอนย้าย (วัน T-1)
- ผู้ถือหน่วยลงทุนไม่สามารถนำหน่วยลงทุนของกองทุนรวมไทยเพื่อความยั่งยืนไปจำหน่าย โอน จำนำ หรือนำไปเป็นหลักประกันได้ ทั้งนี้เพื่อให้เป็นไปตามที่กฎหมายกำหนด
- บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ

ข้อมูลเชิงสถิติ	
Maximum Drawdown	-24.57%
Recovering Period	N/A
Sharpe Ratio	-0.32
Alpha	2.44%
Beta	1.04
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน	0.32 เท่า

การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม 5 อันดับแรก	
กลุ่มอุตสาหกรรม	%NAV
ธนาคาร	23.24
พลังงาน	23.04
ชิ้นส่วนอิเล็กทรอนิกส์	9.14
พาณิชย์	8.65
ขนส่ง	6.97

ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก	
Holding	%NAV
บมจ.เดลต้า อีเลคโทรนิคส์ (ประเทศไทย)	9.14
บมจ.กัลฟ์ ดีเวลลอปเม้นท์	7.10
บมจ.ท่าอากาศยานไทย	6.97
บมจ.แอดวานซ์ อินโฟร์ เซอร์วิส	6.18
บมจ.เอสซีบี เอกซ์	6.06

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน	
Breakdown	%NAV
หุ้นสามัญ	99.01
เงินฝากธนาคาร และอื่นๆ	0.99

ข้อมูลอื่นๆ

นโยบายการลงทุนเพิ่มเติม

• วัตถุประสงค์การลงทุนที่เกี่ยวกับความยั่งยืน

กองทุนจะลงทุนในบริษัทที่มีความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน (Environmental, Social and Governance: ESG) หรือด้านธรรมาภิบาล (Governance) โดยจะเน้นลงทุนในบริษัทจดทะเบียนตามกรอบนโยบายการลงทุนที่ให้ความสำคัญและมีการดำเนินธุรกิจที่สอดคล้องกับเป้าหมายการพัฒนาที่ยั่งยืนขององค์การสหประชาชาติ (United Nations Sustainable Development Goals: UN SDGs) ที่สะท้อนมิติความยั่งยืนในด้านสังคม เศรษฐกิจ และสิ่งแวดล้อม (ESG) สอดรับกับนโยบายการลงทุนแบบยั่งยืน (Sustainable Investment)

• เป้าหมายที่กองทุนรวมต้องการบรรลุ

กองทุนจะเน้นลงทุนในบริษัทจดทะเบียนตามกรอบนโยบายการลงทุนที่ให้ความสำคัญและมีการดำเนินธุรกิจที่สอดคล้องกับเป้าหมายการพัฒนาที่ยั่งยืนในด้านสังคม เศรษฐกิจ และสิ่งแวดล้อม (ESG) เพื่อสร้างผลตอบแทนที่ยั่งยืนให้กับผู้ถือหุ้นรายละคน และเป็นกลไกผลักดันการดำเนินงานของธุรกิจของบริษัทให้มีส่วนช่วยลดปัญหาและผลกระทบที่มีต่อสถานะแวดล้อม และมีการดำเนินธุรกิจอย่างยั่งยืนโดยให้ความสำคัญกับหลักธรรมาภิบาล และคำนึงถึงผู้มีส่วนได้ส่วนเสีย (Stakeholder) รวมทั้งสังคมรอบข้าง นอกจากนี้ ยังเป็นการช่วยสร้างการเติบโตอย่างยั่งยืนและส่งผลกระทบต่อสังคมและสิ่งแวดล้อมได้ในระยะยาว เพื่อให้ประเทศไทยบรรลุการพัฒนาที่ยั่งยืนขององค์การสหประชาชาติ (United Nations Sustainable Development Goals: UN SDGs)

• กรอบการลงทุน (Investment universe)

กองทุนจะลงทุนในหุ้นสามัญและ/หรือหุ้นปริมาตรสิทธิของบริษัทที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย และเป็นบริษัทที่เป็นองค์ประกอบของดัชนี SET ESG Index ที่ผ่านเกณฑ์การคัดเลือกหลักทรัพย์ โดยเกณฑ์ดังกล่าวจะพิจารณามูลค่าหลักทรัพย์ตามราคาตลาด (Market Capitalization) การเปิดเผยข้อมูลด้านการบริหารจัดการสิ่งแวดล้อม สังคม และธรรมาภิบาล (ESG) และการได้รับ ESG Ratings หรือ ESG Scores ในระดับที่ไม่ต่ำกว่า A หรือที่ได้คะแนนเทียบเท่า จากสถาบันการจัดอันดับที่เป็นอิสระ อาทิเช่น Refinitiv, S&P Global, MSCI ESG Rating, Sustainalytics, Arabesque S-Ray ESGBook เป็นต้น และสถาบันจัดอันดับอื่นๆ ที่ได้มาตรฐานที่สำนักงาน ก.ล.ต. ประกาศกำหนด

คำอธิบาย

- **Maximum Drawdown:** เพอร์เซ็นต์ผลขาดทุนสูงสุดของกองทุนรวมในระยะเวลา 5 ปีย้อนหลัง (หรือตั้งแต่จัดตั้งกองทุนกรณีที่ยังไม่ครบ 5 ปี) โดยวัดจากระดับ NAV ต่อหน่วยที่จุดสูงสุดไปจนถึงจุดต่ำสุดในช่วงที่ NAV ต่อหน่วยปรับตัวลดลง ค่า Maximum Drawdown เป็นข้อมูลที่ช่วยให้ทราบถึงความเสี่ยงที่อาจจะขาดทุน จากการลงทุนในกองทุนรวม
- **Recovering Period:** ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาดังแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่เงินลงทุนเริ่มต้นใช้เวลานานเท่าใด
- **FX Hedging:** เพอร์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน
- **อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน:** ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตกองทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลาหนึ่ง 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 ซึ่งเป็นผลจากประสิทธิภาพของผู้จัดการกองทุนในการคัดเลือกหรือหาจังหวะการลงทุนในหลักทรัพย์ได้อย่างเหมาะสม
- **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 โดยใช้ตัวอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมตราสารหนี้ คำนวณจากค่าเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักของ Yield to Maturity ของตราสารหนี้แต่ละตัวที่กองทุนมีการลงทุน และเนื่องจาก Yield to Maturity มีหน่วยมาตรฐานเป็นเปอร์เซ็นต์ต่อปี จึงสามารถนำไปใช้เปรียบเทียบอัตราผลตอบแทนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีนโยบายถือครองตราสารหนี้จนครบกำหนดอายุและมีลักษณะการลงทุนที่ใกล้เคียงกันได้

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน เอ็มเอฟซี จำกัด (มหาชน)

เลขที่ 199 อาคารคอลลัมน์ทาวเวอร์ ชั้น จี และชั้น 21-23

ถนนรัชดาภิเษก เขตคลองเตย กรุงเทพฯ 10110

โทรศัพท์: 0-2649-2000 www.mfcfund.com