

กองทุนเปิด แอสเซทพลัส เลกาซี ห้ามขายผู้ลงทุนรายย่อย

Asset Plus Legacy Fund Not for Retail Investors (ASP-LEGACY-UI)

ประเภทกองทุนรวม/กลุ่มกองทุนรวม

ประเภทกองทุนรวม : กองทุนรวมตราสารทุน/Feeder Fund/กองทุนเน้นลงทุนแบบมีความเสี่ยงต่างประเทศ

กลุ่มกองทุนรวม : Miscellaneous

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- ลงทุนในกองทุน Wellspring GBL Fund (กองทุนหลัก) Class B Shares ซึ่งจัดตั้งภายใต้กฎหมายของหมู่เกาะเคย์แมน และบริหารจัดการโดย Quantum GBL, LLC กองทุนหลักมีนโยบายการลงทุนในกองทุน Renaissance Institutional Equities Fund International L.P., Series B (กองทุนอ้างอิง) ซึ่งกองทุนอ้างอิงจัดตั้งภายใต้กฎหมายประเทศบอร์เนียวและบริหารจัดการโดย Renaissance Technologies LLC เป็นกองทุนรวมประเภทเอ็ดจฟันด์ โดยมีการใช้ตราสารอนุพันธ์เป็นส่วนหนึ่งในกลยุทธ์การลงทุน
- กองทุนหลักมีนโยบายการทำธุรกรรมการกู้ยืมเงินเพื่อประโยชน์การจัดการลงทุนไม่เกินร้อยละ 25 ของ NAV ส่วนกองทุนอ้างอิงจะทำการธุรกรรมการขายหลักทรัพย์ที่ต้องยื่นมาเพื่อการส่งมอบ (short sell) โดยมีเป้าหมายอยู่ที่ประมาณ 75% ของ NAV ในสภาวะปกติกองทุนอ้างอิงจะไม่ลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้าหากเกิดเหตุการณ์ไม่ปกติ กองทุนอาจลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเพื่อลดความเสี่ยงที่อาจเกิดขึ้นภายใต้เหตุการณ์ไม่ปกติ
- กองทุนไทยอาจลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเพื่อเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน EPM ซึ่งรวมถึงการป้องกันความเสี่ยงที่มีอยู่จากการลงทุน
- กองทุนมุ่งหวังให้ผลตอบแทนเคลื่อนไหวตามกองทุนหลัก ส่วนกองทุนอ้างอิงที่กองทุนหลักลงทุนมีเป้าหมายในการสร้างผลตอบแทนในระยะยาวที่ดีกว่าตลาดและนำเสนอผลตอบแทนต่อความเสี่ยง (Risk-Adjusted Return) ที่ดีที่สุดผ่านการลงทุนในหุ้นที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ในสหรัฐอเมริกา



ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน : 19 มิ.ย. 62

วันเริ่มต้น class : -

นโยบายการจ่ายเงินปันผล : ไม่จ่าย

อายุกองทุน : ไม่กำหนด

ผู้จัดการกองทุน

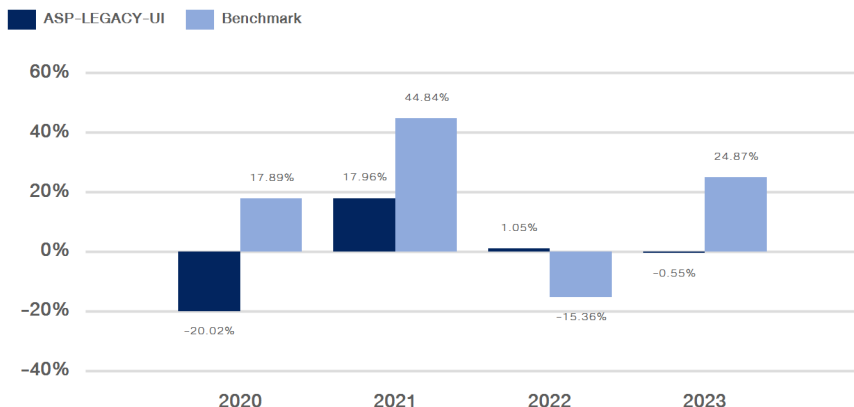
นาย คมสัน วัฒนสุนธิ์ (ตั้งแต่ 31 พ.ค. 67)

น.ส. ศศิบุษ ลัทธพิพัฒน์ (ตั้งแต่ 19 มิ.ย. 62)

ดัชนีชี้วัด

ดัชนี S&P 500 Total Return ในสัดส่วน 100% ปรับด้วยต้นทุนการป้องกันความเสี่ยงด้านอัตราแลกเปลี่ยนเพื่อคำนวณผลตอบแทนเป็นสกุลเงินบาท ณ วันที่ลงทุน

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (%ต่อปี)



ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบบิกแบด (%ต่อปี)

	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี
ASP-LEGACY-UI	16.02	1.07	7.50	16.02
ดัชนีชี้วัด	24.86	8.99	1.15	24.86
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	N/A	N/A	N/A	N/A
ความผันผวนกองทุน	20.38	8.68	17.91	20.38
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	15.02	15.43	16.52	15.02
	3 ปี	5 ปี	10 ปี	ตั้งแต่จัดตั้งกองทุน
ASP-LEGACY-UI	5.29	1.93	N/A	2.30
ดัชนีชี้วัด	9.74	17.67	N/A	17.57
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	N/A	N/A	N/A	N/A
ความผันผวนกองทุน	26.06	31.78	N/A	30.31
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	19.16	22.24	N/A	21.53

คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวมมิได้เป็นยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต : ได้รับการรับรองจาก CAC

จัดอันดับกองทุน Morningstar : -

"ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือบริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่องได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม"

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



www.assetfund.co.th

การซื้อขายหน่วยลงทุน

วันทำการซื้อ : วันทำการแรกของทุกเดือนโดยต้องส่งคำสั่งซื้อหน่วยลงทุนล่วงหน้า 9 วันทำการโดยไม่นับรวมวันหยุดกองทุน**

เวลาทำการ : ตั้งแต่เวลาเปิดทำการ - 15:00 น.

การซื้อขายครั้งแรกขั้นต่ำ : 100,000 บาท

การซื้อขายครั้งถัดไปขั้นต่ำ : 100,000 บาท

การขายคืนหน่วยลงทุน

วันทำการขายคืน : วันทำการสุดท้ายของทุกเดือน โดยจะส่งคำสั่งขายคืนหน่วยลงทุนล่วงหน้า 66 วันตามปฏิทิน***

เวลาทำการ : ตั้งแต่เวลาเปิดทำการ - 15:00 น.

การขายขายคืนขั้นต่ำ : 0 บาท

ยอดคงเหลือขั้นต่ำ : 0 บาท

ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน : T+12

หมายเหตุ: T+12 : ภายใน 12 วันทำการ นับถัดจากวันทำการขายคืนหน่วยลงทุน โดยไม่นับรวมวันหยุดทำการกองทุนต่างประเทศและประเทศที่เกี่ยวข้องกับการลงทุน ทั้งนี้ สามารถดูวันหยุดดังกล่าวได้ที่ www.assetfund.co.th

ข้อมูลเชิงสถิติ

Maximum Drawdown :	-27.49 %
Recovering Period :	3 ปี 5 เดือน 1 วัน
Fx Hedging :	92.45 %
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน :	0.05 เท่า
Sharpe Ratio :	0.12
Alpha :	-4.46 %
Beta :	0.08
Tracking Error :	43.85 %

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	2.00	1.00
รวมค่าใช้จ่าย	4.49	1.54

หมายเหตุ : - ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม หรือภาษีอื่นใด (ถ้ามี)
- อัตราที่เรียกเก็บจริงของรวมค่าใช้จ่ายเป็นข้อมูลตามรอบปีบัญชีล่าสุดของกองทุน

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การขาย	2.00	1.50
การรับซื้อคืน	2.00	0.00
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า	2.00	1.50
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก	2.00	0.00
การโอนหน่วย	50.00	50.00

หมายเหตุ : - ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม หรือภาษีอื่นใด (ถ้ามี)
- ค่าธรรมเนียมการโอนหน่วยคิดเป็น บาท/รายการ

ทั้งนี้ บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงจากกองทุนรวมและ/หรือจากผู้ถือหน่วยลงทุนเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน

	% NAV	ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก*	% NAV
หน่วยลงทุน	96.00	Wellspring GBL	96.00
เงินฝาก/ตั๋วแลกเงิน	2.08		
อื่นๆ	1.92		

หมายเหตุ:

Wellspring GBL : Wellspring GBL Fund Class B

**** วันทำการแรก**ของทุกเดือน เป็นวันทำการซื้อขายหน่วยลงทุนโดยบริษัทจัดการจะกำหนดตามวันทำการของกองทุน Wellspring GBL Fund (กองทุนหลัก) ทั้งนี้ ผู้ถือหน่วยลงทุนจะต้องส่งคำสั่งซื้อหน่วยลงทุนล่วงหน้า 9 วันทำการโดยไม่นับรวมวันหยุดของกองทุน พร้อมชำระเงินสดค่าซื้อหน่วยลงทุนล่วงหน้า ทั้งนี้ มูลค่าขึ้นต่ำของการสั่งซื้อครั้งแรกและครั้งถัดไปเป็นมูลค่าที่รวมค่าธรรมเนียมการขายหน่วยลงทุน (Front-end Fee) แล้ว

***** วันทำการสุดท้าย**ของทุกเดือน เป็นวันทำการขายคืนหน่วยลงทุน โดยบริษัทจัดการจะกำหนดตามวันทำการของกองทุน Wellspring GBL Fund (กองทุนหลัก) ทั้งนี้ ผู้ถือหน่วยลงทุนจะต้องส่งคำสั่งขายคืนหน่วยลงทุนล่วงหน้า 66 วันตามปฏิทิน หากวันส่งคำสั่งขายคืนหน่วยลงทุนตรงกับวันหยุดของกองทุน บริษัทจัดการเลื่อนเป็นวันทำการก่อนหน้า

ทั้งนี้ ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน ในปีที่จะดะเบียนกองทุนจะแสดงตั้งแต่วันที่จดทะเบียนกองทุนจนถึงสิ้นปีปฏิทิน

- กองทุน Wellspring GBL Fund (กองทุนหลัก) และ Renaissance Institutional Equities Fund International L.P., Series B (กองทุนอ้างอิง) ไม่เปิดเผยข้อมูลทรัพย์สินที่ลงทุนสูงสุด 5

อันดับแรก ท่านสามารถดู Fund Fact Sheet ของกองทุนหลักได้ที่ www.assetfund.co.th

การลงทุนในกองทุนอื่นเกินกว่า 20% (กองในประเทศและ/หรือกองต่างประเทศ)

Wellspring GBL Fund Class B	ISIN Code : None
	Bloomberg code : None

คำอธิบาย

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

Recovering Period ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาตั้งแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลานานเท่าใด

FX Hedging เปอร์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

อัตราส่วนหนี้สินการลงทุน 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 แสดงว่า หลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนน้อยกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด Beta มากกว่า 1 แสดงว่า หลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนมากกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด

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 มีหน่วยมาตรฐานเป็นเปอร์เซ็นต์ต่อปี จึงสามารถนำไปใช้เปรียบเทียบกับอัตราผลตอบแทนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีนโยบายถือครองตราสารหนี้จนครบกำหนดอายุและมีลักษณะการลงทุนที่ใกล้เคียงกันได้

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน แอสเซท พลัส จำกัด

ที่อยู่ : เลขที่ 175 อาคารสารรัชต์ถาวเวอร์ ชั้น 17 ถนนสารพัด แขวงทุ่งมหาเมฆ เขตสาทร กรุงเทพมหานคร 10120

โทรศัพท์ : 0-2672-1111, E-mail : customer@assetfund.co.th, Website : www.assetfund.co.th