

กองทุนเปิด แอสเซทพลัส หุ้นไทยขนาดกลางเล็ก

ชนิดเงินลงทุนเดิม

(ASP-THSME)

ชื่อย่อ class : ASP-THSME-T

ประเภทกองทุนรวม/กลุ่มกองทุนรวม

ประเภทกองทุนรวม : กองทุนรวมตราสารทุน/กองทุนรวมหุ้นระยะยาว (LTF)/กองทุนรวมไม่มีการลงทุนในต่างประเทศ

กลุ่มกองทุนรวม : Equity General

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- กองทุนมีนโยบายที่จะลงทุนในตราสารทุนและ/หรือหุ้นสามัญของบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยและ/หรือตลาดหลักทรัพย์ เอ็ม เอ ไอ ที่มีปัจจัยพื้นฐานดี และ/หรือมีแนวโน้มการเจริญเติบโตทางธุรกิจ โดยเน้นลงทุนในตราสารดังกล่าวของบริษัทยักษ์ใหญ่และขนาดเล็ก หรือสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) ที่อ้างอิงผลตอบแทนของหุ้นหรือกลุ่มหุ้นของบริษัทจดทะเบียนข้างต้น
- บริษัทขนาดกลางและขนาดเล็กสำหรับกองทุนนี้ ให้นิยามถึง บริษัทจดทะเบียนที่อยู่ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยและ/หรือตลาดหลักทรัพย์ เอ็ม เอ ไอ รวมถึงการจองซื้อหุ้นที่เสนอขายแก่ประชาชนทั่วไปเป็นครั้งแรก (IPO) ที่มี Market Cap ที่มีมูลค่าหลักทรัพย์ตามราคาตลาด (Market Capitalization) ไม่เกิน 80,000 ล้านบาท ณ วันที่ทำการก่อนหน้าวันที่กองทุนลงทุน
- กองทุนอาจลงทุนหรือมีไว้ในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) เพื่อเพิ่มประสิทธิภาพการลงทุน (Efficient Portfolio Management) ซึ่งรวมถึงการป้องกันความเสี่ยงที่มีอยู่จากการลงทุน
- กองทุนมุ่งหวังให้ผลตอบแทนสูงกว่าดัชนีชี้วัด (active management)



ลงทุนในตราสารทุนเป็นหลัก โดยเฉลี่ยในรอบปีไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน : 23 พ.ย. 60

วันเริ่มต้น class : 23 พ.ย. 60

นโยบายการจ่ายเงินปันผล : ไม่จ่าย

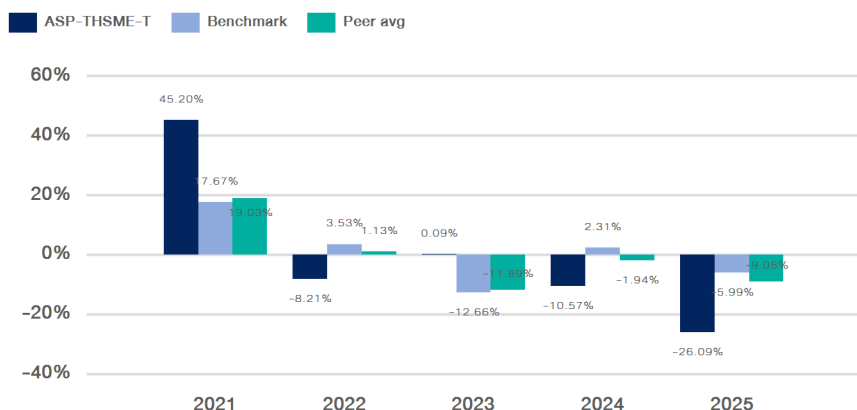
อายุกองทุน : ไม่กำหนด

ผู้จัดการกองทุน

น.ส. ทิพย์วดี อภิรักษ์ศิริ (ตั้งแต่ 23 พ.ย. 60)

ดัชนีชี้วัด

ดัชนีผลตอบแทนรวมตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET TRI) ในสัดส่วน 100%

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (%ต่อปี)

ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบบิกหมุด (%ต่อปี)

	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี
ASP-THSME-T	-26.09	-6.34	2.65	-26.09
ดัชนีชี้วัด	-5.99	-0.59	17.33	-5.99
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	-9.05	-1.12	12.54	-9.05
ความผันผวนกองทุน	16.56	12.19	14.55	16.56
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	17.77	14.18	15.05	17.77
	3 ปี	5 ปี	10 ปี	ตั้งแต่จัดตั้งกองทุน
ASP-THSME-T	-12.88	-2.50	N/A	-0.63
ดัชนีชี้วัด	-5.63	0.47	N/A	-0.55
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	-8.05	-1.33	N/A	N/A
ความผันผวนกองทุน	14.83	14.13	N/A	15.85
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	13.88	13.00	N/A	15.54

คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวมมิได้เป็นยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต : ได้รับการรับรองจาก CAC

จัดอันดับกองทุน Morningstar : -

"ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือบริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่องได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม"

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



www.assetfund.co.th

การซื้อขายหน่วยลงทุน

วันทำการซื้อ : ไม่สามารถซื้อหน่วยลงทุนได้ ตั้งแต่วันที่ 1 ม.ค. 2563 เป็นต้นไป

เวลาทำการ : ตั้งแต่เวลาเปิดทำการ - 15:30 น.

การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ : 5,000 บาท

การซื้อครั้งถัดไปขั้นต่ำ : 5,000 บาท

การขายคืนหน่วยลงทุน

วันทำการขายคืน : ทุกวันทำการ

เวลาทำการ : ตั้งแต่เวลาเปิดทำการ - 15:30 น.

การขายคืนขั้นต่ำ : 0 บาท

ยอดคงเหลือขั้นต่ำ : 0 บาท

ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน : T+5

หมายเหตุ : T+5 คือ ภายใน 5 วันทำการนับจากวันคำนวณ NAV (ปัจจุบัน T+3 วันทำการนับจากวันทำการขายคืนหน่วยลงทุน)

ข้อมูลเชิงสถิติ

Maximum Drawdown :	-45.25 %
Recovering Period :	-
Fx Hedging :	-
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน :	1.96 เท่า
Sharpe Ratio :	-0.94
Alpha :	-7.25 %
Beta :	0.83

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	1.99	1.61
รวมค่าใช้จ่าย	4.47	2.67

- หมายเหตุ : - ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม หรือภาษีอื่นใด (ถ้ามี)
- ค่าธรรมเนียมรวมค่าใช้จ่ายมีผลตั้งแต่วันที่ 31 ธ.ค. 68
- อัตราที่เรียกเก็บจริงของรวมค่าใช้จ่ายเป็นข้อมูลตามรอบปีบัญชีล่าสุดของกองทุนที่มีการเปิดเผยแล้ว

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การขาย	1.25	1.25
การรับซื้อคืน	ไม่มี	ไม่มี
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า	1.25	1.25
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก	ไม่มี	ไม่มี
การโอนหน่วย	50.00	50.00

- หมายเหตุ : - ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม หรือภาษีอื่นใด (ถ้ามี)
- ค่าธรรมเนียมการขายหน่วยลงทุน และค่าธรรมเนียมการสับเปลี่ยนเข้ามีผลตั้งแต่วันที่ 31 ธ.ค. 68
- ค่าธรรมเนียมการโอนหน่วยคิดเป็นบาท/รายการ
ทั้งนี้ บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงจากกองทุนรวมและ/หรือจากผู้ถือหน่วยลงทุนเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน

	% NAV		% NAV
ตราสารทุน	84.00	TCAP	7.58
เงินฝาก/ตั๋วแลกเงิน	15.26	KKP	7.08
อื่นๆ	0.74	TISCO	6.13
		NSL	6.06
		ADVICE	5.87

การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม 5 อันดับแรก

	% NAV
Banking	20.79
Food & Beverage	14.63
Finance & Securities	9.24
Energy & Utilities	7.49
Commerce	5.87

หมายเหตุ :

*TCAP : THANACHART CAPITAL PUBLIC COMPANY LIMITED, KKP : KIATNAKIN BANK PUBLIC COMPANY LIMITED, TISCO : TISCO FINANCIAL GROUP PUBLIC COMPANY LIMITED, NSL : NSL Foods Public Company Limited และ ADVICE : Advice IT Infinite Public Company Limited

คำอธิบาย

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

Recovering Period ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาดังแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินลงทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลานานเท่าใด

FX Hedging เพอร์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตกองทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลานึง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์กับผลรวมของมูลค่าการขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 1 ปีหารด้วยมูลค่า NAV ของกองทุนรวมเฉลี่ยในรอบระยะเวลาเดียวกัน กองทุนที่มีค่า portfolio turnover สูง บ่งชี้ถึงการซื้อขายหลักทรัพย์บ่อยครั้งของผู้จัดการกองทุนและทำให้มีต้นทุนการซื้อขายหลักทรัพย์ที่สูง จึงต้องพิจารณาเปรียบเทียบกับผลการดำเนินงานของกองทุนรวมเพื่อประเมินความคุ้มค่าของการซื้อขายหลักทรัพย์ดังกล่าว

Sharpe Ratio อัตราส่วนระหว่างผลตอบแทนส่วนเพิ่มของกองทุนรวมเปรียบเทียบกับความเสี่ยงจากการลงทุน โดยคำนวณจากผลต่างระหว่างอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมกับอัตราผลตอบแทนที่ปราศจากความเสี่ยง (risk-free rate) เปรียบเทียบกับค่าเบี่ยงเบนมาตรฐาน (standard deviation) ของกองทุนรวม ค่า Sharpe Ratio สะท้อนถึงอัตราผลตอบแทนที่กองทุนรวมควรได้รับเพิ่มขึ้นเพื่อชดเชยกับความเสี่ยงที่กองทุนรวมรับมา โดยกองทุนที่มีค่า Sharpe Ratio สูงกว่าจะเป็นกองทุนที่มีประสิทธิภาพในการบริหารจัดการการลงทุนที่ดีกว่า 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 กองทุนที่มีค่า 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 อาคารสารธรซีทีทาวเวอร์ ชั้น 17 ถนนสาทรใต้ แขวงทุ่งมหาเมฆ เขตสาทร กรุงเทพมหานคร 10120

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