

กองทุนเปิด BCAP SET100 ETF (BSET100)

ประเภทกองทุนรวม/ กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมตราสารทุน / กองทุนรวมอีทีเอฟ (Exchange Traded Fund) / กองทุนรวมที่ลงทุนแบบไม่มีความเสี่ยงต่างประเทศ
- กลุ่มกองทุน : Equity Large Cap

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- กองทุนจะใช้กลยุทธ์การบริหารกองทุนเชิงรับ (Passive Management Strategy) โดยมุ่งหวังให้ผลประกอบการเคลื่อนไหวตามดัชนีชี้วัด โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชี ไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน โดยลงทุนในหลักทรัพย์หรือสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) ที่มีสินทรัพย์อ้างอิงเป็นหลักทรัพย์ที่เป็นส่วนประกอบของดัชนี SET100 Total Return Index ซึ่งรวมถึงหลักทรัพย์ที่อยู่ระหว่างการเข้าหรือออกจากการเป็นหลักทรัพย์ที่เป็นส่วนประกอบของดัชนีอ้างอิงด้วย ซึ่งอาจพิจารณาเลือกใช้กลยุทธ์แบบ Full Replication หรือ Optimization
- กองทุนอาจลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) เพื่อเพิ่มประสิทธิภาพในการลงทุน (Efficient Portfolio Management)
- กลยุทธ์การลงทุน มุ่งหวังให้ผลประกอบการเคลื่อนไหวตามดัชนีชี้วัด (Passive Management/Index Tracking)

ระดับความเสี่ยง



เสี่ยงสูง

ลงทุนในตราสารทุนเป็นหลักโดยเฉลี่ยในรอบปีไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV

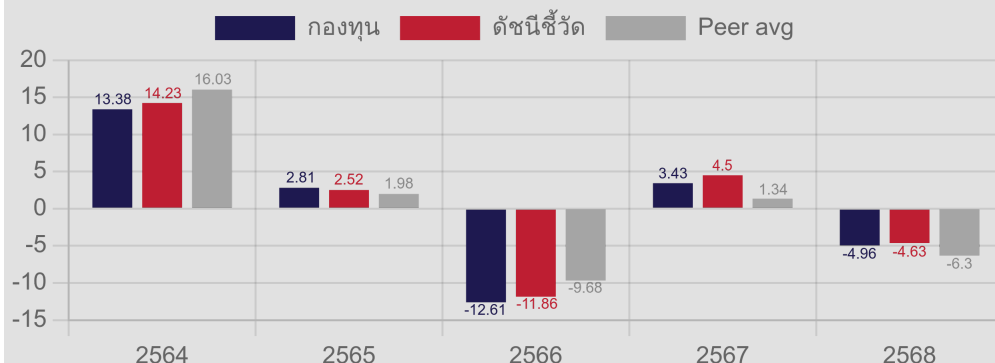
ข้อมูลกองทุนรวม

| | |
|--------------------------|-----------------|
| วันจดทะเบียนกองทุน | 06 กันยายน 2560 |
| นโยบายการจ่ายเงินปันผล | จ่าย |
| อายุกองทุน | ไม่กำหนด |
| การป้องกันความเสี่ยง FX | - |
| การเรียกเก็บค่าธรรมเนียม | ไม่มี |
| ตามผลการดำเนินงาน | |

ผู้จัดการกองทุน

นายเมธี เมฆอรุณเรือง (ตั้งแต่วันที่ 20 พ.ย. 2560)

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (% ต่อปี)



หมายเหตุ : ในปีที่กองทุนจดทะเบียนทรัพย์สิน หากกองทุนมีผลการดำเนินงานไม่ครบ 1 ปีปฏิทิน จะแสดงผลการดำเนินงานของปีปฏิทินแรกตั้งแต่วันที่กองทุนจดทะเบียนทรัพย์สินจนถึงวันทำการสุดท้ายของปีปฏิทิน

ดัชนีชี้วัด

ดัชนีผลตอบแทนรวม SET 100 (SET100 TRI) 100.00%

วัตถุประสงค์การอ้างอิง เพื่อใช้เปรียบเทียบกับผลการดำเนินงานของกองทุนรวม

ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด (%ต่อปี)

| | YTD | 3 เดือน | 6 เดือน | 1 ปี |
|--------------------------|-------|---------|---------|-------|
| กองทุน | 22.73 | 24.63 | 27.57 | 36.74 |
| ดัชนีชี้วัด | 22.99 | 25.01 | 28.21 | 37.53 |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน | 20.11 | 22.04 | 23.28 | 27.17 |
| ความผันผวนกองทุน | 16.53 | 15.54 | 14.81 | 19.13 |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด | 16.59 | 15.61 | 14.90 | 19.16 |

| | 3 ปี | 5 ปี | 10 ปี | ตั้งแต่จัดตั้ง |
|--------------------------|-------|-------|-------|----------------|
| กองทุน | 2.99 | 3.49 | N/A | 1.63 |
| ดัชนีชี้วัด | 3.79 | 4.07 | N/A | 2.33 |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน | 1.92 | 2.76 | N/A | N/A |
| ความผันผวนกองทุน | 15.43 | 13.96 | N/A | 17.01 |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด | 15.47 | 14.00 | N/A | 17.05 |

คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวมมิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต : ได้รับการรับรองจาก CAC ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือ บริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่อง ได้ที่หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



การซื้อขายหน่วยลงทุน

วันทำการซื้อ/ขายคืน : ทุกวันทำการของตลาดหลักทรัพย์ฯ

- ผู้ร่วมค้ำหน่วยลงทุนสามารถสั่งซื้อ/ขายคืนหน่วยลงทุนได้ที่บริษัทจัดการได้ทุกวันทำการของตลาดหลักทรัพย์ฯ

- ผู้สนใจลงทุนทั่วไปสามารถสั่งซื้อ/ขายคืนหน่วยลงทุนโดยผ่านผู้ร่วมค้ำหน่วยลงทุนด้วยวิธีการส่ง/รับมอบ ต่กร้าหลักทรัพย์ ตามขั้นตอนและวิธีการรับซื้อคืนที่ผู้ร่วมค้ำหน่วยลงทุนกำหนด

- ผู้สนใจลงทุนทั่วไปและผู้ร่วมค้ำหน่วยลงทุนสามารถซื้อ/ขายคืนหน่วยลงทุนผ่านตลาดหลักทรัพย์ฯ โดยปฏิบัติตามกฎ ระเบียบ และวิธีปฏิบัติของตลาดหลักทรัพย์ฯ

มูลค่าขั้นต่ำในการซื้อครั้งแรก : เป็นไปตามที่ผู้ร่วมค้ำ

หน่วยลงทุน หรือตลาดหลักทรัพย์ฯกำหนด

มูลค่าขั้นต่ำในการซื้อครั้งถัดไป : เป็นไปตามที่ผู้ร่วม

ค้ำหน่วยลงทุน หรือตลาดหลักทรัพย์ฯกำหนด

จำนวนหน่วยลงทุนขั้นต่ำของการซื้อครั้งถัดไป :

สำหรับผู้ร่วมค้ำหน่วยลงทุน : 1 หน่วยของการซื้อขาย หน่วยของการซื้อขาย

(creation unit : CU) และเพิ่มขึ้นเป็นทวีคูณของ 1

หน่วยของการซื้อขาย

การขายหน่วยลงทุน

ยอดคงเหลือขั้นต่ำ : ไม่กำหนด

จำนวนหน่วยลงทุนขั้นต่ำของการขายคืน : สำหรับผู้

ร่วมค้ำหน่วยลงทุน : 1 หน่วยของการซื้อขาย

(creation unit : CU) และเพิ่มขึ้นเป็นทวีคูณของ 1

ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน : ภายใน 5 วันทำการ

นับตั้งแต่วันที่ถัดจากวันส่งคำสั่งขายคืนหน่วยลงทุน

โดยบริษัทจัดการจะชำระเป็นต่กร้าหลักทรัพย์ตาม

อัตราส่วนและรายละเอียดของหลักทรัพย์ที่บริษัท

จัดการกำหนด

ข้อมูลความเสี่ยงเชิงสถิติ

| | |
|----------------------------|-----------|
| Maximum drawdown | -31.84 % |
| Recovering Period | 10 เดือน |
| อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน | 0.15 เท่า |
| Sharpe Ratio | 0.06 |
| Alpha | -1.57 |
| Beta | 1.00 |
| Tracking Error | 0.31 % |
| Tracking Difference | -0.78 % |

การจัดสรรการลงทุนในต่างประเทศ

% NAV

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุน (% ต่อปีของ NAV)

ค่าธรรมเนียมต่อไปนี้จะส่งผลกระทบต่อผู้ถือหน่วย เนื่องจากจะทำให้ผลตอบแทนจากการลงทุนลดลง ดังนั้นผู้ลงทุนควรตรวจสอบทุกครั้งก่อนตัดสินใจลงทุน

| ค่าธรรมเนียม | สูงสุดไม่เกิน | เก็บจริง |
|--------------|---------------|----------|
| การจัดการ | 0.90% | 0.535% |

ค่าตอบแทนแก่ตัวแทนขายหน่วยลงทุน

ของกองทุนรวม (trailer fee): ไม่มี

| | | |
|---------------|-------|---------|
| รวมค่าใช้จ่าย | 3.21% | 0.6925% |
|---------------|-------|---------|

หมายเหตุ

- ค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายข้างต้นได้รวมภาษีมูลค่าเพิ่มและภาษีอื่นใดในตนเองเรียบร้อยแล้ว (ถ้ามี)

- ค่าใช้จ่ายข้างต้นเป็นอัตราตามรอบปีบัญชีปัจจุบัน ทั้งนี้ สามารถศึกษาข้อมูลเพิ่มเติมได้ที่หนังสือชี้ชวนส่วนข้อมูลกองทุนรวม

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วยลงทุน (% ต่อมูลค่าหน่วยลงทุน)

| ค่าธรรมเนียม | สูงสุดไม่เกิน | เก็บจริง |
|-----------------------------|---------------------------|----------------------|
| การขาย | 1.07% | ปัจจุบันไม่เรียกเก็บ |
| การรับซื้อคืน | 1.07% | ปัจจุบันไม่เรียกเก็บ |
| การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า | ไม่มี | ไม่มี |
| การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก | ไม่มี | ไม่มี |
| การโอน | ตามที่นายทะเบียนเรียกเก็บ | ปัจจุบันไม่เรียกเก็บ |

หมายเหตุ - ค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายข้างต้นได้รวมภาษีมูลค่าเพิ่มและภาษีอื่นใดในตนเองเรียบร้อยแล้ว (ถ้ามี) ทั้งนี้สามารถศึกษาข้อมูลเพิ่มเติมได้ที่หนังสือชี้ชวนส่วนข้อมูลกองทุนรวม

การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม**5 อันดับแรก**

% NAV

| | |
|-------------------------------|-------|
| 1. เทคโนโลยี | 25.57 |
| 2. ทรัพยากร | 22.82 |
| 3. บริการ | 18.99 |
| 4. ธุรกิจการเงิน | 18.68 |
| 5. อสังหาริมทรัพย์และก่อสร้าง | 6.90 |

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน

% NAV

- หุ้นสามัญ
- เงินฝากธนาคาร

98.97
0.60

ทรัพย์สินที่ลงทุนสูงสุด 5 อันดับแรก

% NAV

- บริษัท เดลต้า อีเลคโทรนิคส์ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) (DELTA)
- บริษัท แอดวานซ์ อินโฟร์ เซอร์วิส จำกัด (มหาชน) (ADVANC)
- บริษัท ปตท. จำกัด (มหาชน) (PTT)
- บริษัท กัลฟ์ เอ็นเนอร์จี ดีเวลลอปเมนท์ จำกัด (มหาชน) (GULF)
- บริษัท ท่าอากาศยานไทย จำกัด (มหาชน) (AOT)

อันดับความน่าเชื่อถือของตราสารหนี้ (%)

-

คำอธิบาย

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

Recovering Period ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาตั้งแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่เงินลงทุนเริ่มต้นใช้เวลานานเท่าใด

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตกองทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลานึง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อหลักหลักทรัพย์กับผลรวมของมูลค่าการขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 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 แสดงว่า หลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนมากกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด

Tracking Error อัตราผลตอบแทนของกองทุนมีประสิทธิภาพในการเลียนแบบดัชนีชี้วัด โดยหาก tracking error ต่ำ หมายถึงกองทุนรวมมีประสิทธิภาพในการสร้างผลตอบแทนให้ใกล้เคียงกับดัชนีชี้วัด กองทุนรวมที่มีค่า tracking error สูง จะมีอัตราผลตอบแทนโดยเฉลี่ยห่างจากดัชนีชี้วัดมากขึ้น

Tracking Difference (TD) ค่าส่วนต่างระหว่างผลตอบแทนเฉลี่ยของกองทุนรวมและผลตอบแทนของดัชนีอ้างอิงของกองทุน

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน บางกอกแคปปิตอล จำกัด

โทรศัพท์ : 0-2618-1599 website : www.bcap.co.th

ที่อยู่ 191 อาคารสีลมคอมเพล็กซ์ ชั้น 24 ห้องเลขที่ A-C ถนนสีลม แขวงสีลม เขตบางรัก กรุงเทพฯ 10500