

## กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ หุ้นญี่ปุ่น แอคทีฟ

### ชนิดเพื่อการออม SCBJAPAN(SSF)

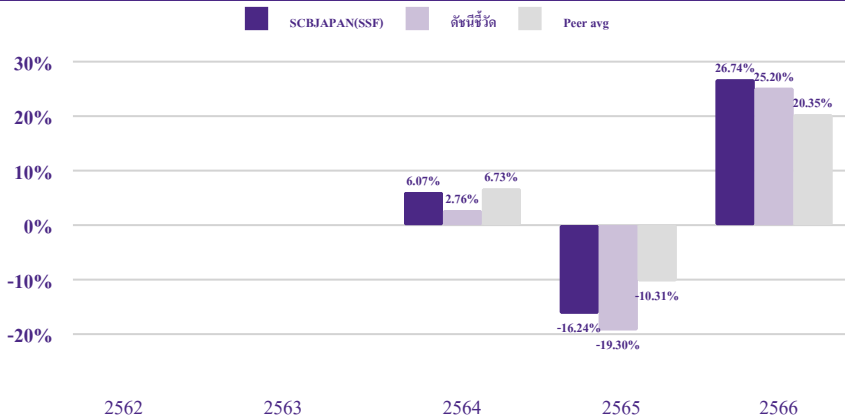
#### ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- ประเภทกองทุนรวม: กองทุนรวมตราสารทุน/กองทุนรวมที่มีนโยบายเปิดให้มีการลงทุนในกองทุนรวมอื่นภายใต้ บลจ. เดียวกัน/กองทุนรวมฟีดเดอร์ (Feeder Fund)/กองทุนรวมเพื่อการออม (SSF)/กองทุนรวมที่เน้นลงทุนแบบมีความเสี่ยงต่างประเทศ
- กลุ่มกองทุนรวม: Japan Equity

#### นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- เน้นลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมต่างประเทศเพียงกองทุนเดียว (Feeder Fund) ได้แก่ Goldman Sachs Japan Equity Partners Portfolio (กองทุนหลัก) Class I Shares (Acc.) สกุลเงินเยน (JPY) กองทุนหลักลงทุนอย่างน้อย 2 ใน 3 ของ NAV ในตราสารทุนหรือตราสารทุนที่เกี่ยวข้องกับหลักทรัพย์ที่สามารถเปลี่ยนมือได้ (Transferable Securities) และกองทุน ซึ่งมีการลงทุนในบริษัทจดทะเบียนในประเทศญี่ปุ่นหรือบริษัทที่มีรายได้จากประเทศญี่ปุ่น โดยทั่วไปกองทุนหลักจะลงทุนในบริษัท 25-40 แห่ง
- กองทุนอาจลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวม หรือกองทุนรวมอสังหาริมทรัพย์ (กอง 1) หรือทรัสต์เพื่อการลงทุนในอสังหาริมทรัพย์ (REITs) หรือกองทุนรวมโครงสร้างพื้นฐาน (infra) ซึ่งอยู่ภายใต้การจัดการของบริษัทจัดการในสัดส่วนไม่เกิน 20% ของ NAV
- ชื่อ บลจ.ที่บริหารจัดการกองทุนหลัก: Goldman Sachs Asset Management B.V.
- กองทุนอาจลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) เพื่อเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน (Efficient portfolio management) และ/หรือการบริหารความเสี่ยง โดยป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน (Hedging) ตามดุลยพินิจของผู้จัดการกองทุน
- กลยุทธ์ในการบริหารกองทุนรวม: กองทุนไทยมุ่งหวังให้ผลประกอบการเคลื่อนไหวตามกองทุนหลัก ส่วนกองทุนหลักมุ่งหวังให้ผลประกอบการสูงกว่าดัชนีชี้วัด (Active Management)

#### ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (% ต่อปี)



หมายเหตุ: ในปีที่กองทุนจดทะเบียน ผลการดำเนินงานจะแสดงตั้งแต่วันที่จดทะเบียนกองทุนจนถึงสิ้นปีปฏิทิน

#### ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปีกลุ่ม

|                                       | YTD   | 3 เดือน | 6 เดือน | 1 ปี <sup>1</sup> | 3 ปี <sup>1</sup> | 5 ปี <sup>1</sup> | 10 ปี <sup>1</sup> | ตั้งแต่จัดตั้ง <sup>1</sup> |
|---------------------------------------|-------|---------|---------|-------------------|-------------------|-------------------|--------------------|-----------------------------|
| SCBJAPAN(SSF)                         | 14.54 | -0.01   | 3.89    | 24.69             | 7.66              | N/A               | N/A                | 8.68                        |
| ดัชนีชี้วัด                           | 13.03 | -1.73   | 2.84    | 24.34             | 5.35              | N/A               | N/A                | 5.37                        |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน <sup>2</sup> | 11.77 | -2.22   | 0.46    | 19.64             | 5.60              | N/A               | N/A                | N/A                         |
| ความผันผวนของกองทุน                   | 19.73 | 15.99   | 17.31   | 20.83             | 19.01             | N/A               | N/A                | 18.98                       |
| ความผันผวนของดัชนีชี้วัด              | 18.97 | 15.08   | 16.37   | 20.07             | 18.88             | N/A               | N/A                | 18.88                       |

หมายเหตุ: <sup>1</sup> ต่อปี

<sup>2</sup> ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน ตามการจัดกลุ่มกองทุนรวมของ AIMC category

#### ระดับความเสี่ยง



ลงทุนในตราสารทุนเป็นหลัก โดยเฉลี่ยในรอบปีไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV

#### ข้อมูลกองทุนรวม

|                           |                     |
|---------------------------|---------------------|
| วันจดทะเบียนกองทุน        | 12 ตุลาคม 2564      |
| วันเริ่มต้น Class         | 12 ตุลาคม 2564      |
| นโยบายการจ่ายเงินปันผล    | จ่าย                |
| อายุกองทุน                | ไม่กำหนดอายุโครงการ |
| ผู้จัดการกองทุนรวม        |                     |
| นายจักษ์ ณ เชียงใหม่      | 9 เมษายน 2566       |
| น.ส.นริศรา คณรัตน์สกุลชัย | 2 พฤศจิกายน 2564    |

#### ดัชนีชี้วัด

ผลการดำเนินงานของกองทุนรวมหลัก 100% ปรับด้วยต้นทุนการป้องกันความเสี่ยงอัตราแลกเปลี่ยนเพื่อคำนวณผลตอบแทนเป็นสกุลเงินบาท ณ วันที่ลงทุน (ในอัตราส่วน 50%) และปรับด้วยอัตราแลกเปลี่ยนเพื่อเทียบกับค่าสกุลเงินบาท ณ วันที่คำนวณผลตอบแทน (ในอัตราส่วน 50%)

#### คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวม ไม่ได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

#### การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต

ได้รับการรับรองจาก CAC

#### การจัดอันดับกองทุน Morningstar

Overall Rating 4 ดาว จาก Morningstar ประเภท Japan Equity, ณ 31 ต.ค. 2567



| การซื้อขายหน่วยลงทุน  | การขายคืนหน่วยลงทุน  |
|---|--|
| วันทำการซื้อ: ทุกวันทำการ                                   | วันทำการขายคืน: ทุกวันทำการ  |
| เวลาทำการ: เปิดทำการ ถึง 15.30 น. SCB EASY APP ถึง 16.00 น. | เวลาทำการ: เปิดทำการ ถึง 15.30 น. SCB EASY APP ถึง 16.00 น.  |
| มูลค่าขั้นต่ำในการซื้อขายครั้งแรก: 1,000 บาท                | มูลค่าขั้นต่ำในการขายคืน: ไม่กำหนด   |
| มูลค่าขั้นต่ำในการซื้อขายครั้งถัดไป: 1,000 บาท              | ยอดคงเหลือขั้นต่ำ: ไม่กำหนด  |
|   | ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน: T+4 คือ วันทำการ หลังจากวันทำการขายคืน  |
|   | (ขอสงวนสิทธิ์เปลี่ยนแปลงระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืนจริงซึ่งอาจเร็วขึ้นหรือช้าลงกว่าเดิมได้ ทั้งนี้ ไม่เกิน 6 วันทำการนับจากวันทำการขายคืน) |

หมายเหตุ: ผู้ถือหน่วยลงทุนสามารถชำระเงินค่าซื้อหน่วยลงทุนผ่านบัตรเครดิตของธนาคารไทยพาณิชย์ จำกัด (มหาชน) และบริษัท คาร์ด เอกซ์ จำกัด หรือผู้ให้บริการบัตรเครดิตอื่นใด ซึ่งเป็นไปตามหลักเกณฑ์และเงื่อนไขที่บริษัทจัดการกำหนดได้

| ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% คอปีของ NAV รวม VAT) |               |          |
|--|---------------|----------|
| ค่าธรรมเนียม   | สูงสุดไม่เกิน | เก็บจริง |
| การจัดการ  | 2.68          | 1.07     |
| รวมค่าใช้จ่าย  | 3.21          | 1.19     |

หมายเหตุ: - บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ

| ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย รวม VAT) |                        |                        |
|---|------------------------|------------------------|
| ค่าธรรมเนียม  | สูงสุดไม่เกิน          | เก็บจริง               |
| การขาย  | 3.21                   | ยกเว้นไม่เรียกเก็บ     |
| การรับซื้อคืน   | 3.21                   | ยกเว้นไม่เรียกเก็บ     |
| การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า   | 3.21                   | ยกเว้นไม่เรียกเก็บ     |
| การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก  | 3.21                   | ยกเว้นไม่เรียกเก็บ     |
| การโอนหน่วย   | 10 บาท ต่อ 1,000 หน่วย | 10 บาท ต่อ 1,000 หน่วย |

หมายเหตุ: - บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ

- ค่าใช้จ่ายในการซื้อขายหลักทรัพย์ เมื่อสั่งซื้อ/ส่งขาย/สับเปลี่ยนหน่วยลงทุน ไม่เกินร้อยละ 0.75 ของมูลค่าหน่วยลงทุน (ยกเว้นไม่เรียกเก็บ)

- บริษัทจัดการยังไม่เปิดให้ทำรายการโอนหน่วยลงทุนได้ ทั้งนี้ เพื่อให้เป็นไปตามเงื่อนไขการลงทุนในกองทุนรวมเพื่อการออม

| สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน |       | ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก                            |       |
|--------------------------------|-------|--|-------|
| ประเภททรัพย์สิน                | % NAV | ชื่อทรัพย์สิน  | % NAV |
| หน่วยลงทุน                     | 98.01 | หน่วยลงทุน GOLDMAN SACHS JAPAN EQUITY PARTNERS PORTFOLIO | 98.01 |
| เงินฝาก                        | 2.68  |  |       |
| ตราสารอนุพันธ์                 | 1.75  |  |       |
| อื่น ๆ                         | -2.45 |  |       |

| ข้อมูลเชิงสถิติ            |           |
|----------------------------|-----------|
| Maximum Drawdown           | -24.30%   |
| Recovering Period          | 1 ปี      |
| FX Hedging                 | 78.85%    |
| อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน | 2.03 เท่า |
| Sharpe ratio               | 0.37      |
| Alpha                      | 2.20%     |
| Beta                       | 0.95      |
| Tracking Error             | -         |

| ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรกของกองทุนหลัก |       |
|--|-------|
| ชื่อทรัพย์สิน                              | % NAV |
| Hitachi Ltd                                | 6.50  |
| Sony Group Corp                            | 5.40  |
| Shin-Etsu Chemical Co Ltd                  | 4.60  |
| Tokio Marine Holdings Inc                  | 4.60  |
| Fast Retailing Co Ltd                      | 4.40  |

| การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรมของกองทุนหลัก |       |
|---|-------|
| กลุ่มอุตสาหกรรม (Sector)                        | % NAV |
| Consumer Discretionary                          | 23.20 |
| Information Technology                          | 18.10 |
| Industrials                                     | 17.20 |
| Health Care                                     | 11.70 |
| Financials                                      | 11.70 |
| อื่น ๆ  | 14.90 |

หมายเหตุ: ข้อมูลกองทุนหลักเป็นข้อมูล ณ วันที่ 30 กันยายน 2567

การลงทุนในกองทุนรวมอื่นเกินกว่า 20% ของ NAV

ชื่อกองทุน: GOLDMAN SACHS JAPAN EQUITY PARTNERS PORTFOLIO

ISIN code: LU1217871059

Bloomberg code: GSJEPIJ LX

## คำอธิบาย

**Maximum Drawdown** เปรอ์เซ็นต์ผลขาดทุนสูงสุดของกองทุนรวมในระยะเวลา 5 ปีย้อนหลัง (หรือตั้งแต่จัดตั้งกองทุนกรณีที่ยังไม่ครบ 5 ปี) โดยวัดจากระดับ NAV ต่อหน่วยที่จุดสูงสุด ไปจนถึงจุดต่ำสุดในช่วงที่ NAV ต่อหน่วยปรับตัวลดลง ค่า Maximum Drawdown เป็นข้อมูลที่ช่วยให้ทราบถึงความเสี่ยงที่อาจจะขาดทุนจากการลงทุนในกองทุนรวม

**Recovering Period** ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาดังแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่เงินลงทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลานานเท่าใด

**FX Hedging** เปรอ์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

**อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน (Portfolio Turnover)** ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตของกองทุนรวมในช่วงเวลาใดช่วงเวลานึง 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 สูงกว่าจะเป็นกองทุนรวมที่มีประสิทธิภาพในการบริหารจัดการลงทุนที่ดีกว่า เนื่องจากได้รับผลตอบแทนส่วนเพิ่มที่สูงกว่าภายใต้ระดับความเสี่ยงเดียวกัน

**Alpha** ผลตอบแทนส่วนเกินของกองทุนรวมเมื่อเปรียบเทียบกับดัชนีชี้วัด (benchmark) โดยค่า Alpha ที่สูง หมายถึง กองทุนรวมสามารถสร้างผลตอบแทนได้สูงกว่าดัชนีชี้วัด ซึ่งเป็นผลจากประสิทธิภาพของผู้จัดการกองทุนรวมในการคัดเลือกหรือหาจังหวะเข้าลงทุนในหลักทรัพย์ได้อย่างเหมาะสม

**Beta** ระดับและทิศทางการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุน โดยเปรียบเทียบกับอัตราการเปลี่ยนแปลงของตลาด Beta น้อยกว่า 1 แสดงว่า หลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนน้อยกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด Beta มากกว่า 1 แสดงว่า หลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนมากกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด

**Tracking Error** อัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมมีประสิทธิภาพในการเลียนแบบดัชนีชี้วัด โดยหาก Tracking Error ต่ำ หมายถึงกองทุนรวมมีประสิทธิภาพในการสร้างผลตอบแทนให้ใกล้เคียงกับดัชนีชี้วัด กองทุนรวมที่มีค่า Tracking Error สูง จะมีอัตราผลตอบแทนโดยเฉลี่ยห่างจากดัชนีชี้วัดมากขึ้น

**Yield to Maturity** อัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในตราสารหนี้โดยถือจนครบกำหนดอายุ ซึ่งคำนวณจากดอกเบี้ยที่จะได้รับในอนาคตตลอดอายุตราสารและเงินต้นที่จะได้รับคืนนำมาคิดลดเป็นมูลค่าปัจจุบัน โดยใช้ตัวอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมตราสารหนี้ คำนวณจากค่าเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักของ Yield to Maturity ของตราสารหนี้แต่ละตัวที่กองทุนรวมมีการลงทุน และเนื่องจาก Yield to Maturity มีหน่วยมาตรฐานเป็นเปอร์เซ็นต์ต่อปี จึงสามารถนำไปใช้เปรียบเทียบอัตราผลตอบแทนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีนโยบายถือครองตราสารหนี้จนครบกำหนดอายุและมีลักษณะการลงทุนที่ใกล้เคียงกันได้

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด

โทรศัพท์ : 0-2949-1500 หรือ 0-2777-7777 website: www.scbam.com

ที่อยู่ : ชั้น 7 – 8 อาคาร 1 ไทยพาณิชย์ ปาร์ค พลาซ่า เลขที่ 18 ถนนรัชดาภิเษก

แขวงจตุจักร เขตจตุจักร กรุงเทพฯ 10900