

## กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Machine Learning Thai Equity

### ชนิดเพื่อการออมผ่านช่องทางอิเล็กทรอนิกส์ SCBMLT(SSFE)

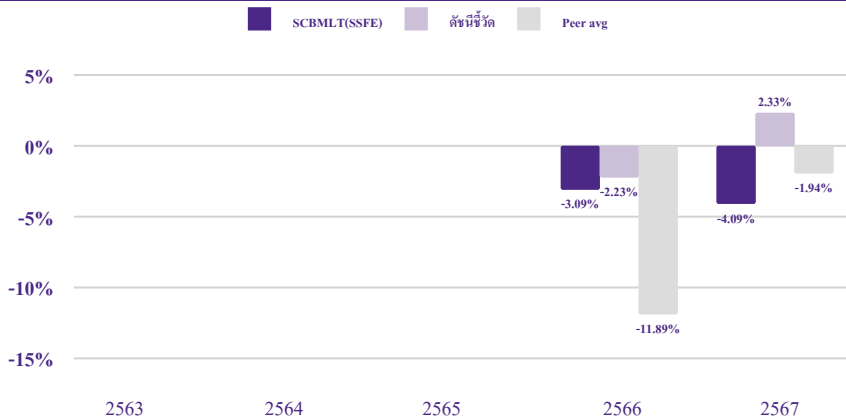
#### ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- ประเภทกองทุนรวม: กองทุนรวมตราสารทุน/กองทุนรวมที่มีนโยบายเปิดให้มีการลงทุนในกองทุนรวมอื่นภายใต้ บลจ. เดียวกัน/กองทุนรวมเพื่อการออม (SSF)/กองทุนรวมที่ลงทุนแบบไม่มีความเสี่ยงต่างประเทศ
- กลุ่มกองทุนรวม: Equity General

#### นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- ลงทุนในตราสารทุนของบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย ตลาดหลักทรัพย์ เอ็ม เอ ไอ โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV โดยใช้การวิเคราะห์เชิงปริมาณ (Quantitative Analysis) ใช้เทคนิคทาง Machine Learning มาประกอบการคัดเลือกหลักทรัพย์ในการลงทุนผ่านระบบที่พัฒนาขึ้นโดยบริษัทจัดการ
- กองทุนอาจลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวม หรือกองทุนรวมอสังหาริมทรัพย์ (กอง1) หรือทรัสต์เพื่อการลงทุนในอสังหาริมทรัพย์ (REITs) หรือกองทุนรวมโครงสร้างพื้นฐาน (infra) ซึ่งอยู่ภายใต้การจัดการของบริษัทจัดการ ในสัดส่วนไม่เกินร้อยละ 100 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน
- กองทุนอาจลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) เพื่อเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน (Efficient Portfolio Management) และ/หรือการบริหารความเสี่ยง
- กลยุทธ์ในการบริหารกองทุนรวม: มุ่งหวังให้ผลประกอบการสูงกว่าดัชนีชี้วัด (active management) โดยใช้การวิเคราะห์เชิงปริมาณ (Quantitative analysis) โดยแยกเป็นกลุ่มปัจจัยที่คาดว่าจะมีผลต่อราคาหุ้น และใช้โมเดลคำนวณให้น้ำหนักเพิ่มแก่ปัจจัยที่คาดว่าจะให้ผลตอบแทนเหนือตลาด หรือลดน้ำหนักปัจจัยที่คาดว่าจะให้ผลตอบแทนต่ำกว่าตลาด ซึ่งโมเดลนี้จะพิจารณาจากหลายๆ ตัวแปร เช่นค่าความสัมพันธ์ของผลตอบแทนของแต่ละกลุ่มปัจจัย, สภาวะตลาด, สภาวะความเสี่ยง, ตัวเลขทางเศรษฐกิจ หรือตัวแปรอื่นๆ ที่คาดว่าจะเกี่ยวข้อง

#### ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (% ต่อปี)



หมายเหตุ: ในปีที่กองทุนจดทะเบียน ผลการดำเนินงานจะแสดงตั้งแต่วันที่จดทะเบียนกองทุนจนถึงสิ้นปีปฏิทิน

#### ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปีกลม

	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>
SCBMLT(SSFE)	-4.09	-2.82	4.65	-4.09	N/A	N/A	N/A	-5.72
ดัชนีชี้วัด	2.33	-3.13	8.95	2.33	N/A	N/A	N/A	0.04
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน <sup>2</sup>	-1.94	-4.77	4.46	-1.94	N/A	N/A	N/A	N/A
ความผันผวนของกองทุน	10.24	5.46	8.02	10.24	N/A	N/A	N/A	10.77
ความผันผวนของดัชนีชี้วัด	11.26	5.57	8.56	11.26	N/A	N/A	N/A	11.63

หมายเหตุ: <sup>1</sup> % ต่อปี

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

#### ระดับความเสี่ยง

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

6 : เสี่ยงสูง

ลงทุนในตราสารทุนเป็นหลัก โดยเฉลี่ยในรอบปีไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV

#### ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน	6 ธันวาคม 2560
วันเริ่มต้น Class	5 ตุลาคม 2566
นโยบายการจ่ายเงินปันผล	จ่าย
อายุกองทุน	ไม่กำหนดอายุโครงการ

#### ผู้จัดการกองทุนรวม

นายทุนศักดิ์ โล่ห์สุนทร	6 ธันวาคม 2560
นายไพรัช นิตยานุภาพ	6 ธันวาคม 2560

#### ดัชนีชี้วัด

ดัชนีผลตอบแทนรวมตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET TR1) 100%

#### ค่าเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวม ไม่ได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

#### การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต

ได้รับการรับรองจาก CAC



การซื้อขายหน่วยลงทุน	การขายคืนหน่วยลงทุน
วันทำการซื้อ: ทุกวันทำการ	วันทำการขายคืน: ทุกวันทำการ
เวลาทำการ: เปิดทำการ ถึง 15.30 น	เวลาทำการ: เปิดทำการ ถึง 15.30 น.
มูลค่าขั้นต่ำในการซื้อขายครั้งแรก: 1 บาท	มูลค่าขั้นต่ำในการขายคืน: ไม่กำหนด
มูลค่าขั้นต่ำในการซื้อขายครั้งถัดไป: 1 บาท	ยอดคงเหลือขั้นต่ำ: ไม่กำหนด
	ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน: T+2 คือ 2 วันทำการ หลังจากวันทำการขายคืน
	(ขอสงวนสิทธิ์เปลี่ยนแปลงระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืนจริงซึ่งอาจเร็วขึ้นหรือช้าลงกว่าเดิมได้ ทั้งนี้ ไม่เกิน 5 วันทำการนับจากวันทำการขายคืน)

ข้อมูลเชิงสถิติ	
Maximum Drawdown	-14.52%
Recovering Period	N/A
FX Hedging	-
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน	2.55 เท่า
Sharpe ratio	-0.71
Alpha	-5.18%
Beta	0.90
Tracking Error	-

หมายเหตุ: - การลงทุนในกองทุนรวมเพื่อการออม (SSF) ตั้งแต่วันที่ 1 มกราคม 2568 เป็นต้นไป ผู้ลงทุนไม่สามารถนำลดหย่อนภาษีได้

- ซื้อขายหน่วยลงทุนผ่าน SCBAM Fund Click Application บริษัทจัดการอาจปฏิเสธคำสั่งซื้อและ/หรือคำสั่งรับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า หากมูลค่าหน่วยลงทุนคงเหลือ มูลค่าการสั่งซื้อหน่วยลงทุนสุทธิ และมูลค่าการรับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้าสุทธิของแต่ละบัญชีผู้ถือหน่วยลงทุนและ/หรือผู้ถือหน่วยลงทุนแต่ละราย ในทุกหน่วยลงทุนชนิดช่องทางอิเล็กทรอนิกส์ และทุกหน่วยลงทุนชนิดเพื่อสิทธิประโยชน์ทางภาษีผ่านช่องทางอิเล็กทรอนิกส์ \* เมื่อรวมกันทุกกองทุนภายใต้การบริหารจัดการของบริษัทจัดการแล้ว มีมูลค่ารวมกันมากกว่าหนึ่งล้านบาท (มูลค่ารวมทั้งหนึ่ง) ทั้งนี้ สำหรับหน่วยลงทุนชนิดช่องทางอิเล็กทรอนิกส์ของกองทุนรวมเพื่อสิทธิประโยชน์ทางภาษี\*\* และหน่วยลงทุนชนิดเพื่อสิทธิประโยชน์ทางภาษีผ่านช่องทางอิเล็กทรอนิกส์\*จะกำหนดมูลค่ารวมกันไม่เกินสามแสนบาท (มูลค่ารวมทั้งสอง) โดยมูลค่ารวมทั้งสองนับรวมอยู่ภายในมูลค่ารวมทั้งหนึ่ง \*หมายถึง ชนิดเพื่อการออมผ่านช่องทางอิเล็กทรอนิกส์ ชนิดไทยเพื่อความยั่งยืนผ่านช่องทางอิเล็กทรอนิกส์ และชนิดเพื่อสิทธิประโยชน์ทางภาษีผ่านช่องทางอิเล็กทรอนิกส์อื่นๆที่อาจมีขึ้นในอนาคต \*\*หมายถึง กองทุนรวมเพื่อการเลี้ยงชีพ และกองทุนรวมเพื่อสิทธิประโยชน์ทางภาษีอื่นๆที่อาจมีขึ้นในอนาคต

การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม	
กลุ่มอุตสาหกรรม (Sector)	% NAV
พลังงานและสาธารณูปโภค	11.93
ธนาคาร	11.81
เทคโนโลยีสารสนเทศและการสื่อสาร	8.36
พาณิชย์	7.07
ชิ้นส่วนอิเล็กทรอนิกส์	6.44
อื่นๆ	22.95

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV รวม VAT)		
ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	1.61	ยกเว้นไม่เรียกเก็บ
รวมค่าใช้จ่าย	2.14	0.11

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)

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน		ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก	
ประเภททรัพย์สิน	% NAV	ชื่อทรัพย์สิน	% NAV
หุ้น	65.72	พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยจกที่	7.25
พันธบัตรรัฐบาล / ธนาคารแห่งประเทศไทย / รัฐวิสาหกิจ	31.31	51/91/67	
เงินฝาก	3.53	พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยจกที่	6.68
อื่นๆ	-0.56	43/91/67	
		หุ้น บมจ.เดต้า อิเล็กทรอนิกส์ (ประเทศไทย)	5.57
		หุ้น บมจ.แอดวานซ์ อินโฟร์ เซอร์วิส	4.73
		หุ้น บมจ.ปตท.	4.24

## คำอธิบาย

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

**Recovering Period** ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาดังแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่เงินต้นเริ่มคืนใช้ระยะเวลาสั้นเท่าใด

**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