

กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Thai Equity Momentum Portfolio

ชนิดช่องทางอิเล็กทรอนิกส์
SCBMOMENTE

ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- ประเภทกองทุนรวม: กองทุนรวมตราสารทุน/กองทุนรวมที่มีเนื้อหาอย่างเป็นไปได้ว่าการลงทุนในกองทุนรวมอื่นภายใต้บลจ. เดียววัน/กองทุนรวมที่ลงทุนแบบไม่มีความเสี่ยงต่างประเทศ
- กลุ่มกองทุนรวม: Equity General

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- ลงทุนในตราสารทุนของบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย ตลาดหลักทรัพย์ เอ็ม เอ ไอ โดยเลือกเป็นรูปแบบที่มีผลตอบแทนสูงกว่า 80% ของ NAV ตราสารทุนที่ลงทุนจะมีลักษณะที่เน้นเป้าหมายแม่นยำ (Momentum Factor Investing) โดยใช้การวิเคราะห์เชิงปริมาณ (Quantitative Analysis) ซึ่งพิจารณาจาก Momentum Factor ต่าง ๆ ที่ได้มีการศึกษาและวิจัยในวงกว้างทั้งทางวิชาการและการลงทุน เช่น Returns, Sharpe Ratio หลักการในการคัดเลือกหุ้น คือ

1. วิเคราะห์หุ้นโดยพิจารณาจาก Momentum Factor ที่กล่าวมาข้างต้น

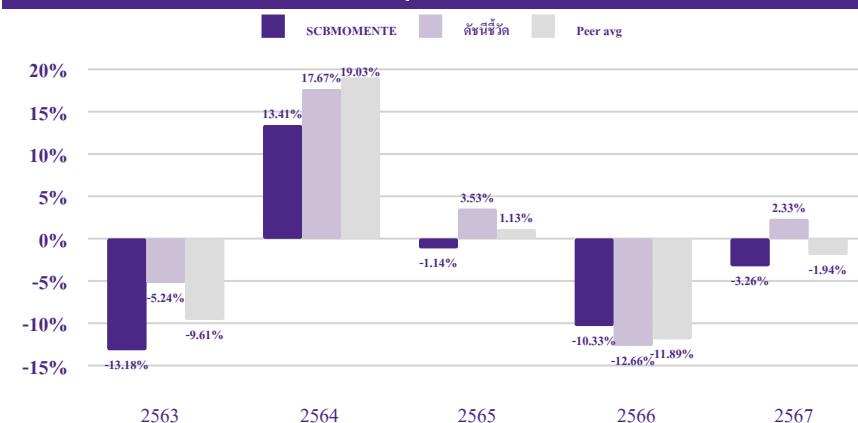
2. ให้ข้อมูลรายเดือนต่อเดือน โดยคำนวณคะแนนจาก Momentum Factor ต่างๆ

3. จากนั้นลงทุนในหุ้นที่มีคะแนนสูงสุด 25 ตัวแรก โดยใช้คะแนนคำนวณท่าน้ำหนักในการลงทุน โดยจะมีการ rebalance ทุก ๆ 1 เดือน เพื่อพิจารณาว่าตราสารทุนตั้งกล่าวข้างบนไปตามเป้าหมายข้างต้น กองทุนอาจลงทุนในหุ้นของกองทุนรวม หรือกองทุนรวมอสังหาริมทรัพย์ (กอง1) หรือหุ้นสต็อกที่ออก ลงทุนในอสังหาริมทรัพย์ (REITs) หรือกองทุนรวมโครงสร้างพื้นฐาน (infra) ซึ่งอยู่ภายใต้การจัดการของบริษัทจัดการในสัดส่วนไม่เกิน 100% ของ NAV

• กองทุนอาจลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) เพื่อเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน (Efficient Portfolio Management) และ/หรือการบริหารความเสี่ยง

• กลยุทธ์ในการบริหารกองทุนรวม: ผู้จัดการให้ผลประกอบการคลื่นไส้สูงกว่าดัชนีชี้วัด (Active Management)

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (%) ต่อปี)



หมายเหตุ: ให้ปีก่อของทุนจดทะเบียน ผลการดำเนินงานจะแสดงตั้งแต่วันที่จดทะเบียนกองทุนจนถึงล้านปีปฏิทิน

ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบบวกหนุน

	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี ¹	3 ปี ¹	5 ปี ¹	10 ปี ¹	ตั้งแต่ จัดตั้ง ¹
SCBMOMENTE	-11.66	-11.66	-12.94	-12.09	-8.26	1.18	N/A	-5.22
ดัชนีชี้วัด	-16.15	-16.15	-18.78	-12.79	-9.07	3.72	N/A	-2.58
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน ²	-14.08	-14.08	-18.17	-14.51	-9.81	2.06	N/A	N/A
ความผันผวนของกองทุน	7.71	7.71	10.48	14.06	12.74	15.14	N/A	18.55
ความผันผวนของดัชนีชี้วัด	8.42	8.42	10.13	13.36	11.92	13.81	N/A	16.88

หมายเหตุ: ¹% ต่อปี

²ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน ตามการจัดกลุ่มกองทุนรวมของ AIMC category

ระดับความเสี่ยง

ต่ำ 1 2 3 4 5 6 7 8 สูง
6 : เสี่ยงสูง

ลงทุนในตราสารทุนเป็นหลัก โดยผลลัพธ์ในรอบปีไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน	19 มีนาคม 2562
วันเริ่มต้น Class	25 มีนาคม 2562
นโยบายการจ่ายเงินปัจจุบัน	ไม่จ่าย
อายุกองทุน	ไม่กำหนดอายุโครงการ

ผู้จัดการกองทุนรวม

นายสติย์พงษ์ อันตรจริวงศ์	19 มีนาคม 2562
นายไพริชัน นิตยาภพ	19 มีนาคม 2562

ดัชนีชี้วัด

ดัชนีผลตอบแทนรวมตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET TRI) 100%

คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตดูของกองทุนรวม มิได้เป็นลักษณะที่ต้องการ คำแนะนำในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านพูนิชิต

ได้รับการรับรองจาก CAC

หนังสือชี้ชวนฉบับเดิม

ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือบริหารความเสี่ยง
ด้านสภาพคล่องได้ที่หนังสือชี้ชวนฉบับเดิม



www.scbam.com

การซื้อหุ้นทุน	การขายคืนหุ้นทุน	ข้อมูลเชิงสถิติ
วันทำการซื้อ: ทุกวันทำการ	วันทำการขายคืน: ทุกวันทำการ	Maximum Drawdown -25.54%
เวลาทำการ: เปิดทำการ อีง 15.30 น.	เวลาทำการ: เปิดทำการ อีง 15.30 น.	Recovering Peroid N/A
มูลค่าหุ้นต่อในการซื้อขายครั้งแรก: 1 บาท	มูลค่าหุ้นต่อในการขายคืน: 1 บาท	FX Hedging -
มูลค่าหุ้นต่อในการซื้อขายครั้งล่าสุดไป: 1 บาท	ยอดคงเหลือหุ้นต่อ: 1 บาท	อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน 3.25 เท่า
	ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน: T+2 คือ 2 วันทำการ หลังจากวันทำการขายคืน	Sharpe ratio -0.72
	(ขอสงวนสิทธิเปลี่ยนแปลงระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืนจริงซึ่งอาจเร็วขึ้นหรือช้าลงก่อนได้ ทั้งนี้ ไม่เกิน 5 วันทำการนับจากวันทำการขายคืน)	Alpha 0.02%
		Beta 0.87
		Tracking Error -

หมายเหตุ: ซื้อขายหุ้นทุนผ่าน SCBAM Fund Click Application

บริษัทจัดการอาจปฏิเสธคำสั่งซื้อและ/หรือคำสั่งสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า หากมูลค่าหุ้นทุนคงเหลือ มูลค่าการซื้อหุ้นทุนอยู่ต่ำกว่า 10% และมูลค่าการซื้อเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้าสูตรขั้นตอนแต่ละบัญชีผู้ถือหุ้นทุน และ/หรือผู้ถือหุ้นทุนแต่ละราย ในทุกหน่วยลงทุนชนิดของทางอิเล็กทรอนิกส์ และทุกหน่วยลงทุนชนิดเพื่อ ดูที่ชิปประจำบัญชีทั้งหมดที่ถูกต้องตามภาระที่ได้รับ บริหารจัดการของบริษัท จัดการแล้ว มีมูลค่ารวมทั้งหมดมากกว่าหนึ่งล้านบาท (มูลค่ารวมที่หนึ่ง) ทั้งนี้ สำหรับหน่วยลงทุนชนิดของทาง อิเล็กทรอนิกส์ของกองทุนรวมเพื่อท่องเที่ยวชิปประจำบัญชี** และหน่วยลงทุนชนิดเพื่อสิทธิชิปประจำบัญชีทั้งหมด ผ่านช่องทางอิเล็กทรอนิกส์*จะดำเนินดูแลร่วมกันไม่คินตามแผนบทบาท (มูลค่ารวมที่สอง) โดยมูลค่ารวมที่สอง นับรวมอยู่ภายใต้มูลค่ารวมที่หนึ่ง

*หมายเหตุ: ชนิดเพื่อการออมผ่านช่องทางอิเล็กทรอนิกส์ ชนิดไทยเพื่อความยั่งยืนผ่านช่องทางอิเล็กทรอนิกส์ และชนิดเพื่อสิทธิชิปประจำบัญชีทั้งหมดที่อ้างอิงที่มาในเอกสาร

**หมายเหตุ: กองทุนรวมเพื่อการเดินทาง แหล่งท่องเที่ยวและกองทุนรวมเพื่อสิทธิชิปประจำบัญชีอื่นๆที่อาจมีขึ้นในอนาคต

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV รวม VAT)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	2.68	ยกเว้นไม่เรียกเก็บ
รวมค่าใช้จ่าย	3.21	0.15

หมายเหตุ: - บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์ หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากหุ้นทุน (% ของมูลค่าซื้อขาย รวม VAT)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การขาย	3.21	ยกเว้นไม่เรียกเก็บ
การรับซื้อคืน	3.21	0.11
การซื้อเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า	3.21	ยกเว้นไม่เรียกเก็บ
การซื้อเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก	3.21	0.11
การโอนหน่วย	10 บาท ต่อ 1,000 หน่วย	10 บาท ต่อ 1,000 หน่วย

หมายเหตุ: - บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์ หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ

- ค่าใช้จ่ายในการซื้อขายหลักทรัพย์ เมื่อสั่งซื้อ/สั่งขาย/ซื้อเปลี่ยนหน่วยลงทุน ไม่เกินร้อยละ 0.75 ของมูลค่า หน่วยลงทุน (เก็บจริง 0.0535%)

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน	ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก		
ประเภททรัพย์สิน	% NAV	ชื่อทรัพย์สิน	% NAV
หุ้น	97.28	หุ้น บมจ.แอคเวย์ อินโนเฟร์ เชอร์วิส	9.25
เงินฝาก	2.05	หุ้น บมจ.อสชีนี เอกซ์	6.75
อื่นๆ	0.68	หุ้น บมจ.กรุ๊ปเปอร์เรชั่น	6.71
		หุ้น บมจ.กอลฟ์ เอ็นเนอร์จี ดีเวลลอปเม้นท์	6.60
		หุ้น บมจ.ธนาคารกรุงไทย	6.48

คำอธิบาย

Maximum Drawdown เปอร์เซ็นต์ผลขาดทุนสูงสุดของกองทุนรวมในระยะเวลา 5 ปีข้อนหลัง (หรือตั้งแต่จัดตั้งกองทุนครั้งที่ยังไม่ครบ 5 ปี) โดยวัดจากระดับ NAV ต่อหน่วยที่ขาดสูงสุด ไปจนถึงจุดค่าสูงในช่วงที่ NAV ต่อหน่วยปรับขึ้นลดลง ค่า Maximum Drawdown เป็นข้อมูลที่ช่วยให้ทราบถึงความเสี่ยงที่อาจจะขาดทุนจากการลงทุนในกองทุนรวม

Recovering Period ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาตั้งแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลานานเท่าไหร่

FX Hedging เปอร์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน (Portfolio Turnover) ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตของกองทุนรวมในช่วงเวลาใดช่วงเวลาหนึ่ง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อหลักทรัพย์กับผลรวมของมูลค่าการขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 1 ปีหารด้วยมูลค่า NAV ของกองทุนรวมเฉลี่ยในรอบระยะเวลาเดียวกัน กองทุนรวมที่มีค่า Portfolio Turnover สูง บ่งชี้ถึงการซื้อขายหลักทรัพย์ปอยครึ่งของผู้จัดการกองทุนและทำให้มีต้นทุนการซื้อขายหลักทรัพย์ที่สูง จึงต้องพิจารณาเบริกน์เทิร์นกับผลการดำเนินงานของกองทุนรวมเพื่อประเมินความเสี่ยงค่าของ การซื้อขายหลักทรัพย์ตั้งแต่ก้าว

Sharpe Ratio อัตราส่วนระหว่างผลตอบแทนส่วนเพิ่มของกองทุนรวมเบริกน์เทิร์นกับความเสี่ยงจากการลงทุน โดยคำนวณจากผลต่างระหว่างอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมกับอัตราผลตอบแทนที่ปราศจากความเสี่ยง (risk-free rate) เบริกน์เทิร์นค่าเบริกน์เทิร์นมาตรฐาน (standard deviation) ของกองทุนรวม ค่า Sharpe Ratio สะท้อนถึงอัตราผลตอบแทนที่ก่อ起ทุนรวมได้รับเพิ่มขึ้นเพื่อชดเชยความเสี่ยงที่ก่อตั้งทุนรวมรับบันนา โดยกองทุนรวมที่มีค่า Sharpe Ratio สูงจะเป็นกองทุนรวมที่มีประสิทธิภาพในการบริหารจัดการลงทุนที่ดีกว่า เมื่อจากได้รับผลตอบแทนส่วนเพิ่มที่สูงกว่าภายในตัวค่าของความเสี่ยงเดียวกัน

Alpha ผลตอบแทนต่างกันของกองทุนรวมเมื่อเบริกน์เทิร์นกับดัชนีชี้วัด (benchmark) โดยค่า Alpha ที่สูง หมายถึง กองทุนรวมสามารถสร้างผลตอบแทนได้สูงกว่าดัชนีชี้วัด ซึ่งเป็นผลจากประสิทธิภาพของผู้จัดการกองทุนรวมในการคัดเลือกหุ้นที่เหมาะสม

Beta ระดับและพิสัยการเบริกน์เบลลงของอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุน โดยเบริกน์เทิร์นกับอัตราการเบริกน์เบลลงของตลาด Beta น้อยกว่า 1 แสดงว่า หลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนไม่มีการเบริกน์เบลลงของอัตราผลตอบแทนน้อยกว่าการเบริกน์เบลลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด Beta มากกว่า 1 แสดงว่า หลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเบริกน์เบลลงของอัตราผลตอบแทนมากกว่าการเบริกน์เบลลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด

Tracking Error อัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมมีประสิทธิภาพในการเดินแบบดัชนีชี้วัด โดยหาก Tracking Error ต่ำ หมายถึงกองทุนรวมมีประสิทธิภาพในการสร้างผลตอบแทนให้ใกล้เคียงกับดัชนีชี้วัด กองทุนรวมที่มีค่า Tracking Error สูง จะมีอัตราผลตอบแทนโดยผลลัพธ์ห่างจากดัชนีชี้วัดมากขึ้น

Yield to Maturity อัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในตราสารหนี้โดยคิดอัตราดอกเบี้ยที่จะได้รับในอนาคตตลอดอายุตราสารและเงินต้นที่จะได้รับคืนน้ำมันคงคลัง เป็นมูลค่าปัจจุบัน โดยใช้ชี้วัดอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมตราสารหนี้ ค่านิยมจากดัชนีลี้ดั่งน้ำหนักของ Yield to Maturity ของตราสารหนี้แต่ละตัวที่กองทุนรวมมีการลงทุน และเนื่องจาก Yield to Maturity มีหน่วยมาตรฐานเป็นเปอร์เซ็นต์ต่อปี จึงสามารถนำไปใช้เบริกน์เทิร์นอัตราผลตอบแทนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีน้ำมันฯลฯ อีกรอบ ตราสารหนี้ที่มีน้ำมันฯลฯ มีลักษณะการลงทุนที่ใกล้เคียงกันได้

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