

กองทุนเปิด ทิสโก้ สเตรทิจิก เพื่อการเลี้ยงชีพ

TISCO Strategic RMF

ชนิดผู้ลงทุนทั่วไป
TSFRMF-A

ประเภทกองทุนรวม/กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมตราสารทุน
- กองทุนรวมฟีดเดอร์, กองทุนรวมเพื่อการเลี้ยงชีพ
- กลุ่ม Equity General

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- ลงทุนในกองทุนเปิด ทิสโก้ สเตรทิจิก ฟันด์ ชนิดหน่วยลงทุน A (กองทุนหลัก) ซึ่งมีนโยบายลงทุนในตราสารทุนโดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV ซึ่งบริหารและจัดการโดย บลจ. ทิสโก้ จำกัด
- กองทุนอาจลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า เพื่อเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน
- มุ่งหวังให้ผลประโยชน์การเคลื่อนไหวตามกองทุนหลัก โดยกองทุนหลักใช้กลยุทธ์การลงทุนเพื่อมุ่งหวังให้ผลประโยชน์สูงกว่าดัชนีชี้วัด

ระดับความเสี่ยง



ลงทุนในตราสารทุนเป็นหลัก โดยเฉลี่ยในรอบปีไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน	18 พ.ย. 64
วันเริ่มต้น class	18 พ.ย. 64
นโยบายการจ่ายเงินปันผล	ไม่จ่าย
อายุกองทุน	ไม่กำหนด

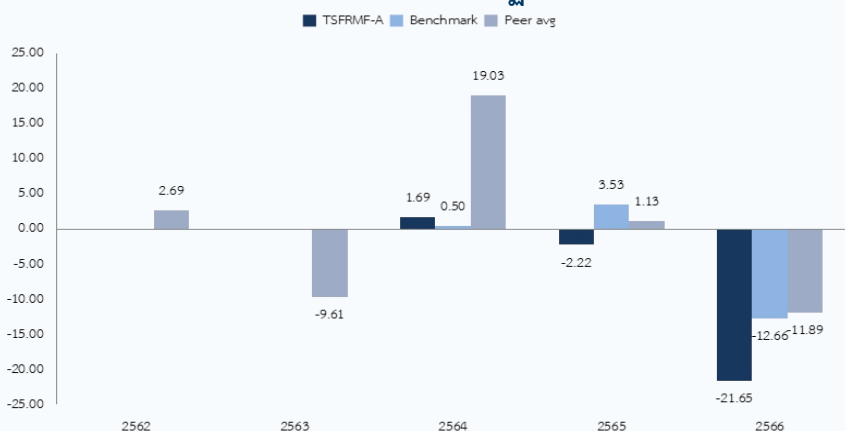
ผู้จัดการกองทุนรวม

นายธีระศักดิ์ บุญญาเสถียร (ตั้งแต่ 6 มิ.ย. 65)
น.ส. มัลลิกา นิยมในธรรม (ตั้งแต่ 18 ก.ย. 66)

ดัชนีชี้วัด

ดัชนีผลตอบแทนรวมตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET TRI) สัดส่วน 100%

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (% ต่อปี)



ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด (%), (% ต่อปี*)

	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี*
กองทุน	-3.35	-3.35	-14.38	-18.26
ดัชนีชี้วัด	-1.62	-1.62	-5.00	-11.68
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	-1.80	-1.80	-5.68	-10.01
ความผันผวนกองทุน	12.68	12.68	16.04	15.87
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	8.25	8.25	9.56	9.21
	3 ปี*	5 ปี*	10 ปี*	ตั้งแต่จัดตั้ง*
กองทุน	n.a.	n.a.	n.a.	-11.31
ดัชนีชี้วัด	n.a.	n.a.	n.a.	-4.63
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	-2.88	-1.49	1.62	n.a.
ความผันผวนกองทุน	n.a.	n.a.	n.a.	15.05
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	n.a.	n.a.	n.a.	9.26

คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวม มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต : ได้รับการรับรอง CAC

“ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือบริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่องได้ที่หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม”

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



www.tiscoasset.com

ประกาศความเป็นส่วนตัว (Privacy Notice)



การซื้อขายหน่วยลงทุน

วันทำการซื้อ : ทุกวันทำการ
เวลาทำการ : 8.30 น. - 15.00 น.
การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ : 1,000 บาท
การซื้อครั้งถัดไปขั้นต่ำ : 1,000 บาท

การขายคืนหน่วยลงทุน

วันทำการขายคืน : ทุกวันทำการ
เวลาทำการ : 8.30 น. - 15.00 น.
การขายคืนขั้นต่ำ : ไม่กำหนด
ยอดคงเหลือขั้นต่ำ : ไม่กำหนด
ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน : T+4

ข้อมูลเชิงสถิติ

Maximum Drawdown	-28.58%
Recovering Period	-
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน	0.07 เท่า
Sharpe Ratio	-0.83
Alpha	-6.68%
Beta	1.14

หมายเหตุ : บริษัทจัดการขอสงวนสิทธิในการเปลี่ยนแปลงมูลค่าขั้นต่ำของการซื้อครั้งถัดไป ซึ่งจะคำนึงถึงประโยชน์ของผู้ถือหน่วยลงทุนเป็นสำคัญ โดยบริษัทจัดการจะประกาศการเปลี่ยนแปลงและแจ้งให้ผู้ถือหน่วยลงทุนทราบล่วงหน้าอย่างชัดเจนผ่านเว็บไซต์ของบริษัทจัดการ ภายในระยะเวลาที่ผู้ถือหน่วยลงทุนสามารถใช้ประโยชน์จากข้อมูลในการตัดสินใจลงทุนได้

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	3.0000	0.0000
รวมค่าใช้จ่าย	5.0000	0.4000

หมายเหตุ : บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ และรวมค่าใช้จ่ายเป็นข้อมูลของรอบปีบัญชีล่าสุดหรือประมาณการเบื้องต้น (กรณียังไม่ครบรอบปีบัญชี)

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การขาย	2.50	ปัจจุบันไม่เรียกเก็บ
การรับซื้อคืน	2.50	ปัจจุบันไม่เรียกเก็บ
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า	2.50	ปัจจุบันไม่เรียกเก็บ
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก	2.50 ขั้นต่ำ 200 บาท	1.00 ขั้นต่ำ 200 บาท
การโอนหน่วย	ไม่มี	ไม่มี

หมายเหตุ : บริษัทจัดการอาจเรียกเก็บค่าธรรมเนียมการขายและค่าธรรมเนียมการรับซื้อคืนกับผู้ลงทุนแต่ละกลุ่มไม่เท่ากัน ทั้งนี้ผู้ลงทุนสามารถดูรายละเอียดเพิ่มเติมได้ที่หนังสือชี้ชวนส่วนข้อมูลกองทุนรวม

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน

ประเภททรัพย์สิน	% NAV
เงินฝากธนาคาร	0.35
หน่วยลงทุน	99.69
หนี้สินอื่น	-0.04

ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก

ชื่อทรัพย์สิน	% NAV
กองทุนเปิด ทีเอสโก้ สแตนด์ดิ้ง ฟันด์ - ชนิดสะสมผลตอบแทน	99.69

การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม

กลุ่มอุตสาหกรรม	% NAV
พลังงานและสาธารณูปโภค	18.67
พาณิชย์	18.66
เงินทุนและหลักทรัพย์	17.73
การแพทย์	9.26
ตลาดใหม่ (ตลาดหลักทรัพย์ เอ็ม เอ ไอ)	8.10
การท่องเที่ยวและสันทนาการ	7.49
พัฒนาอสังหาริมทรัพย์	7.25
ปิโตรเคมีและเคมีภัณฑ์	6.99
บริการเฉพาะกิจ	4.16

การลงทุนในกองทุนอื่นเกินกว่า 20%

ชื่อกองทุน : กองทุนเปิด ทีเอสโก้ สเตเรทิจิก ฟันด์ ชนิดหน่วยลงทุน A

Web Link : [Linkhttps://www.tiscoasset.com/th/mf/fund_info/fund-info.jsp](https://www.tiscoasset.com/th/mf/fund_info/fund-info.jsp)



คำอธิบาย

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

Recovering Period ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาตั้งแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินต้นเริ่มต้นใช้ระยะเวลานานเท่าใด

FX Hedging เปรอ์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตกองทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลานึง 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 สูงกว่าจะเป็นกองทุนที่มีประสิทธิภาพในการบริหารจัดการการลงทุนที่ดีกว่า 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

Yield to Maturity อัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในตราสารหนี้โดยถือจนครบกำหนดอายุ ซึ่งคำนวณจากดอกเบี้ยที่ได้รับในอนาคตตลอดอายุตราสารและเงินต้นที่จะได้รับคืนนำมาคิดลดเป็นมูลค่าปัจจุบัน โดยใช้วัดอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมตราสารหนี้ คำนวณจากค่าเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักของ Yield to Maturity ของตราสารหนี้แต่ละตัวที่กองทุนมีการลงทุน และเนื่องจาก Yield to Maturity มีหน่วยมาตรฐานเป็นเปอร์เซ็นต์ต่อปี จึงสามารถนำไปใช้เปรียบเทียบกับอัตราผลตอบแทนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีนโยบายถือครองตราสารหนี้จนครบกำหนดอายุและมีลักษณะการลงทุนที่ใกล้เคียงกันได้

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ทีเอสโก้ จำกัด

โทรศัพท์ 02 633 7777 โทรสาร 02 633 7300

48/16-17 อาคารทีเอสโก้ทาวเวอร์ ชั้น 9 ถนนสาทรเหนือ แขวงสีลม เขตบางรัก กรุงเทพฯ 10500