

กองทุนเปิด BCAP MSCI Thailand ETF (BMSCITH)

รายละเอียดกองทุน

Ticker : BMSCITH
AIMC Category : Equity Large Cap
ประเภทกองทุน : กองทุนรวมอีทีเอฟที่ลงทุนในตราสารแห่งหนึ่งที่มีการกระจายการลงทุนน้อยกว่าเกณฑ์มาตรฐาน (Specific Fund)
นโยบายการลงทุน : ลงทุนในหลักทรัพย์ประเภทตราสารทุนที่เป็นส่วนประกอบของดัชนี MSCI Thailand ex Foreign Board Index ซึ่งรวมถึงหลักทรัพย์ที่อยู่ระหว่างการเข้าหรือออกจากการเป็นหลักทรัพย์ที่เป็นองค์ประกอบของดัชนีด้วย กองทุนจะใช้กลยุทธ์การลงทุนเชิงรับ (Passive Management Strategy) โดยมุ่งหวังให้ผลประกอบการเคลื่อนไหวตามดัชนีชี้วัด โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชี ไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน โดยมุ่งเน้นที่จะลงทุนในหุ้นเต็มอัตรา (Fully Invested) ซึ่งอาจพิจารณาเลือกใช้กลยุทธ์แบบ Full Replication* หรือ Optimization**

*Full Replication หมายถึง การลงทุนในหลักทรัพย์ที่เป็นส่วนประกอบในดัชนีอ้างอิงในอัตราส่วนที่ใกล้เคียงกับดัชนีอ้างอิงดังกล่าว

**Optimization หมายถึง การลงทุนในหลักทรัพย์ที่เป็นส่วนประกอบของดัชนีอ้างอิง ในอัตราส่วนที่แตกต่างกับดัชนีอ้างอิงดังกล่าว ทั้งนี้ เพื่อสร้างผลตอบแทนที่ใกล้เคียงกับดัชนีอ้างอิงดังกล่าว

จำนวนเงินทุนของโครงการ : 2,000.00 ล้านบาท
อายุโครงการ : ไม่กำหนด
ดัชนีอ้างอิง : MSCI Thailand ex Foreign Board Index
นโยบายการจ่ายเงินปันผล : ไม่จ่าย
ปัจจัยความเสี่ยงที่สำคัญ :

1. ความเสี่ยงจากการดำเนินงานของผู้ออกตราสาร (Business Risk)
2. ความเสี่ยงจากความผันผวนของราคาตราสาร (Market Risk)
3. ความเสี่ยงจากการขาดสภาพคล่องของตราสาร (Liquidity Risk)
4. ความเสี่ยงในการลงทุนตราสารอนุพันธ์ (Risk in the use of Derivatives)
5. ความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน (Currency Risk)

วันจดทะเบียนกองทุน : 2 มิถุนายน 2559
ผู้ดูแลผลประโยชน์ : บมจ. ธนาคารกสิกรไทย

ข้อมูลอื่นๆของกองทุน

มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ : 1,003,070,341.77 บาท
มูลค่าหน่วยลงทุน : 11.2704 บาท
จำนวนหน่วยลงทุนทั้งหมด : 89,000,000 หน่วย
จำนวนหน่วยลงทุนต่อตะกร้าหลักทรัพย์ : 1,000,000 หน่วย
จำนวนตะกร้าหลักทรัพย์ทั้งหมด : 89 ตะกร้า
Tracking Difference : -0.6887%
Tracking Error : 0.0507%

ตลาดรอง

ช่วงห่างของราคา : 0.01 บาท
หน่วยการซื้อขาย : 100 BMSCITH

บริษัทจัดการ

ชื่อ : บลจ. บางกอกแคปปิตอล จำกัด
โทรศัพท์ : 0-2618-1388, 0-2618-1393-4

ผลการดำเนินงานของกองทุน	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี	3 ปี*	5 ปี*	10 ปี*	ตั้งแต่จัดตั้งกองทุน*
BMSCITH	4.00%	5.44%	N/A	N/A	N/A	N/A	12.28%
MSCI Thailand ex Foreign Board	4.17%	5.81%	15.48%	N/A	N/A	N/A	12.91%
ความผันผวนของผลการดำเนินงาน	4.43%	8.73%	N/A	N/A	N/A	N/A	12.23%
ความผันผวนของตัวชี้วัด**	4.43%	8.74%	13.71%	N/A	N/A	N/A	12.25%
Information Ratio***	-7.26	-10.87	N/A	N/A	N/A	N/A	-13.81

ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวมมิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต เอกสารการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวมฉบับนี้ได้จัดทำขึ้นตามมาตรฐานการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวมของสมาคมบริษัทจัดการลงทุน

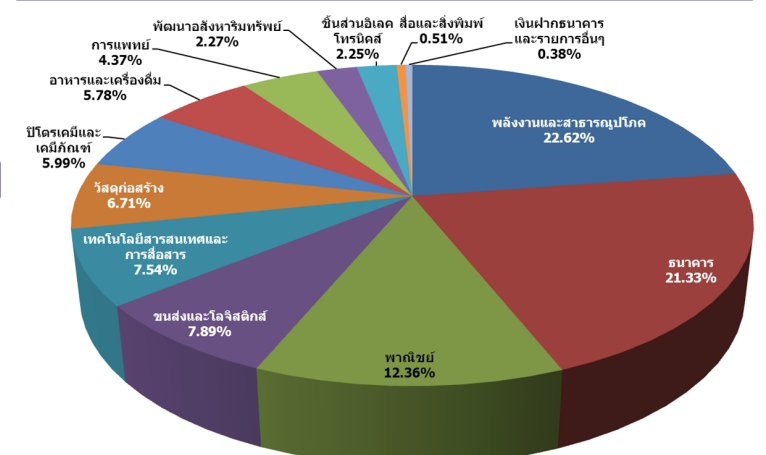
*ผลตอบแทนเฉลี่ยต่อปีสำหรับผลการดำเนินงานย้อนหลัง 3 ปี, 5 ปี, 10 ปี และถ้าหากระยะเวลาตั้งแต่เริ่มบริหารกองทุนมากกว่า 1 ปี จะแสดงผลตอบแทนเฉลี่ยต่อปี

**คำนวณจากอัตราผลตอบแทนรวม ก่อนหักภาษี ณ ที่จ่าย

***Information Ratio: แสดงความสามารถของผู้จัดการกองทุนในการสร้างผลตอบแทนเมื่อเทียบกับความเสี่ยง

หลักทรัพย์ 10 อันดับแรกที่มีมูลค่าการลงทุนสูงสุด	น้ำหนักการลงทุน (%)
1. บมจ. ปตท.	PTT 11.33
2. บมจ. ธนาคารกสิกรไทย	KBANK 9.73
3. บมจ. ซีพี ออลล์	CPALL 8.64
4. บมจ. ธนาคารไทยพาณิชย์	SCB 8.53
5. บมจ. ปูนซิเมนต์ไทย	SCC 6.71
6. บมจ. แอดวานซ์ อินโฟร์ เซอร์วิส	ADVANC 5.53
7. บมจ. ท่าอากาศยานไทย	AOT 4.98
8. บมจ. พีทีที โกลบอล เคมิคอล	PTTGC 4.48
9. บมจ. ปตท. สำรวจและผลิตปิโตรเลียม	PTTEP 3.88
10. บมจ. กรุงเทพดุสิตเวชการ	BDMS 2.43
รวม	66.23

การกระจายการลงทุน (ร้อยละของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิ)



กองทุนเปิด BCAP MSCI Thailand ETF (BMSCITH)

ผลการดำเนินงานตามปีปฏิทิน	Year to Date	2016
BMSCITH	4.00%	7.95%
MSCI Thailand ex Foreign Board Index**	4.17%	8.39%
ความผันผวนของผลการดำเนินงาน	4.43%	11.42%
ความผันผวนของตัวชี้วัด**	4.43%	11.44%
Information Ratio***	-7.26	-10.93

คำเตือน

- การลงทุนในหน่วยลงทุนไม่ใช่การฝากเงิน รวมทั้งไม่ได้อยู่ภายใต้ความคุ้มครองของสถาบันคุ้มครองเงินฝาก จึงมีความเสี่ยงจากการลงทุนซึ่งผู้ลงทุนอาจไม่ได้รับเงินลงทุนคืนเต็มจำนวน
- ในสถานการณ์ไม่ปกติ ผู้ถือหน่วยลงทุนอาจไม่สามารถขายคืนหน่วยลงทุน หรืออาจได้รับชำระค่าขายคืนหน่วยลงทุนล่าช้ากว่าระยะเวลาที่กำหนดไว้ในหนังสือชี้ชวน
- ผลการดำเนินงานของกองทุนรวมไม่ได้ขึ้นอยู่กับสถานะทางการเงินหรือผลการดำเนินงานของบริษัทจัดการกองทุนรวม หรือผู้สนับสนุนการขาย หรือรับซื้อคืนหน่วยลงทุน
- ผู้ลงทุนต้องศึกษา และทำความเข้าใจลักษณะสินค้า ข้อมูลสำคัญ นโยบายการลงทุน เงื่อนไขผลตอบแทน ความเสี่ยง และผลการดำเนินงาน ก่อนการตัดสินใจลงทุน

*ผลตอบแทนเฉลี่ยต่อปีสำหรับผลการดำเนินงานย้อนหลัง 3 ปี, 5 ปี, 10 ปี และถ้าหากระยะเวลาตั้งแต่เริ่มบริหารกองทุนมากกว่า 1 ปี จะแสดงผลตอบแทนเฉลี่ยต่อปี

**คำนวณจากอัตราผลตอบแทนรวม ก่อนหักภาษี ณ ที่จ่าย

***Information Ratio: แสดงความสามารถของผู้จัดการกองทุนในการสร้างผลตอบแทนเมื่อเทียบกับความเสี่ยง

การที่สำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ต. ได้อนุมัติให้จัดตั้งและจัดการกองทุนรวมมิได้เป็นการแสดงว่าคณะกรรมการ ก.ล.ต. คณะกรรมการกำกับตลาดทุน หรือสำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ต. ได้รับรองถึงความครบถ้วน และถูกต้องของข้อมูลในการเสนอขาย และมีได้ประกันราคาหรือผลตอบแทนของกองทุนรวม

ผู้ลงทุนควรทำความเข้าใจลักษณะสินค้า เงื่อนไข ผลตอบแทนและความเสี่ยง ก่อนตัดสินใจลงทุน
เอกสารนี้มิใช่หนังสือชี้ชวน ผู้ลงทุนสามารถขอรับหนังสือชี้ชวนได้ที่บริษัทจัดการ ผู้สนับสนุนการขายฯ หรือ www.bcaph.co.th

AIMC Category Performance Report

Return and Risk statistics for Thailand Mutual

AIMC Category	Peer Percentile	Return (%)						Standard Deviation (%)					
		3M	6M	1Y	3Y	5Y	10Y	3M	6M	1Y	3Y	5Y	10Y
Moderate Allocation	5th Percentile	2.55	5.13	11.16	6.65	7.15	9.03	2.78	4.23	4.57	3.40	4.96	9.36
	25th Percentile	1.72	3.66	6.93	5.31	6.17	8.91	3.73	5.85	6.21	4.62	6.75	11.85
	50th Percentile	1.18	2.30	5.24	3.24	5.61	8.13	5.05	8.01	8.62	5.68	7.99	12.77
	75th Percentile	0.37	1.64	4.32	2.52	4.44	7.11	6.43	9.91	10.37	6.80	9.01	14.92
	95th Percentile	-0.08	0.95	2.27	1.98	3.28	4.87	7.09	10.55	11.10	7.33	10.30	15.53
Aggressive Allocation	5th Percentile	4.14	8.08	15.84	11.05	9.85	12.62	2.02	2.86	4.93	5.05	6.17	15.77
	25th Percentile	2.02	5.91	11.78	6.58	8.72	11.39	5.67	8.45	10.60	8.95	12.21	18.01
	50th Percentile	0.99	3.38	8.36	4.57	6.47	10.49	8.20	12.40	13.83	9.76	13.32	19.18
	75th Percentile	-0.02	1.60	6.24	3.40	6.05	9.79	9.92	14.62	15.49	10.36	14.34	20.65
	95th Percentile	-1.96	-0.38	2.81	1.83	3.58	7.54	11.49	18.00	17.93	12.47	15.82	22.09
Foreign Investment Allocation	5th Percentile	5.70	5.39	13.37	2.62	4.56	2.65	1.87	3.87	4.22	5.34	6.93	9.90
	25th Percentile	3.39	4.25	8.32	1.23	3.55	2.57	4.34	4.53	5.77	6.71	7.01	12.61
	50th Percentile	2.08	3.12	6.44	-0.36	2.53	1.10	4.78	5.41	6.40	6.93	7.73	14.04
	75th Percentile	1.28	1.97	3.89	-1.31	1.39	-0.45	5.64	6.34	7.14	9.00	8.73	14.55
	95th Percentile	-1.54	-4.19	-1.92	-2.32	0.27	-0.72	11.45	10.17	11.44	9.57	10.11	15.03
Equity General	5th Percentile	5.97	10.58	23.23	10.27	11.65	14.35	7.15	10.70	11.66	7.85	11.72	17.16
	25th Percentile	2.81	7.77	15.64	7.82	9.53	13.49	8.61	13.75	14.69	9.37	12.97	19.09
	50th Percentile	1.24	5.29	10.64	6.72	7.78	11.72	9.46	15.06	15.56	10.05	13.85	20.16
	75th Percentile	0.45	2.86	7.95	4.10	6.45	10.86	10.63	16.06	16.67	10.82	14.86	20.77
	95th Percentile	-2.51	0.53	5.79	2.35	3.81	7.99	12.58	19.81	19.57	13.56	16.20	22.17
Equity Large Cap	5th Percentile	4.44	6.61	14.48	8.28	10.02	13.16	9.24	14.17	15.54	9.54	12.61	20.95
	25th Percentile	3.26	5.97	13.56	5.97	7.36	11.87	9.35	14.83	15.99	9.97	12.73	21.44
	50th Percentile	2.87	5.26	11.87	5.07	6.16	11.35	9.64	15.09	16.11	10.52	12.86	21.82
	75th Percentile	1.69	4.55	10.80	4.65	5.57	10.93	10.25	15.28	16.39	11.28	13.45	22.03
	95th Percentile	0.24	3.11	9.17	1.81	4.96	10.18	11.02	15.50	16.92	11.61	14.79	22.22
Equity Small - Mid Cap	5th Percentile	3.86	20.52	30.47	14.47			9.75	14.31	16.70	11.22		
	25th Percentile	1.84	13.82	28.93	13.77			11.13	16.72	18.75	11.99		
	50th Percentile	0.88	13.53	17.56	12.90			12.74	19.63	20.32	12.95		
	75th Percentile	-0.74	12.23	12.26	12.03			13.21	20.21	20.58	13.91		
	95th Percentile	-2.85	4.25	11.58	11.33			17.09	29.41	27.20	14.68		
SET 50 Index Fund	5th Percentile	4.44	6.42	13.68	5.26	6.71	11.56	9.67	14.54	16.00	11.10	12.62	21.75
	25th Percentile	3.94	6.29	13.24	5.09	6.48	11.52	9.91	14.74	16.25	11.20	12.73	21.76
	50th Percentile	3.82	6.07	12.86	4.78	6.09	11.32	9.96	14.78	16.27	11.36	12.80	21.83
	75th Percentile	3.71	6.00	12.40	4.42	5.85	10.97	9.98	14.83	16.33	11.44	12.93	21.87
	95th Percentile	3.23	5.68	12.24	4.12	5.54	10.93	11.76	21.87	20.35	11.47	12.98	21.88
ASEAN Equity	5th Percentile	8.62	6.59	8.42	-2.89	-1.06		8.09	11.06	11.62	8.16	10.85	
	25th Percentile	5.64	1.73	5.90	-3.89	-2.89		8.64	11.23	12.12	8.57	11.54	
	50th Percentile	2.75	-1.33	0.21	-5.15	-5.18		9.64	12.26	13.12	9.09	12.40	
	75th Percentile	0.77	-3.74	-2.05	-6.41	-7.47		10.33	13.13	13.36	9.61	13.26	
	95th Percentile	0.07	-7.11	-9.57	-7.42	-9.30		10.99	13.56	13.78	10.02	13.95	

Return and Risk statistics for Thailand Mutual

 ข้อตกลงและเงื่อนไขของข้อมูลเปรียบเทียบผลการดำเนินงานแบบเปอร์เซ็นต์ไทล์
 Disclaimer of Peer group Fund Performance)

1. ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุน มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต
2. ผู้ลงทุนสามารถดูข้อมูลฉบับเต็มได้ที่ www.aimc.or.th
3. ผลการดำเนินงานของกองทุนที่การเปรียบเทียบแบ่งตามประเภทกองทุนรวมภายใต้ข้อกำหนดของสมาคมบริษัทจัดการลงทุน โดยกองทุนที่จะถูกเปรียบเทียบผลการดำเนินงานในแต่ละช่วงเวลากับกองทุนประเภทเดียวกันในระดับเปอร์เซ็นต์ไทล์ (Percentiles) ต่างๆ โดยแบ่งออกเป็น
 - 5th Percentile แสดงผลการดำเนินงานของกองทุนอันดับที่5 เปอร์เซ็นต์ไทล์ (Top 5% performance)
 - 25th Percentile แสดงผลการดำเนินงานของกองทุนอันดับที่25 เปอร์เซ็นต์ไทล์ (Top 25% performance)
 - 50th Percentile แสดงผลการดำเนินงานของกองทุนอันดับที่50 เปอร์เซ็นต์ไทล์ (Median performance)
 - 75th Percentile แสดงผลการดำเนินงานของกองทุนอันดับที่75 เปอร์เซ็นต์ไทล์ (Bottom 25% performance)
 - 95th Percentile แสดงผลการดำเนินงานของกองทุนอันดับที่95 เปอร์เซ็นต์ไทล์ (Bottom 5% performance)
4. ผลตอบแทนที่มีอายุเกินหนึ่งปีนั้นมีการแสดงเป็นผลตอบแทนต่อปี

เมื่อผู้ลงทุนทราบผลตอบแทนของกองทุนที่ลงทุน สามารถนำไปเปรียบเทียบกับเปอร์เซ็นต์ไทล์ตามตาราง จะทราบว่ากองทุนที่ลงทุนนั้นอยู่ในช่วงที่เท่าใดของประเภทกองทุนรวมนั้น