

กองทุนเปิด เฟิร์ส พลัส ไชน่า อีควิตี้ ควอนตาเมนทัล อัลฟา ชนิดผู้ลงทุนสถาบัน (FP QUANT-I)

ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมตราสารทุน / กองทุนรวมที่มีนโยบายเปิดให้มีการลงทุนในกองทุนรวมอื่นภายใต้ บลจ. เดียวกัน / กองทุนรวมที่เน้นลงทุนแบบมีความเสี่ยงต่างประเทศ
- กลุ่ม China Equity – A shares

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- กองทุนมีนโยบายลงทุนในตราสารทุนโดยจะเน้นลงทุนในตลาดหุ้นของบริษัทที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์เซี่ยงไฮ้ (SSE) และเซินเจิ้น (SZSE) ของจีนแผ่นดินใหญ่ (A-Shares) โดยมี net exposure ในตราสารดังกล่าวโดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุนรวม โดยกองทุนจะใช้กลยุทธ์เชิงปริมาณ (Quantitative Strategy) ที่พัฒนาขึ้นเฉพาะ ด้วยแนวทางการลงทุนแบบ Quantamental ประกอบด้วยวิเคราะห์เชิงปัจจัยพื้นฐาน (Fundamental) และการวิเคราะห์เชิงปริมาณ (Quantitative) (สามารถอ่านข้อมูลเพิ่มเติมได้ที่หัวข้อ “ข้อมูลอื่นๆ”)

นอกจากนี้ กองทุนอาจลงทุนตรงในหุ้นจีน A-shares ผ่านโครงการเชื่อมโยงตลาดเซี่ยงไฮ้-ฮ่องกง (Shanghai-Hong Kong Stock Connect) หรือเซินเจิ้น-ฮ่องกง (Shenzhen-Hong Kong Stock Connect) (โดยรวมเรียกว่า “Stock Connect”) หรือ ผ่านโครงการ QFII (Qualified Foreign Institutional Investor) ก็ได้

- บริษัทจัดการได้แต่งตั้งให้ First Plus Asset Management Pte. Ltd. เป็นผู้รับมอบหมายงานด้านการจัดการลงทุน (Outsource Fund Manager)
- กองทุนอาจลงทุนใน derivatives เพื่อ FX hedging หรือเพื่อเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารกองทุน (EPM) ตามดุลยพินิจของผู้จัดการกองทุน (dynamic hedging)
- กองทุนอาจลงทุนในกองทุนรวมอื่นภายใต้ บลจ. เดียวกัน โดยเฉลี่ยรอบปีบัญชีไม่เกิน 20% ของ NAV

กลยุทธ์ในการบริหารจัดการลงทุน

- กองทุนมุ่งหวังให้ผลประกอบการสูงกว่าดัชนีชี้วัด (active management) โดยใช้กลยุทธ์การลงทุนเชิงปริมาณ (Quantitative Strategy) ในการวิเคราะห์และคัดเลือกหลักทรัพย์ และจะกำหนดสัดส่วนการลงทุนโดยใช้วิธีการถ่วงน้ำหนักตามมูลค่า (Value-Weighted Strategy) เพื่อให้การจัดสรรการลงทุนสะท้อนมูลค่าของหลักทรัพย์และสอดคล้องกับผลการวิเคราะห์

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (% ต่อปี)

ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปีกumul (% ต่อปี*)

	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี
FP QUANT-I				
ตัวชี้วัด				
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน				
ความผันผวนกองทุน				
ความผันผวนดัชนีชี้วัด				
	3 ปี	5 ปี	10 ปี	ตั้งแต่จัดตั้ง

FP QUANT-I
ตัวชี้วัด
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน
ความผันผวนกองทุน
ความผันผวนดัชนีชี้วัด

ระดับความเสี่ยง

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

6 : เสี่ยงสูง

ลงทุนในตราสารทุนต่างประเทศเป็นหลัก โดยเฉลี่ยในรอบปีไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน	26 พฤษภาคม 2569
วันเริ่มต้น class	26 พฤษภาคม 2569
นโยบายการจ่ายเงินปันผล	ไม่จ่าย
อายุกองทุน	ไม่กำหนด
การป้องกันความเสี่ยง FX	ตามดุลพินิจของผู้จัดการกองทุน (dynamic hedging)
การเรียกเก็บค่าธรรมเนียม	ไม่มี
ตามผลการดำเนินงาน	

ผู้จัดการกองทุนรวม

ชื่อ - นามสกุล	วันที่เริ่มบริหารกองทุน
นายโฮ หยัม หยิง (ริชาร์ด)	วันที่จดทะเบียนกองทุน
นางสาวพรพิชญ์ เต็งไตรสรณ์	วันที่จดทะเบียนกองทุน

ดัชนีชี้วัด

CSI 800 Total Return Index สัดส่วน 100% ในสกุลเงินหยวน (RMB) ปรับด้วยอัตราแลกเปลี่ยนเป็นสกุลเงินบาท ณ วันที่คำนวณผลตอบแทน

วัตถุประสงค์ในการอ้างอิงดัชนีชี้วัด : เพื่อเปรียบเทียบกับผลการดำเนินงานของกองทุน

คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวมมิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต
- การลงทุนในกองทุนรวมที่ลงทุนในต่างประเทศมีความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน ซึ่งอาจทำให้ได้รับเงินคืนสูงกว่าหรือต่ำกว่าเงินลงทุนเริ่มแรกได้

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต : ได้รับการรับรองจาก CAC

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือบริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่องได้ที่หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

<https://th.firstplus.com/>

การซื้อขายหน่วยลงทุน

วันทำการซื้อ : ทุกวันทำการซื้อขาย

- ช่วง IPO : ตั้งแต่วันที่ 18 – 22 พฤษภาคม 2569

- หลัง IPO : เริ่มตั้งแต่วันที่ 28 พฤษภาคม 2569

เวลาทำการ : เวลาเริ่มทำการถึง 15.30 น.

การซื้อขายครั้งแรกขั้นต่ำ : 10,000,000 บาท

การซื้อขายครั้งถัดไปขั้นต่ำ : ไม่กำหนด

การขายคืนหน่วยลงทุน

วันทำการขายคืน : ทุกวันทำการซื้อขาย

เริ่มตั้งแต่วันที่ 28 พฤษภาคม 2569 เป็นต้นไป

เวลาทำการ : เวลาเริ่มทำการถึง 15.30 น.

การขายคืนขั้นต่ำ : ไม่กำหนด

ยอดคงเหลือขั้นต่ำ : ไม่กำหนด

ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน : T+6 นับจาก
วันทำการขายคืน* (ปัจจุบัน T+5)

หมายเหตุ: *ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืนข้างต้นจะไม่เกินระยะเวลา 5 วันทำการนับจากวันคำนวณ NAV (โดยไม่นับรวมวันหยุดต่างประเทศ) ตามที่ระบุไว้ในโครงการ

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	1.8725	1.00
ค่าตอบแทนแก่ตัวแทนขายหน่วยลงทุนของ กองทุนรวม (trailer fee) : มี		
รวมค่าใช้จ่าย	4.2265	

ค่าธรรมเนียมดังกล่าวเป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะ หรือภาษีอื่นใดแล้ว

- ค่าธรรมเนียมผู้รับมอบหมายงานด้านการจัดการลงทุน อัตราไม่เกิน 0.50% ต่อปีของ NAV เก็บจริง 0.50% ต่อปีของ NAV ทั้งนี้ ค่าธรรมเนียมการจัดการได้รวมค่าธรรมเนียมผู้รับมอบหมายงานด้านการจัดการลงทุนแล้ว
- หากกองทุนลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมภายใต้การจัดการเดียวกัน (กองทุนปลายทาง) บริษัทจัดการจะไม่เรียกเก็บค่าธรรมเนียมการจัดการซ้ำซ้อนกับกองทุนปลายทาง (สามารถดูข้อมูลเพิ่มเติมได้ที่หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม)

หมายเหตุ: บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการกองทุน

ค่าธรรมเนียมตามผลการดำเนินงาน	อัตราค่าธรรมเนียม
-	ไม่มี

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การขาย	2.00	ยกเว้น ไม่เรียกเก็บ
การรับซื้อคืน	2.00	ยกเว้น ไม่เรียกเก็บ
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า	ไม่มี	ไม่มี
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก	ไม่มี	ไม่มี
การโอนหน่วย	ไม่เกิน 200 บาท/รายการ	ไม่เกิน 200 บาท/รายการ

ค่าธรรมเนียมดังกล่าวเป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะ หรือภาษีอื่นใดแล้ว

บริษัทจัดการยังไม่เปิดให้ผู้ถือหน่วยลงทุนทำรายการสับเปลี่ยนระหว่างชนิดหน่วยลงทุนภายในกองทุนเดียวกัน หากจะเปิดให้บริการจะแจ้งให้ทราบล่วงหน้าผ่านทางเว็บไซต์ของบริษัทจัดการหรือผู้สนับสนุนการขายหรือรับซื้อคืนหน่วยลงทุน

หมายเหตุ:

- 1 หากกองทุนลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมภายใต้การจัดการเดียวกัน บริษัทจัดการจะไม่เรียกเก็บค่าธรรมเนียมการขายและค่าธรรมเนียมการรับซื้อคืนหน่วยลงทุนซ้ำซ้อน (สามารถดูข้อมูลเพิ่มเติมได้ที่หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม)
- 2 บริษัทจัดการอาจเรียกเก็บค่าธรรมเนียมการขายและค่าธรรมเนียมการรับซื้อคืนกับผู้ลงทุนแต่ละกลุ่ม และ/หรือแต่ละรายไม่เท่ากัน โดยขึ้นอยู่กับดุลยพินิจของบริษัทจัดการ
- 3 กองทุนไม่มีการเรียกเก็บค่าธรรมเนียมการสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้าและสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก แต่มีการเรียกเก็บค่าธรรมเนียมการขายหน่วยลงทุน (กองทุนปลายทาง) และค่าธรรมเนียมการรับซื้อคืนหน่วยลงทุน (กองทุนต้นทาง) (ถ้ามี) ตามอัตราที่บริษัทจัดการกำหนด

ข้อมูลเชิงสถิติ

Maximum drawdown
Recovering Period
FX Hedging
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน
Sharpe ratio
Alpha
Beta
Tracking Error

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน

ชื่อทรัพย์สิน	%NAV
ตราสารทุนต่างประเทศ	
เงินฝากธนาคาร	
สินทรัพย์และหนี้สินอื่น	

ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก

ชื่อทรัพย์สิน	%NAV

การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม

ชื่อทรัพย์สิน	%NAV

คำอธิบาย

Maximum Drawdown :	เปอร์เซ็นต์ผลขาดทุนสูงสุดของกองทุนรวมในระยะเวลา 5 ปีย้อนหลัง (หรือตั้งแต่จัดตั้งกองทุนกรณีที่ยังไม่ครบ 5 ปี) โดยวัดจากระดับ NAV ต่อหน่วยที่จุดสูงสุดไปจนถึงจุดต่ำสุดในช่วงที่ NAV ต่อหน่วยปรับตัวลดลง ค่า Maximum Drawdown เป็นข้อมูลที่ช่วยให้ทราบถึงความเสี่ยงที่อาจจะขาดทุนจากการลงทุนในกองทุนรวม
Recovering Period :	ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาตั้งแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้น ใช้ระยะเวลานานเท่าใด
FX Hedging :	เปอร์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน :	ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตกองทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลาหนึ่ง 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 สูงกว่าจะเป็นกองทุนที่มีประสิทธิภาพในการบริหารจัดการลงทุนที่ดีกว่า เนื่องจากได้รับผลตอบแทนส่วนเพิ่มที่สูงกว่าภายใต้ระดับความเสี่ยงเดียวกัน
Alpha :	ผลตอบแทนส่วนเกินของกองทุนรวมเมื่อเปรียบเทียบกับดัชนีชี้วัด (benchmark) โดยค่า Alpha ที่สูง หมายถึง กองทุนสามารถสร้างผลตอบแทนได้สูงกว่าดัชนีชี้วัด ซึ่งเป็นผลจากประสิทธิภาพของผู้จัดการกองทุนในการคัดเลือกหรือหาจังหวะเข้าลงทุนในหลักทรัพย์ได้อย่างเหมาะสม
Beta :	ระดับและทิศทางของการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุน โดยเปรียบเทียบกับอัตราการเปลี่ยนแปลงของตลาด Beta น้อยกว่า 1 แสดงว่า หลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนน้อยกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด Beta มากกว่า 1 แสดงว่าหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนมากกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด
Tracking Error :	อัตราผลตอบแทนของกองทุนมีประสิทธิภาพในการเลียนแบบดัชนีชี้วัด โดยหาก tracking error ต่ำ หมายถึงกองทุนรวมมีประสิทธิภาพในการสร้างผลตอบแทนให้ใกล้เคียงกับดัชนีชี้วัด กองทุนรวมที่มีค่า tracking error สูง จะมีอัตราผลตอบแทนโดยเฉลี่ยห่างจากดัชนีชี้วัดมากขึ้น

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน เฟิร์ส พลัส (ประเทศไทย) จำกัด

โทร. 02-761-6550 <https://th.firstplus.com/>
598 อาคารคิวเฮ้าส์ เพลินจิต ชั้น 17 ถนนเพลินจิต
แขวงลุมพินี เขตปทุมวัน กรุงเทพมหานคร 10330

ข้อมูลอื่นๆ

รายละเอียดกลยุทธ์การลงทุน

1. กองทุนจะใช้แนวทางการลงทุนเชิงระบบ (Systematic) โดยอาศัยการวิเคราะห์เชิงปัจจัย (Factor-based Approach) เพื่อค้นหาโอกาสในการลงทุน ผ่านการวิเคราะห์ข้อมูลที่มีความน่าเชื่อถือและการประเมินมูลค่าของหลักทรัพย์ที่มีราคาเหมาะสมเมื่อเทียบกับมูลค่าจากสินทรัพย์อ้างอิง ภายใต้กรอบการบริหารความเสี่ยงที่มีโครงสร้างชัดเจน
2. กองทุนจะคัดเลือกหลักทรัพย์โดยพิจารณาจากปัจจัยด้านคุณภาพของบริษัท (Quality) มูลค่าหลักทรัพย์ (Valuation) และความผันผวนของราคา (Volatility) โดยใช้ข้อมูลประกอบการวิเคราะห์จากทั้งปัจจัยพื้นฐาน การวิเคราะห์ทางเทคนิค ความเห็นโดยรวมของนักวิเคราะห์ (Analyst Consensus) และความเชื่อมั่นของตลาด (Market Sentiment)
3. หลักทรัพย์ที่มีความผันผวนต่ำ มีคุณภาพสูง และมีมูลค่าที่เหมาะสม จะถูกนำมาพิจารณาอยู่ในกลุ่มหลักทรัพย์ที่สามารถลงทุนได้ของกองทุน (Investable Universe)
4. การจัดสรรสัดส่วนการลงทุนและการปรับสมดุลพอร์ตการลงทุน (Rebalancing) จะใช้วิธีการทดสอบแบบจำลองย้อนหลัง (Back testing) ซึ่งครอบคลุมการเพิ่มประสิทธิภาพของพอร์ตการลงทุน (Portfolio Optimization) การบริหารความเสี่ยง (Risk Management) และการวิเคราะห์ต้นทุนการลงทุน (Cost Analysis) พร้อมทั้งมีการติดตามและประเมินผลอย่างต่อเนื่อง เพื่อมุ่งหวังผลตอบแทนที่เหมาะสมเมื่อเทียบกับความเสี่ยงในระยะยาว

ปัจจัยการลงทุนด้วยกลยุทธ์เชิงปริมาณ

นอกจากกองทุนจะใช้พื้นฐานการวิเคราะห์ปัจจัยพื้นฐานเป็นหลักแล้ว ยังเสริมด้วยปัจจัยด้านปริมาณการซื้อขายและราคาหลักทรัพย์ รวมถึงข้อมูลทางเลือกอื่นๆ เช่น สัญญาณการลงทุนจากแหล่งข้อมูลเข้าด้วยกัน เพื่อช่วยค้นหามูลค่าการลงทุนที่เหมาะสมอย่างต่อเนื่อง และเพิ่มความยืดหยุ่นในการบริหารพอร์ตการลงทุน ดังนี้

- **ปัจจัยด้านราคาและปริมาณการซื้อขาย (Volume-Price Factors):** กองทุนจะนำปัจจัยที่เกี่ยวข้องกับราคาและปริมาณการซื้อขายของหลักทรัพย์มาประกอบการวิเคราะห์ เช่น แนวโน้มของราคา (Momentum) ระดับความผันผวน (Volatility) และอัตราหมุนเวียนการซื้อขาย (Turnover) เป็นต้น เพื่อช่วยวิเคราะห์โอกาสในการสร้างผลตอบแทนจากพฤติกรรมของตลาดในระยะสั้นถึงระยะกลาง
- **ปัจจัยทางเลือก (Alternative Factors):** กองทุนจะนำปัจจัยทางเลือกอื่นมาประกอบการวิเคราะห์ เช่น ระดับการครอบคลุมของบทวิเคราะห์จากนักวิเคราะห์หลักทรัพย์ (analyst coverage) พฤติกรรมตลาดเคลื่อนไหวของตลาด (market behavior) ความเชื่อมั่นของนักลงทุน (sentiment) เป็นต้น เพื่อสนับสนุนการประเมินแนวโน้มของหลักทรัพย์และช่วยให้กองทุนสามารถปรับตัวต่อการเปลี่ยนแปลงของปัจจัยพื้นฐานได้อย่างเหมาะสม
- **ปัจจัยพื้นฐาน (Fundamental Factors):** กองทุนจะใช้การวิเคราะห์ปัจจัยพื้นฐานของบริษัทเป็นหลัก โดยพิจารณาจากข้อมูลทางเศรษฐศาสตร์และข้อมูลทางการเงินของบริษัท เพื่อคัดเลือกหุ้นขนาดใหญ่ที่มีคุณภาพในการลงทุน ทั้งนี้ กองทุนอาจมีความยืดหยุ่นในการปรับพอร์ตการลงทุนเพื่อให้สะท้อนมูลค่าที่เหมาะสมของหลักทรัพย์ในระยะยาว

บริษัทจัดการขอสงวนสิทธิในการปรับปรุง พัฒนา เปลี่ยนแปลงระบบ และ/หรือผู้พัฒนาระบบเพิ่มเติมได้ โดยจะคำนึงถึงผลประโยชน์สูงสุดของกองทุนและผู้ถือหน่วยลงทุนเป็นสำคัญ

การปรับสมดุลของสัดส่วนน้ำหนักการลงทุน (Rebalance) และการปรับรายชื่อหลักทรัพย์

บริษัทจัดการจะทำการปรับสมดุลของสัดส่วนน้ำหนักการลงทุน (Rebalance) รวมถึงปรับรายชื่อหลักทรัพย์การลงทุนในตราสารทุนเป็นรายเดือน เพื่อให้เป็นไปตามหลักเกณฑ์การพิจารณาคัดเลือกและสัดส่วนการลงทุนในหลักทรัพย์ตามที่กำหนดไว้ข้างต้น ทั้งนี้ เนื่องจากกลยุทธ์การลงทุนของกองทุนเป็นกลยุทธ์เชิงปริมาณ (Quantitative Strategy) ที่ใช้การวิเคราะห์เชิงปัจจัย (Factor-based Approach) ในการคัดเลือกหลักทรัพย์ ซึ่งปัจจัยการลงทุนหลายประเภท เช่น ปัจจัยพื้นฐาน ปัจจัยด้านราคาและปริมาณการซื้อขาย รวมถึงปัจจัยทางเลือกอื่น อาจมีการปรับปรุงข้อมูลและการจัดอันดับหลักทรัพย์เป็นระยะ การปรับสมดุลการลงทุนในรายเดือนจึงช่วยให้พอร์ตการลงทุนสามารถสะท้อนข้อมูลล่าสุดของตลาดหุ้นจีนที่มีการปรับสมดุลพอร์ต ในความถี่รายเดือน รวมทั้งมีการคำนวณและจัดอันดับหลักทรัพย์ใหม่เป็นประจำทุกเดือนทำให้พอร์ตการลงทุนต้องปรับน้ำหนักให้สอดคล้องกับคะแนนปัจจัยล่าสุดของหุ้นแต่ละตัว ดังนั้น กองทุนจึงต้องปรับให้สอดคล้องกับหลักเกณฑ์การคัดเลือกหลักทรัพย์ดังกล่าวตามความเหมาะสม

อนึ่ง บริษัทจัดการขอสงวนสิทธิที่จะปรับรายชื่อหลักทรัพย์ของบริษัทใดบริษัทหนึ่งหรือหลายบริษัทออกจากรายชื่อหลักทรัพย์ที่กองทุนลงทุน ณ ขณะนั้น เมื่อพิจารณาจากปัจจัย/เหตุการณ์ที่เกิดขึ้น หรือมีความเสี่ยงสูงที่จะเกิดขึ้น ที่บริษัทจัดการคาดการณ์ว่าอาจส่งผลกระทบต่อราคาในทิศทางที่จะทำให้ราคาตราสารทุนของบริษัทนั้นลดลงอย่างมีนัยสำคัญ ซึ่งการดำเนินการข้างต้นอาจส่งผลให้การลงทุนของกองทุนไม่เป็นไปตามหลักเกณฑ์การพิจารณาคัดเลือกของกองทุน ทั้งนี้ บริษัทจัดการจะดำเนินการเพื่อประโยชน์ของผู้ถือหน่วยลงทุนเป็นสำคัญ

ในกรณีที่บริษัทจัดการพิจารณาแล้วเห็นว่า หลักเกณฑ์การพิจารณาคัดเลือกหลักทรัพย์ การคำนวณสัดส่วนการลงทุนในหลักทรัพย์ หรือการปรับสมดุลของสัดส่วนน้ำหนักการลงทุน (Rebalance) และการปรับรายชื่อหลักทรัพย์ที่กำหนดไว้ข้างต้นไม่เหมาะสมกับสถานการณ์การลงทุน ณ ขณะใดแล้ว บริษัทจัดการขอสงวนสิทธิที่จะปรับปรุงหลักเกณฑ์ฯ ดังกล่าวได้ เช่น การปรับโมเดลเชิงปริมาณ การจัดอันดับปัจจัยที่ใช้ในการวิเคราะห์ หรือ การบริหารความเสี่ยง เป็นเกณฑ์เพิ่มเติม เป็นต้น ทั้งนี้ บริษัทจัดการจะแจ้งรายละเอียดของการปรับเปลี่ยนหลักเกณฑ์ฯ ให้ผู้ถือหน่วยลงทุน และ/หรือผู้ลงทุนทราบล่วงหน้าไม่น้อยกว่า 3 วันทำการผ่านทางเว็บไซต์ของบริษัทจัดการ