

FP QUANT

กองทุนเปิด เฟิร์ส พลัส โชน่า อีควิตี้ ควอนตামেন্টัล อัลฟ่า

ลงทุนอย่างเป็นระบบแบบ **Quantamental**

คัดเลือกหุ้นจีนจากการผสมผสานการวิเคราะห์เชิงปริมาณ (Quantitative)
และการวิเคราะห์ปัจจัยพื้นฐาน (Fundamental)
เพื่อให้ได้หุ้นคุณภาพที่ผ่านการคัดมาแล้ว
พร้อมสร้างโอกาสเติบโตในทุกสภาวะตลาด

เสนอขายครั้งแรก (IPO)

วันที่ 18-22 พฤษภาคม 2569



@FirstPlusTH

โปรดทำความเข้าใจลักษณะสินค้า เงื่อนไข ผลตอบแทนและความเสี่ยงก่อนตัดสินใจลงทุน / ผลการดำเนินงานในอดีตมิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต การลงทุนในกองทุนรวมทั้งลงทุนในต่างประเทศมีความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยนซึ่งอาจทำให้ได้รับเงินคืนสูงกว่าหรือต่ำกว่าเงินลงทุนเริ่มแรกได้

สอบถามข้อมูลเพิ่มเติมและขอรับหนังสือชี้ชวนในวันและเวลาเสนอขายได้ที่
บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน เฟิร์ส พลัส (ประเทศไทย) จำกัด
หรือ ผู้สนับสนุนการขายหรือรับซื้อคืนหน่วยลงทุนที่ได้รับแต่งตั้ง



รู้จัก Quantamental Investment

การผสมผสานระหว่างข้อมูลและอัลกอริทึมจะช่วยเสริม "วิจารณ์ญาณและประสบการณ์" ของมนุษย์ เพื่อลดข้อผิดพลาดและเพิ่มประสิทธิภาพในการทำกำไร



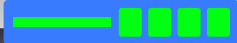
การค้นหาโอกาสในการลงทุนผ่านการวิเคราะห์ข้อมูลที่มีความน่าเชื่อถือ และการประเมินมูลค่าของหลักทรัพย์ที่มีราคาเหมาะสมภายใต้กรอบการบริหารความเสี่ยงที่มีโครงสร้างชัดเจน



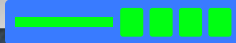
พิจารณาจากปัจจัยหลายมิติคุณภาพของบริษัท (Quality) มูลค่าหลักทรัพย์ (Valuation) ความผันผวนของราคา (Volatility) และ ปัจจัยอื่นๆ ที่สำคัญ เพื่อให้ได้มาซึ่งผลตอบแทนที่ดียิ่งขึ้น



Low Crowding Risk หรือ ความเสี่ยงที่จะใช้ข้อมูลเพื่อการตัดสินใจเดียวกันกับลงทุนรายอื่นต่ำ เพิ่มความได้เปรียบและเพิ่มเสถียรภาพระยะยาว



ขับเคลื่อนด้วยปัจจัยเชิงโครงสร้างระยะยาว ช่วยให้ผลตอบแทนมีความสม่ำเสมอและมั่นคงในทุกวัฏจักรตลาด



Quantamental Investment

การผสมผสานการวิเคราะห์เชิงปริมาณ (Quantitative) และ การวิเคราะห์ปัจจัยพื้นฐาน (Fundamental)

Quantitative



- การประมวลผลจากข้อมูลที่มีปริมาณมาก
- ตัดปัจจัยด้านอารมณ์ (Emotional) และความลำเอียง (Bias) ออกไป
- การทำ Backtesting กับข้อมูลเพื่อดูโอกาสและความเสี่ยง



Fundamental

- อาศัยความเข้าใจในธุรกิจผ่านประสบการณ์ของผู้จัดการกองทุน
- การคาดการณ์อนาคตที่ไม่สามารถบอกได้ด้วยตัวเลขในอดีต
- Contextual Insight เข้าใจบริบทที่จะเกิดขึ้น หรือ วิกฤตที่ซับซ้อน



Quantamental Investment

“เป็นการสร้างผลตอบแทนส่วนเพิ่ม (Alpha) โดยการวิเคราะห์ปัจจัยในทุกวัฏจักรของตลาด และนำกรอบการลงทุนมาใช้ร่วมกับกระบวนการคัดเลือกและการบริหารความเสี่ยงอย่างมีวินัย เพื่อสร้างพอร์ตการลงทุน และมุ่งเน้นผลตอบแทนที่ยั่งยืน”

โปรดทำความเข้าใจลักษณะสินค้า เงื่อนไข ผลตอบแทนและความเสี่ยงก่อนตัดสินใจลงทุน / ผลการดำเนินงานในอดีตมิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต การลงทุนในกองทุนรวมที่ลงทุนในต่างประเทศมีความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยนซึ่งอาจทำให้ได้รับเงินคืนสูงกว่าหรือต่ำกว่าเงินลงทุนเริ่มแรกได้

สอบถามข้อมูลเพิ่มเติมและขอรับหนังสือชี้ชวนในวันและเวลาเสนอขายได้ที่ บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน เฟิร์ส พลัส (ประเทศไทย) จำกัด หรือ ผู้สนับสนุนการขายหรือรับซื้อคืนหน่วยลงทุนที่ได้รับแต่งตั้ง

FP QUANT

กองทุนเปิด เฟิร์ส พลัส โซน่า อีควิตี้ ควอนตาดิเมนชัน อัลฟ่า

โมเดล Quantamental จากเฟิร์ส พลัส

โมเดล Quantamental เป็นการผสานการวิเคราะห์เชิงปัจจัยพื้นฐานและเชิงปริมาณเข้าด้วยกัน เพื่อสร้างผลตอบแทนส่วนเพิ่ม (Alpha) ที่ยั่งยืนและเติบโตอย่างสม่ำเสมอ

พื้นฐานทางเศรษฐศาสตร์
Strong Economic Foundation

ผลการดำเนินงานที่ยั่งยืน
Long-Term Return Sustainability

ทนต่อความผันผวน
Resilience in Extreme Market Conditions

โมเดล Quantamental ถูกพัฒนามาจากทฤษฎีการกำหนดราคาหลักทรัพย์ที่ทันสมัย จึงช่วยให้ผลตอบแทนมีเสถียรภาพและยั่งยืนมากกว่ากลยุทธ์ Quant แบบดั้งเดิม

โมเดล Quantamental สามารถสร้างผลตอบแทนที่เหนือกว่าได้อย่างสม่ำเสมอในระยะยาว และใช้ได้ในทุกสภาวะตลาด

โมเดล Quantamental แสดงให้เห็นถึงความสามารถในการรับมือได้อย่างโดดเด่นในช่วงตลาดขาลง เช่น วิกฤตปี 2015-2016, การปรับฐานปี 2018 และตลาดที่ปรับตัวลดลงในปี 2022 โดยสามารถสร้างผลตอบแทนที่เหนือกว่า

ความแตกต่างของ First Plus Quantamental กับ Traditional Quantitative

	First Plus Quantamental	Traditional Quantitative
หลักการสำคัญของกลยุทธ์	พัฒนามาจากทฤษฎีขั้นสูง เพื่อการกำหนดราคาหลักทรัพย์พร้อมด้วยเหตุผลทางเศรษฐศาสตร์ และการกำหนดปัจจัยที่สำคัญ	พึ่งพาข้อมูลที่มีจำนวนมาก ทำให้มีโอกาสที่นักลงทุนจะใช้ปัจจัยเดียวกัน มาเป็นส่วนประกอบในการตัดสินใจ
ความสม่ำเสมอของผลตอบแทนในระยะยาว	ผลตอบแทนเฉลี่ยต่อปีมากกว่า 25% พร้อมสร้างผลตอบแทนเหนือกว่าตลาดอย่างสม่ำเสมอในทุก Market Cycle	ผลตอบแทนโดดเด่นในระยะสั้น แต่ในระยะยาวกลับลดลง
ความครอบคลุมหลายตลาด	มีประสิทธิภาพทั้งในตลาดหุ้นจีน A-share และตลาดสหรัฐฯ	ออกแบบมาสำหรับตลาดเดียวเป็นหลัก
ระดับเงินลงทุน	รองรับเงินลงทุนได้สูง	รองรับเงินลงทุนได้จำกัด
Drawdown	มีการปรับตัวลดลงเฉลี่ยเพียง -2% ยกตัวอย่างในช่วงวิกฤตสภาพคล่องปี 2024	ขาดทุนหนักถึง -15% ในบางช่วงเวลาที่ตลาดผันผวนรุนแรง

อ้างอิงข้อมูลผลการทดสอบโมเดล Quantamental ผลตอบแทนย้อนหลัง (Backtesting) ตั้งแต่ไตรมาส 1 ปี 2014 - ธันวาคม 2024 โดย First Plus Asset Management Pte. Ltd.

โปรดทำความเข้าใจลักษณะสินค้า เงื่อนไข ผลตอบแทนและความเสี่ยงก่อนตัดสินใจลงทุน / ผลการดำเนินงานในอดีตมิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต การลงทุนในกองทุนรวมที่ลงทุนในต่างประเทศมีความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยนซึ่งอาจทำให้ได้รับเงินคืนสูงกว่าหรือต่ำกว่าเงินลงทุนเริ่มแรกได้

FP QUANT

กองทุนเปิด เฟิร์ส พลัส โซน่า อีควิตี้ ควอนตาดิเมนชัน อัลฟ่า

เกี่ยวกับกองทุน

ประเภทกองทุน

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

ชนิดหน่วยลงทุน

ชนิดสะสมมูลค่า (FP QUANT-A) และ ชนิดผู้ลงทุนสถาบัน (FP QUANT-I)

จำนวนเงินลงทุนโครงการ

1,000 ล้านบาท

อายุโครงการ

ไม่กำหนดอายุโครงการ

นโยบายและกลยุทธ์

การลงทุน

ลงทุนในตราสารทุนโดยจะเน้นลงทุนในตลาดหุ้นของบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์เซี่ยงไฮ้ (SSE) และ ตลาดหลักทรัพย์เซินเจิ้น (SZSE) ของจีนแผ่นดินใหญ่ (A-Shares) โดยมี Net Exposure ในตราสารดังกล่าว โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุนรวม โดยกองทุนจะใช้กลยุทธ์เชิงปริมาณ (Quantitative Strategy) ที่พัฒนาขึ้นเฉพาะ ด้วยแนวทางการลงทุนแบบ Quantamental ประกอบด้วยการวิเคราะห์เชิงปัจจัยพื้นฐาน (Fundamental) และการวิเคราะห์เชิงปริมาณ (Quantitative) 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. เป็นผู้รับมอบหมายงานด้านการจัดการลงทุนของกองทุน (Outsource Fund Manager)

กองทุนอาจลงทุนใน Derivatives เพื่อ FX Hedging หรือเพื่อเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารกองทุน (EPM) ตามดุลยพินิจของผู้จัดการกองทุน (Dynamic Hedging)

ค่าธรรมเนียม/ค่าใช้จ่ายเรียกเก็บจากกองทุน*

(* ต่อปีของมูลค่าทรัพย์สินทั้งหมดหักด้วยมูลค่าที่คืนทั้งหมด ก่อนหักค่าธรรมเนียมการจัดการ ผู้ดูแลผลประโยชน์ และนายทะเบียนหน่วยลงทุน ณ วันที่คำนวณ)

ค่าธรรมเนียมการจัดการ

FP QUANT-A ไม่เกิน 2.1400% (เก็บจริง 1.6050%) / FP QUANT-I ไม่เกิน 1.8725% (เก็บจริง 1.00%)

ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์

ไม่เกิน 0.1070% (เก็บจริง 0.0550%)

ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน

ไม่เกิน 0.1070% (เก็บจริง 0.0642%)

ค่าธรรมเนียม/ค่าใช้จ่ายเรียกเก็บจากผู้ถือหน่วยลงทุน*

ค่าธรรมเนียมการขาย (Front-End Fee)

FP QUANT-A ไม่เกิน 2.00% (เก็บจริง 1.50%) / FP QUANT-I ไม่เกิน 2.00% (ยกเว้นไม่เรียกเก็บ)

ค่าธรรมเนียมการรับซื้อคืน (Back-End Fee)

ไม่เกิน 2.00% (ยกเว้นไม่เรียกเก็บ)

ค่าธรรมเนียมการสับเปลี่ยน (Switching Fee) ไม่มี

* ผู้ถือหน่วยลงทุนสามารถดูรายละเอียดอัตราการเก็บค่าธรรมเนียมเพิ่มเติมได้จากหนังสือชี้ชวนส่วนรายละเอียดโครงการ

มูลค่าเงินลงทุนขั้นต่ำครั้งแรก

FP QUANT-A 1,000 บาท / FP QUANT-I 10,000,000 บาท

มูลค่าเงินลงทุนขั้นต่ำครั้งถัดไป

ไม่จำกัด

วันและเวลาทำการซื้อหน่วยลงทุน

ทุกวันและเวลาทำการภายใน 15.30 น.

วันและเวลาทำการขายคืนหน่วยลงทุน

ทุกวันและเวลาทำการภายใน 15.30 น.

Fund Fact Sheet



FP QUANT-A FP QUANT-I

โปรดทำความเข้าใจลักษณะสินค้า เงื่อนไข ผลตอบแทนและความเสี่ยงก่อนตัดสินใจลงทุน / ผลการดำเนินงานในอดีตมิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต การลงทุนในกองทุนรวมที่ลงทุนในต่างประเทศมีความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยนซึ่งอาจทำให้ได้รับเงินคืนสูงกว่าหรือต่ำกว่าเงินลงทุนเริ่มแรกได้