



SCBABSAP

กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Asia Pacific Equity Absolute Return

เสนอขายครั้งแรก: 24 มิ.ย. 68 - 30 มิ.ย. 68

Complex Fund

นโยบายการลงทุน: เน้นลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมต่างประเทศเพียงกองทุนเดียว ได้แก่ BlackRock Systematic Asia Pacific Equity Absolute Return Fund ชนิดหน่วยลงทุน D2 U.S. Dollar โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน

ความเสี่ยง: ระดับ 6 – กองทุนประเภทตราสารทุน (Complex)



จุดเด่นของ SCBABSAP

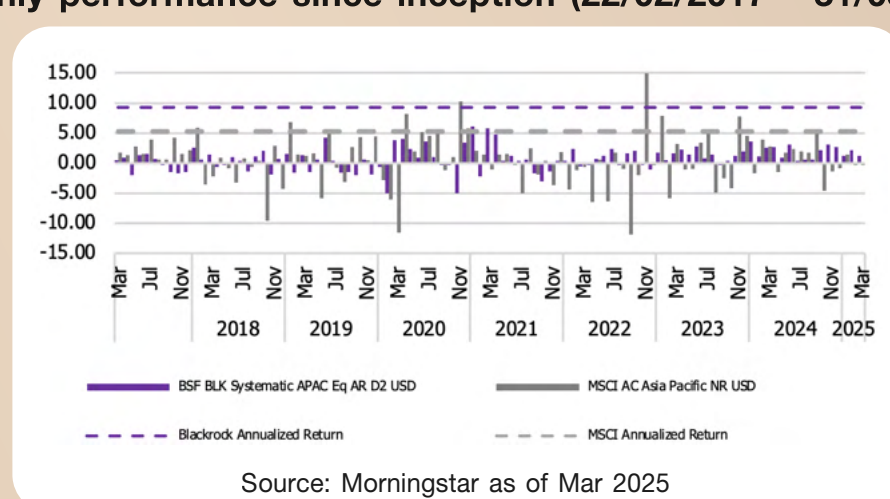
กองทุนหลักใช้ตราสารอนุพันธ์ทั้ง Long และ Short ในหุ้นขนาดใหญ่และเล็กของภูมิภาคเอเชียแปซิฟิก รวมถึงออสเตรเลีย และญี่ปุ่น เพื่อลดความเสี่ยงด้านทิศทางตลาด

Annualized return & Standard Deviation since inception (22/02/2017 – 31/03/2025)

Index	Return	Standard Deviation
BSF BLK Systematic APAC Eq AR D2 USD	9.3	6.8
S&P GSCI TR USD	6.0	21.5
Bloomberg Global Aggregate TR USD	0.5	6.6
MSCI AC Asia Pacific NR USD	5.3	14.8

Source: Morningstar as of Mar 2025

Monthly performance since inception (22/02/2017 – 31/03/2025)



Source: Morningstar as of Mar 2025

มุ่งสร้างผลตอบแทนเป็นบวกผ่านกลยุทธ์ลงทุนแบบ Market Neutral

กองทุนหลักสร้างผลตอบแทนรายเดือนเป็นบวกได้ถึง 67 เดือนจาก 97 เดือน (vs ดัชนี MSCI AC Asia Pacific ที่มีผลตอบแทนเป็นบวก 56 เดือนจาก 97 เดือน) และมีผลตอบแทนเฉลี่ยรายปีสูงกว่าดัชนี พร้อมสอดคล้องการลงทุนเพื่อความยั่งยืนตามเกณฑ์ SFDR Article 8

กระบวนการลงทุนอย่างเป็นระบบโดยผู้เชี่ยวชาญประสบการณ์สูง

ผนวกเทคโนโลยี AI ที่พัฒนาอย่างต่อเนื่อง ประเมิน และจัดอันดับหุ้นมากกว่า 4,500 ทุกวัน เพื่อสร้างพอร์ตที่มีประสิทธิภาพ พมพสานการคาดการณ์ผลตอบแทน ความเสี่ยง และต้นทุน

กองทุนหลักได้รับ Morningstar 5 ดาว

จากกลุ่ม EAA Fund Equity Market Neutral USD, ณ 31 พ.ค. 2568

ลักษณะของหุ้นที่กองทุนหลักลงทุน

หุ้นที่มีพื้นฐานที่น่าสนใจ

Company Fundamentals

หุ้นที่ได้แรงหนุนจากปัจจัยเศรษฐกิจมหภาคที่หลากหลาย

Macro Themes

หุ้นที่ได้รับ การสนับสนุนจากความเชื่อมั่นเชิงบวก และความเสี่ยงที่ลดลง

Market Sentiment

หุ้นที่ใส่ใจด้าน ESG

ESG

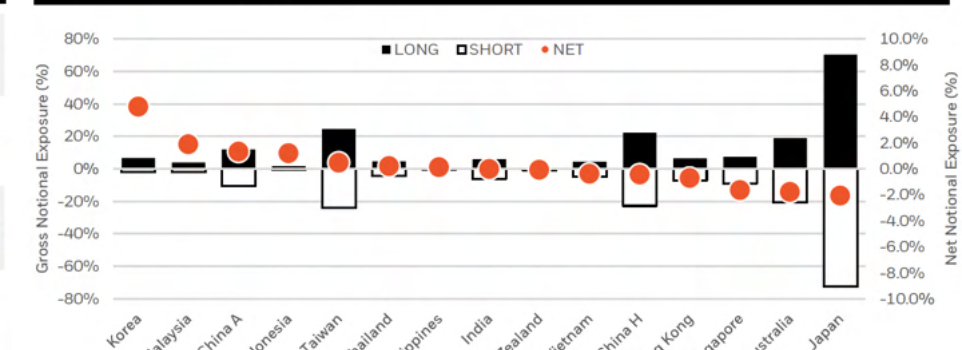
Source: BlackRock's Presentation as of April 2025

ลักษณะของพอร์ตกองทุนหลัก

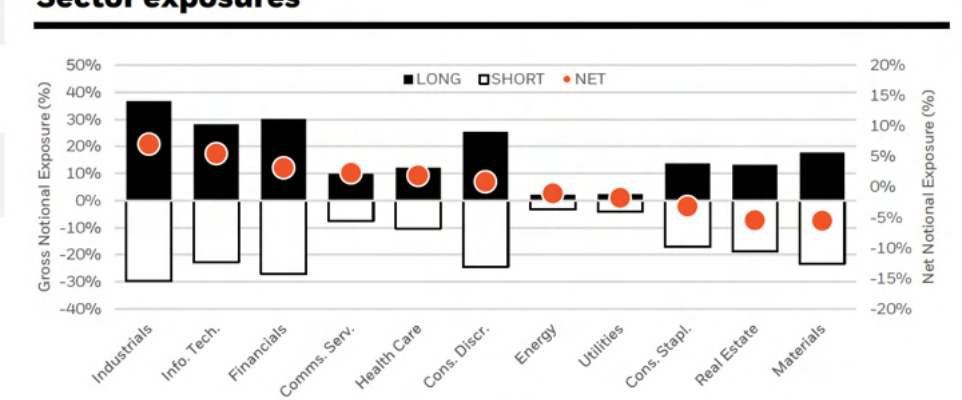
Characteristics

NAV (\$m)	\$515m
Long Value (\$m)	\$953.5m
Short Value (\$m)	-\$905.4m
Long gearing	190%
Short gearing	-180%
Gross exposure	371%
Net Exposure	2.3%

Country exposures

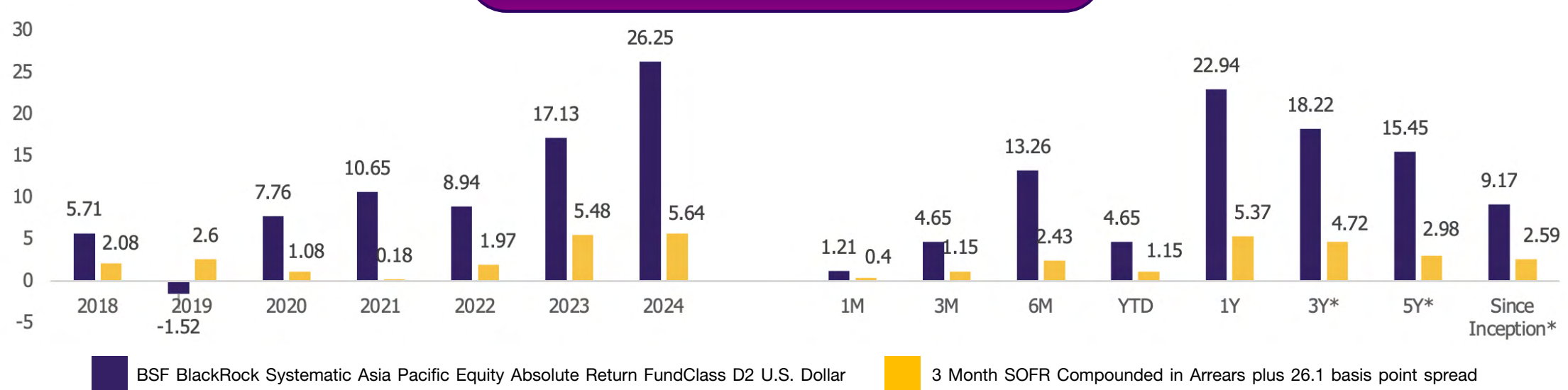


Sector exposures



Source: BlackRock, all data as 31 March 2025

ผลการดำเนินงานกองทุนหลัก



Source: Master fund factsheet as of March 2025 *Annualized Return

The figures shown relate to past performance. Past performance is not a reliable indicator of current or future performance and should not be the sole factor of consideration when selecting a product or strategy. Share Class and Benchmark performance displayed in USD, hedged share class benchmark performance is displayed in USD. Performance is shown on a Net Asset Value (NAV) basis, with gross income reinvested where applicable. The return of your investment may increase or decrease as a result of currency fluctuations if your investment is made in a currency other than that used in the past performance calculation. Source: BlackRock

คำเตือน
Complex Fund กองทุนรวมที่มีความเสี่ยงสูงหรือซับซ้อน • กองทุนหลักใช้แบบจำลองที่เป็นกรรมสิทธิ์ของผู้จัดการลงทุน ซึ่งรวมถึงการวิเคราะห์เชิงปริมาณ อย่างไรก็ตาม ผลการดำเนินงานอาจแตกต่างจากที่คาดการณ์ไว้เนื่องจากปัจจัยที่ใช้วิเคราะห์ในแบบจำลอง การให้น้ำหนักแต่ละปัจจัย แนวโน้มในอดีตที่เปลี่ยนแปลงไป และปัญหาในการสร้างและใช้งานแบบจำลอง โดยกองทุนหลักไม่มีการรับประกันว่าแบบจำลองดังกล่าวจะส่งผลให้การตัดสินใจลงทุนมีประสิทธิภาพ เนื่องจากข้อมูลที่ใช้ในแบบจำลองอาจเป็นข้อมูลที่ได้รับมาจากบุคคลที่สาม ซึ่งอาจไม่ถูกต้องและครบถ้วน ส่งผลให้ประสิทธิภาพของแบบจำลองมีข้อจำกัด นอกจากนี้ ข้อมูลบางส่วนเป็นข้อมูลในอดีต จึงมีแนวโน้มที่จะไม่สามารถคาดการณ์การเคลื่อนไหวของตลาดในอนาคตได้อย่างแม่นยำ • ผลการดำเนินงานในอดีตมิใช่สิ่งยืนยันผลการดำเนินงานในอนาคต • กองทุนไม่ได้ป้องกันความเสี่ยงอัตราแลกเปลี่ยนทั้งจำนวน ผู้ลงทุนอาจขาดทุน หรือได้รับกำไรจากอัตราแลกเปลี่ยน หรือได้รับเงินคืนต่ำกว่าเงินลงทุนเริ่มแรกได้ • ควรทำความเข้าใจลักษณะสินค้า เงื่อนไขผลตอบแทน ความเสี่ยงที่เกี่ยวข้อง และขอคำแนะนำเพิ่มเติมจากผู้ประกอบธุรกิจก่อนตัดสินใจลงทุน สอบถามรายละเอียดเพิ่มเติม และขอรับหนังสือชี้ชวนได้ที่ธนาคารไทยพาณิชย์ หรือ บลจ.ไทยพาณิชย์ โทร. 0 2777 7777 www.scbam.com

บลจ.ไทยพาณิชย์ SCB