

SCBUSDABSAP

กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Asia Pacific Equity Absolute Return USD

เสนอขายครั้งแรก: 7 ต.ค. 68 – 15 ต.ค. 68

Complex Fund

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

ความเสี่ยง: ระดับ 6 – กองทุนประเภทตราสารทุน (Complex)

- กองทุนหลักใช้ตราสารอนุพันธ์ทั้ง long และ short position ในหุ้นขนาดใหญ่และเล็กของภูมิภาคเอเชียแปซิฟิก รวมถึงออสเตรเลีย และญี่ปุ่น เพื่อลดความเสี่ยงด้านทิศทางตลาด

- กองทุนมี ความสัมพันธ์กับตลาดหุ้นต่ำ และ จำกัดความผันผวนพอร์ตที่ 6 - 8% โดยเฉลี่ยต่อปี โดยปัจจุบันกองทุนหลักมีความผันผวนอยู่ที่ 6.7% โดยเฉลี่ยตั้งแต่จัดตั้งกองทุน

Annualized return & Standard Deviation since inception (22/02/2017 – 31/08/2025)

Benchmark	Return	Standard Deviation
BSF BLK Systematic APAC Eq AR D2 USD	8.9	6.7
S&P GSCI TR USD	5.8	21.2
Bloomberg Global Aggregate TR USD	0.9	6.6
MSCI AC Asia Pacific NR USD	7.0	14.6

Source: Morningstar as of August 2025

Monthly performance since inception (22/02/2017 – 31/08/2025)

Source: Morningstar as of August 2025

- บริหารเชิงรุก ซึ่งใช้แบบจำลองเชิงปริมาณ (Quantitative Models) เพื่อคัดเลือกลงอย่างเป็นระบบโดยผู้เชี่ยวชาญผสมกับเทคโนโลยี AI ในการเข้าถึงข้อมูลท้องถิ่นของแต่ละประเทศ

- กองทุนหลักได้รับ Morningstar Rating 5 ดาว จากกลุ่ม EAA Fund Equity Market Neutral USD (as of August 2025)

ลักษณะของหุ้นที่กองทุนหลักลงทุน

- หุ้นที่มีพื้นฐานที่น่าสนใจ
- หุ้นที่ได้รับความสนับสนุนจากความเชื่อมั่นเชิงบวกและความเคลื่อนไหวตลาด
- หุ้นที่ใส่ใจด้าน ESG

Source: BlackRock's Presentation as of April 2025

ลักษณะของพอร์ตกองทุนหลัก

Characteristic	Value
NAV(\$m)	\$1,137m
Long Value (\$m)	1,801
Short Value (\$m)	-1,675
Long Gearing	180.77%
Short Gearing	-179.76%
Gross Exposure	360.53%
Net Exposure	1.01%

Country exposures

Sector exposures

Source: BlackRock, all data as at July 2025

ผลการดำเนินงานกองทุนหลัก

Year	BSF BlackRock Systematic Asia Pacific Equity Absolute Return FundClass D2 U.S. Dollar	3 Month SOFR Compounded in Arrears plus 26.1 basis point spread
2018	5.71	2.08
2019	(1.52)	2.6
2020	7.76	1.08
2021	10.65	0.18
2022	8.94	1.97
2023	17.13	5.48
2024	26.25	5.64

ผลการดำเนินงานในอดีตมิใช่สิ่งยืนยันผลการดำเนินงานในอนาคต

The figures shown relate to past performance. Past performance is not a reliable indicator of current or future results and should not be the sole factor of consideration when selecting a product or strategy. Index performance returns do not reflect any management fees, transaction costs or expenses. Indices are unmanaged and one cannot invest directly in an index. Returns are net of fees and based on the dealing NAV of the \$A2 share class, which does not distribute income. All data in US Dollars. Source: BlackRock as of 31 August 2025.

* Inception Date 22 February 2017.

† During this period performance was achieved under circumstances that no longer apply. Prior to 15 December 2021, the Fund used a different benchmark which is reflected in the benchmark data.

คำเตือน

Complex Fund กองทุนรวมที่มีความเสี่ยงสูงหรือซับซ้อน • กองทุนหลักใช้แบบจำลองที่เป็นกรรมสิทธิ์ของผู้จัดการลงทุน ซึ่งรวมถึงการวิเคราะห์เชิงปริมาณ อย่างไรก็ตามผลการดำเนินงานอาจแตกต่างจากที่คาดการณ์ไว้เนื่องจากปัจจัยที่ใช้วิเคราะห์ในแบบจำลอง 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