



Mutual Funds Report

กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ แอปโซลูท
รีเทิร์น (SCBABSFUND)

รายงานประจำ 6 เดือน
ตั้งแต่วันที่ 1 พฤษภาคม 2564 ถึงวันที่ 31 ตุลาคม 2564

สารจากบริษัทจัดการ

เรียน ท่านผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุน

กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ แอปโซลูท รีเทิร์น (SCBABSFUND) เป็นกองทุนที่ลงทุนในหลักทรัพย์จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ ดังนั้นผลตอบแทนโดยรวมอาจผันผวนตามดัชนีตลาดหลักทรัพย์ ทั้งนี้ในรอบ 6 เดือนที่ผ่านมาตั้งแต่วันที่ รอบระยะเวลาบัญชี 1 พฤษภาคม 2564 - 31 ตุลาคม 2564 ดัชนีตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยปรับตัวเพิ่มขึ้นร้อยละ 2.5 มาปิดที่ระดับ 1623.43 จุด

ในช่วงครึ่งปีแรกของปี 2564 ดัชนีตลาดหุ้นไทยผันผวนในกรอบ 1400 – 1600 โดยมีปัจจัยหนุนจาก ตลาดหุ้นทั่วโลกที่ปรับตัวสูงขึ้นจากมุมมองเชิงบวกต่อการฟื้นตัวทางเศรษฐกิจ ภายหลังที่หลายประเทศได้เริ่มการฉีดวัคซีนให้แก่ประชาชน ประกอบกับความคาดหวังต่อมาตรการกระตุ้นเศรษฐกิจของโจ ไบเดน ทำให้ภาคธุรกิจเริ่มมีการกักตุนวัตถุดิบสำหรับผลิตสินค้าเพื่อเตรียมพร้อมสำหรับการฟื้นตัวทางเศรษฐกิจที่คาดว่าจะเริ่มชัดเจนในช่วงครึ่งปีหลัง อย่างไรก็ตาม ตลาดก็กำลังเผชิญแรงกดดันจากการพบผู้ติดเชื้อกลุ่มใหม่ ประกอบกับการปรับตัวขึ้นของอัตราผลตอบแทนพันธบัตร (bond yield) จากความกังวลว่าอัตราเงินเฟ้อจะเร่งตัวจนทำให้ธนาคารกลางต่างๆ อาจกลับมาใช้นโยบายการเงินที่ตึงตัวขึ้น กระทั่งต่อการลงทุนในสินทรัพย์ต่างๆ ตั้งแต่ทองคำจนถึงตลาดหุ้นทั่วโลก

ในช่วงไตรมาสที่ 3 ของปี 2564 ดัชนีตลาดหุ้นไทยผันผวนในกรอบ 1500 – 1650 โดยได้รับปัจจัยหนุนจากจำนวนผู้ติดเชื้อไวรัส COVID-19 ที่ปรับตัวลดลงจนน้อยกว่าจำนวนผู้ป่วยที่หายจากการป่วย ส่งผลให้ราคาหุ้นในธีมเปิดเมือง (Reopening theme) ปรับตัวขึ้น ปรับตัวสูงขึ้น ในขณะที่เกิดแรงหนุนเพิ่มจากการปรับโครงสร้างของกลุ่มธนาคารพาณิชย์ นำโดยธนาคารไทยพาณิชย์ ซึ่งกำลังปรับโครงสร้างบริษัทเพื่อรองรับธุรกิจ FinTech และนำไปสู่การปรับมูลค่ากิจการจากเดิมที่ Valuation อยู่ในระดับ Distressed Level รวมไปถึงการปรับตัวสูงขึ้นของหุ้นกลุ่มสินค้าโภคภัณฑ์ ตามภาพราคาสินค้าโภคภัณฑ์ที่ปรับตัวสูงขึ้นอย่างต่อเนื่อง จากอุปสงค์ที่คาดว่าจะฟื้นตัวภายหลังการติดเชื้อไวรัส COVID-19 ในหลายประเทศที่ชะลอความรุนแรง

สำหรับแนวโน้มตลาดหุ้นในระยะถัดไปคาดว่าจะยังมีโอกาสปรับตัวผันผวนในขาขึ้นตามแนวโน้มผลประกอบการของบริษัทจดทะเบียนที่ยังฟื้นตัวหรือเติบโตได้ดี โดยเฉพาะอย่างยิ่งกลุ่มที่ได้รับประโยชน์จากราคาสินค้าโภคภัณฑ์ที่ปรับตัวขึ้นและทรงตัวในระดับสูง ในขณะที่ความอึดอัดการฉีดวัคซีนทั้งภายในประเทศและต่างประเทศมีแนวโน้มสูงขึ้น โดยเฉพาะอย่างยิ่งในประเทศมหาอำนาจทางเศรษฐกิจที่เริ่มกลับมาเปิดประเทศ ในขณะที่บางประเทศผ่อนคลายความเข้มงวดของมาตรการล็อกดาวน์พร้อมกับเร่งออกมาตรการกระตุ้นเศรษฐกิจ ซึ่งคาดว่าจะส่งผลดีต่อการฟื้นตัวของเศรษฐกิจในไม่ช้าและจะทำให้หนักท้องที่เกี่ยวทั่วโลกกลับมาคึกคัก อย่างไรก็ตาม ปัจจัยภายในประเทศที่นักลงทุนต้องติดตามคือ อัตราการระบาดระลอกที่ 3 ที่ยังรุนแรงอยู่ซึ่งจะส่งผลกระทบต่อทิศทางผ่อนคลายมาตรการกักตัว การเดินทางเข้าประเทศ โดยนักท่องเที่ยวอาจไม่มีความจำเป็นต้องกักตัวหากมีการฉีดวัคซีนและมีใบรับรองการฉีดวัคซีนแล้วและเข้ามาในพื้นที่นำร่อง รวมไปถึงมาตรการทางเศรษฐกิจและการเงินที่จะช่วยเหลือเยียวยาผู้ที่ได้รับผลกระทบจากการล็อกดาวน์ซึ่งคาดว่าจะส่งผลกระทบต่อเศรษฐกิจ ผลการดำเนินงานของบริษัทจดทะเบียน รวมไปถึงความผันผวนของตลาดหุ้นโดยรวมในระยะสั้น

สุดท้ายนี้ บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด ขอขอบพระคุณผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุนทุกท่านที่ได้มอบความไว้วางใจลงทุนในกองทุนรวมของ บลจ. ด้วยดีเสมอมา

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด

ความเห็นของผู้ดูแลผลประโยชน์

เรียน ผู้ถือหน่วยลงทุน กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ แอปโซลูท รีเทิร์น

ข้าพเจ้า บมจ.ธนาคารกสิกรไทย ในฐานะผู้ดูแลผลประโยชน์ได้ดูแลการจัดการ กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ แอปโซลูท รีเทิร์น ซึ่งจัดการโดย บริษัท หลักทรัพย์จัดการกองทุนไทยพาณิชย์ จำกัด สำหรับระยะเวลาดังตั้งแต่วันที่ 1 พฤษภาคม พ.ศ. 2564 ถึงวันที่ 31 ตุลาคม พ.ศ. 2564 แล้ว

ข้าพเจ้าเห็นว่า บริษัท หลักทรัพย์จัดการกองทุนไทยพาณิชย์ จำกัด ได้ปฏิบัติหน้าที่ในการจัดการ กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ แอปโซลูท รีเทิร์น เหมาะสมตามสมควรแห่งวัตถุประสงค์ ที่ได้ กำหนดไว้ในโครงการและภายใต้พระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535

ผู้ดูแลผลประโยชน์

บมจ. ธนาคารกสิกรไทย

(นายศิริวุฒิ เจียมบุรเศรษฐ์)

(นางสาวนันทิกา กระแสร์เพิ่ม)

ผู้ช่วยผู้อำนวยการ ฝ่ายบริการธุรกิจหลักทรัพย์ หัวหน้าส่วน ฝ่ายบริการธุรกิจหลักทรัพย์

วันที่ 5 พฤศจิกายน พ.ศ. 2564

ผลการดำเนินงาน
ข้อมูล ณ วันที่ 29 ตุลาคม 2564

ผลตอบแทนจากการลงทุน	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี	3 ปี	5 ปี	10 ปี	ตั้งแต่จัดตั้ง
SCBABS	-1.20%	-3.81%	-4.82%	-8.78%	-3.96%	n.a.	n.a.	-2.81%
ความผันผวนของผลการดำเนินงาน	4.64%	2.14%	2.82%	7.95%	5.76%	n.a.	n.a.	5.16%

หมายเหตุ : เอกสารการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวมฉบับนี้ ได้จัดทำขึ้นตามมาตรฐานการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวมของสมาคมบริษัทจัดการลงทุน

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด
กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ แอปโซลูท รีเทิร์น
รายละเอียดหลักทรัพย์ และสัดส่วนการลงทุน
ณ วันที่ 31 ตุลาคม 2564

ชื่อหลักทรัพย์	ราคา ณ 31 ต.ค. 2564 (บาท)	จำนวนหุ้น (หุ้น)	มูลค่า ตามราคาตลาด (บาท)	ร้อยละของมูลค่า ทรัพย์สินสุทธิ (%)	ค่าประกัน/รับรอง/รับ อวัล หรือสลิปหลังโอน แบบมีสิทธิไถ่เบี่ย
หลักทรัพย์จดทะเบียน			7,092,999.00	61.70%	
หุ้นสามัญ			7,092,999.00	61.70%	
การท่องเที่ยวและสันทนาการ			3,600.00	0.03%	
บมจ. โรงแรมเซ็นทรัลพลาซา(CENTEL)	36.00	100.00	3,600.00	0.03%	
การแพทย์			661,150.00	5.75%	
บมจ. โรงพยาบาลบำรุงราษฎร์(BH)	145.50	2,400.00	349,200.00	3.04%	
บมจ. บางกอก เชน ฮอस्पิตอล(BCH)	20.30	6,100.00	123,830.00	1.08%	
บมจ. เอกชัยการแพทย์(EKH)	8.10	12,200.00	98,820.00	0.86%	
บมจ. กรุงเทพดุสิตเวชการ(BDMS)	23.50	3,800.00	89,300.00	0.78%	
ขนส่งและโลจิสติกส์			753,710.00	6.56%	
บมจ. บีทีเอส กรุ๊ป โฮลดิ้งส์(BTS)	9.55	29,900.00	285,545.00	2.48%	
บมจ. อาร์ ซี แอล(RCL)	43.75	3,500.00	153,125.00	1.33%	
บมจ. โทรีเซน ไทย เอเยนซีส์(TTA)	11.60	10,900.00	126,440.00	1.10%	
บมจ. พรีเมียมส จีพี(PSL)	18.10	6,500.00	117,650.00	1.02%	
บมจ. ท่าอากาศยานไทย(AOT)	64.50	1,100.00	70,950.00	0.62%	
ชิ้นส่วนอิเล็กทรอนิกส์			232,000.00	2.02%	
บมจ. ฮานา ไมโครอิเล็กทรอนิกส์(HANA)	80.00	2,900.00	232,000.00	2.02%	
ธนาคาร			656,000.00	5.71%	
บมจ. ธนาคารกรุงเทพ(BBL)	122.50	3,200.00	392,000.00	3.41%	
บมจ. ธนาคารเกียรตินาคินภัทร(KKP)	60.00	4,400.00	264,000.00	2.30%	
ธุรกิจการเกษตร			130,000.00	1.13%	
บมจ. ศรีตรังแอโกรอินดัสทรี(STA)	32.50	4,000.00	130,000.00	1.13%	
บรรจุกัญชา			109,225.00	0.95%	
บมจ. เอสซีจี แพคเกจจิ้ง(SCGP)	64.25	1,700.00	109,225.00	0.95%	
พลังงานและสาธารณูปโภค			1,746,056.00	15.19%	
บมจ. ปตท. สำรวจและผลิตปิโตรเลียม(PTTEP)	117.50	4,600.00	540,500.00	4.70%	
บมจ. ผลิตไฟฟ้า(EGCO)	178.50	2,000.00	357,000.00	3.11%	
บมจ. ปตท.(PTT)	38.00	6,000.00	228,000.00	1.98%	
บมจ. โกลบอล เพาเวอร์ ซินเนอร์ยี่(GPSC)	78.00	1,900.00	148,200.00	1.29%	
บมจ. ราชา กรุ๊ป(RATCH)	45.50	2,200.00	100,100.00	0.87%	
บมจ. บี.กริม เพาเวอร์(BGRIM)	42.50	2,300.00	97,750.00	0.85%	
บมจ. จัดการและพัฒนาทรัพยากรน้ำภาคตะวันออก (EASTW)	10.10	8,800.00	88,880.00	0.77%	
บมจ. ซีเค พาวเวอร์(CKP)	5.05	14,000.00	70,700.00	0.62%	
บมจ. เอสพีซีจี(SPCG)	17.80	3,800.00	67,640.00	0.59%	

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด
 กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ แอปโซลูท รีเทิร์น
 รายละเอียดหลักทรัพย์ และสัดส่วนการลงทุน
 ณ วันที่ 31 ตุลาคม 2564

ชื่อหลักทรัพย์	ราคา ณ 31 ต.ค. 2564 (บาท)	จำนวนหุ้น (หุ้น)	มูลค่า ตามราคาตลาด (บาท)	ร้อยละของมูลค่า ทรัพย์สินสุทธิ (%)	ค่าประกัน/รับรอง/รับ อวัล หรือสลิปหลังโอน แบบมีสิทธิไถ่เบี่ย
บมจ.อุบล ปาโอ เอทานอล(UBE)	1.96	14,100.00	27,636.00	0.24%	
บมจ.พลังงานบริสุทธิ์(EA)	65.50	300.00	19,650.00	0.17%	
พัฒนาอสังหาริมทรัพย์			702,021.00	6.11%	
บมจ.เอพี (ไทยแลนด์)(AP)	8.85	69,400.00	614,190.00	5.34%	
บมจ.แสนสิริ(SIRI)	1.26	55,600.00	70,056.00	0.61%	
บมจ.เซ็นทรัลพัฒนา(CPN)	59.25	300.00	17,775.00	0.15%	
พาณิชย์			492,305.00	4.28%	
บมจ.คอมเซเว่น(COM7)	71.75	2,300.00	165,025.00	1.44%	
บมจ.โฮม โปรดักส์ เซ็นเตอร์(HMPRO)	14.60	9,900.00	144,540.00	1.26%	
บมจ.ดูโฮม(DOHOME)	23.90	5,000.00	119,500.00	1.04%	
บมจ.สยามโกลบอลเฮ้าส์(GLOBAL)	20.40	3,100.00	63,240.00	0.55%	
ยานยนต์			104,550.00	0.91%	
บมจ.สมบูรณ์ แอ็ดวานซ์ เทคโนโลยี(SAT)	20.50	5,100.00	104,550.00	0.91%	
วัสดุก่อสร้าง			161,350.00	1.40%	
บมจ.ทีปโก้เอสพีเอส(TASCO)	18.30	4,500.00	82,350.00	0.72%	
บมจ.ปูนซิเมนต์ไทย(SCC)	395.00	200.00	79,000.00	0.69%	
อาหารและเครื่องดื่ม			636,532.00	5.54%	
บมจ.ไทยยูเนี่ยน กรุ๊ป(TU)	20.90	9,800.00	204,820.00	1.78%	
บมจ.เจริญโภคภัณฑ์อาหาร(CPF)	25.25	7,800.00	196,950.00	1.71%	
บมจ.โอสดสภา(OSP)	32.75	5,200.00	170,300.00	1.48%	
บมจ.น้ำตาลขอนแก่น(KSL)	3.86	16,700.00	64,462.00	0.56%	
เงินทุนและหลักทรัพย์			299,425.00	2.60%	
บมจ.อีออน ธนสินทรัพย์ (ไทยแลนด์)(AEONTS)	187.00	800.00	149,600.00	1.30%	
บมจ.ศรีสวัสดิ์ คอร์ปอเรชั่น(SAWAD)	64.00	1,300.00	83,200.00	0.72%	
บมจ.ราชธานีลิตรจิ่ง(THANI)	4.10	16,250.00	66,625.00	0.58%	
เทคโนโลยีสารสนเทศและการสื่อสาร			405,075.00	3.52%	
บมจ.แอดวานซ์ อินโฟร์ เซอร์วิส(ADVANC)	189.00	1,100.00	207,900.00	1.81%	
บมจ.โทเทิ่ล แอ็คเซ็ส คอมมูนิเคชั่น(DTAC)	38.25	3,700.00	141,525.00	1.23%	
บมจ.อินทัช โฮลดิ้งส์(INTUCH)	75.25	400.00	30,100.00	0.26%	
บมจ.เอสไอเอส ดิสทริบิวชั่น (ประเทศไทย)(SIS)	36.50	700.00	25,550.00	0.22%	
หลักทรัพย์ไม่จดทะเบียน			17,850.00	0.16%	
หุ้นสามัญ			17,850.00	0.16%	
สื่อและสิ่งพิมพ์			17,850.00	0.16%	
บมจ.เดอะ วัน เอ็นเตอร์ไพรส์(ONEE/U)	8.50	2,100.00	17,850.00	0.16%	

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด
กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ แอปโซลูท รีเทิร์น
รายละเอียดหลักทรัพย์ และสัดส่วนการลงทุน
ณ วันที่ 31 ตุลาคม 2564

ชื่อหลักทรัพย์	ราคา ณ 31 ต.ค. 2564 (บาท)	จำนวนหุ้น (หุ้น)	มูลค่า ตามราคาตลาด (บาท)	ร้อยละของมูลค่า ทรัพย์สินสุทธิ (%)	ค่าประกัน/รับรอง/รับ อาวัล หรือสลักหลังโอน แบบมีสิทธิไต่เบี่ย
ตราสารหนี้			2,997,110.79	26.07%	
ตราสารหนี้ในประเทศ			2,997,110.79	26.07%	
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย			2,997,110.79	26.07%	
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยจกที่ 41/91/64(CB22113A)	0.00	0.00	2,997,110.79	26.07%	
เงินฝากธนาคาร			1,051,896.64	9.15%	
บมจ.ธนาคารกสิกรไทย(KBANK)	0.00	0.00	970,022.54	8.44%	
บมจ.ธนาคาร ยูโอบี(UOBT)	0.00	0.00	81,874.10	0.71%	
สัญญาซื้อขาย Future			3,153,215.60	27.43%	
ฟิวเจอร์สที่อ้างอิงกับหุ้นสามัญ บมจ.ธนาคารทหาร ไทยธนชาต(TTBZ21)	1.17	236.00	180,552.00	1.57%	
ฟิวเจอร์สที่อ้างอิงกับหุ้นสามัญ บมจ.เค้าน้อย ฟู้ด แอนด์มาร์เก็ตติ้ง(TKNZ21)	6.65	18.00	102,079.80	0.89%	
ฟิวเจอร์สที่อ้างอิงกับหุ้นสามัญ บมจ.ซูเปอร์ เอน เนอร์ยี คอร์เปอร์ชั่น(SUPERZ21)	0.99	187.00	138,436.10	1.20%	
ฟิวเจอร์สที่อ้างอิงกับหุ้นสามัญ บมจ.ศรีตรังโกลฟส์ (ประเทศไทย)(STGTZ21)	30.55	8.00	210,320.00	1.83%	
ฟิวเจอร์สที่อ้างอิงกับหุ้นสามัญ บมจ. ปตท. น้ำมัน และการค้าปลีก(ORZ21)	27.90	20.00	467,266.90	4.06%	
ฟิวเจอร์สที่อ้างอิงกับหุ้นสามัญ บมจ. เคอรี่ เอ็กซ์ เพรส (ประเทศไทย)(KEXZ21)	37.77	9.00	288,585.00	2.51%	
ฟิวเจอร์สที่อ้างอิงกับหุ้นสามัญ บมจ.จัสมิน อินดอร์ เนชั่นแนล(JASZ21)	2.87	58.00	152,018.00	1.32%	
ฟิวเจอร์สที่อ้างอิงกับหุ้นสามัญ บมจ.อินทัช โฮลดิ้งส์ (INTUCHZ21)	75.12	2.00	133,252.00	1.16%	
ฟิวเจอร์สที่อ้างอิงกับหุ้นสามัญ บมจ.พลังงานบริสุทธิ์ (EAZ21)	65.51	2.00	102,296.00	0.89%	
ฟิวเจอร์สที่อ้างอิงกับหุ้นสามัญ บมจ. เซ็นทรัล รีเทล คอร์ปอเรชั่น(CRCZ21)	34.76	3.00	77,581.50	0.67%	
ฟิวเจอร์สที่อ้างอิงกับหุ้นสามัญ บมจ.เซ็นทรัลพัฒนา (CPNZ21)	59.80	4.00	136,894.80	1.19%	
ฟิวเจอร์สที่อ้างอิงกับหุ้นสามัญ บมจ.ซีพี ออลล์ (CPALLZ21)	64.50	5.00	226,662.50	1.97%	
ฟิวเจอร์สที่อ้างอิงกับหุ้นสามัญ บมจ.ช.การช่าง (CKZ21)	21.90	13.00	158,860.00	1.38%	

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด
 กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ แอปโซลูท รีเทิร์น
 รายละเอียดหลักทรัพย์ และสัดส่วนการลงทุน
 ณ วันที่ 31 ตุลาคม 2564

ชื่อหลักทรัพย์	ราคา ณ 31 ต.ค. 2564 (บาท)	จำนวนหุ้น (หุ้น)	มูลค่า ตามราคาตลาด (บาท)	ร้อยละของมูลค่า ทรัพย์สินสุทธิ (%)	ค่าประกัน/รับรอง/รับ อาวัล หรือสลักหลังโอน แบบมีสิทธิไถ่เบี่ย
ฟิวเจอร์สที่อ้างอิงกับหุ้นสามัญ บมจ. โรงแรม เซ็นทรัลพลาซา(CENTELZ21)	36.03	6.00	120,475.80	1.05%	
ฟิวเจอร์สที่อ้างอิงกับหุ้นสามัญ บมจ.เบอร์ลี่ ยุคเกอร์ (BJCZ21)	33.85	5.00	142,023.00	1.24%	
ฟิวเจอร์สที่อ้างอิงกับหุ้นสามัญ บมจ. โรงพยาบาล บำรุงราษฎร์(BHZ21)	146.15	4.00	290,762.40	2.53%	
ฟิวเจอร์สที่อ้างอิงกับหุ้นสามัญ บมจ.แอสเสท เวิร์ด คอร์ป(AWCZ21)	4.59	42.00	151,342.80	1.32%	
ฟิวเจอร์สที่อ้างอิงกับหุ้นสามัญ บมจ.เอเชีย เอวิเอชั่น (AAVZ21)	2.89	46.00	73,807.00	0.64%	
สินทรัพย์อื่น			(2,782,872.19)	(24.21%)	
หนี้สินอื่น			(34,965.29)	(0.30%)	
มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ			11,495,234.55	100.00%	
มูลค่าหน่วยลงทุน (บาท)	8.7971				

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด
กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ แอปโซลูทีฟริเทิร์น
รายงานสรุปเงินลงทุน
ณ วันที่ 31 ตุลาคม 2564

กลุ่มของตราสาร	มูลค่าตามราคาตลาด	%NAV
(ก) ตราสารภาครัฐ ได้แก่ ตั๋วแลกเงิน พันธบัตรรัฐบาล พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย พันธบัตร หรือตราสารแห่งหนึ่งที่กองทุนเพื่อการฟื้นฟูและพัฒนาสถาบันการเงิน หรือกระทรวงการคลัง เป็นผู้ออก ผู้รับรอง ผู้รับอ่าวัด หรือผู้ค้ำประกัน	2,997,110.79	26.07
(ข) ตราสารที่ธนาคารที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้น ธนาคารพาณิชย์ หรือบริษัทเงินทุนเป็นผู้ออก ผู้รับรอง ผู้รับอ่าวัด ผู้สละหลัก หรือผู้ค้ำประกัน	1,051,896.64	9.15
(ค) ตราสารที่มีบริษัทที่ได้รับ rating ในระดับ investment grade เป็นผู้ออก ผู้รับรอง ผู้รับอ่าวัด ผู้สละหลัก หรือผู้ค้ำประกัน	-	-
(ง) ตราสารที่มีบริษัทที่ได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือในระดับที่ต่ำกว่า investment grade หรือไม่มี rating เป็นผู้ออก ผู้รับรอง ผู้รับอ่าวัด ผู้สละหลัก หรือผู้ค้ำประกัน	-	-

สัดส่วนสูงสุด (Upper Limit) ที่บริษัทจัดการคาดว่าจะลงทุนในกลุ่ม (ง) 15 %NAV

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด
 กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ แอปโซลูท รีเทิร์น
 รายละเอียดตัวตราสารและอันดับความน่าเชื่อถือของตราสารทุกตัวใน Port
 ณ วันที่ 31 ตุลาคม 2564

ประเภท	ผู้ออก	ผู้ค้ำ/ผู้รับรอง/ผู้สืบทอด	วันครบกำหนด	อันดับความน่าเชื่อถือของผู้ออกตราสาร		มูลค่าหน้าตัว	มูลค่าตามราคาตลาด
				TRIS Rating	FITCH Rating		
พันธบัตร	ธนาคารแห่งประเทศไทย		13/01/2022			3,000,000.00	2,997,110.79
เงินฝากธนาคาร	บมจ.ธนาคาร ยูโอบี				AAA(tha)	-	81,874.10
	บมจ.ธนาคารกสิกรไทย				AA+(tha)	-	970,022.54

กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ แอปโซลูท รีเทิร์น

SCB ABSOLUTE RETURN FUND

แบบค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม

FUND'S DIRECT EXPENSES REPORT

ตั้งแต่วันที่ 01 พฤษภาคม 2564 ถึงวันที่ 31 ตุลาคม 2564

Period from 01 May 2021 to 31 October 2021

ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม * Fund's direct expenses	จำนวนเงิน หน่วย : พันบาท	ร้อยละต่อปีของ มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ
ค่าธรรมเนียมบริหารกองทุน (Management fee) - ชนิตสะสมมูลค่า (SCBABS)	90	1.61
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ (Trustee fee)	1	0.03
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน (Registrar fee)	4	0.07
ค่าที่ปรึกษาการลงทุน (Advisory fee)	-	-
ค่าธรรมเนียมธนาคาร (Bank fee)	2	0.03
ค่าใช้จ่ายอื่น ๆ (Other expenses)	-	-
รวมค่าใช้จ่ายทั้งหมด (Total Expense) **	97	1.74

* ค่าใช้จ่ายดังกล่าวได้รวมภาษีมูลค่าเพิ่มแล้ว / Including VAT

** ไม่รวมค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ และค่าธรรมเนียมต่าง ๆ ที่เกิดขึ้นจากการซื้อขายหลักทรัพย์

Excluding brokerage fee and other transactions fees

** ไม่รวมค่าภาษีเงินได้นิติบุคคลสำหรับเงินได้ตามมาตรา 40 (4) (ก) แห่งประมวลรัษฎากร

Not including corporate income tax for income under Section 40 (4) (a) of the Revenue Code

กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ แอปโซลูท รีเทิร์น (SCBABSFUND)

งบแสดงฐานะการเงิน

ณ วันที่ 31 ตุลาคม 2564

"ยังไม่ได้ตรวจสอบ"

"ยังไม่ได้สอบทาน"

บาท

สินทรัพย์

เงินลงทุนตามราคายุติธรรม	9,809,036.57
เงินฝากธนาคาร	969,192.96
ลูกหนี้จากเงินปันผลและดอกเบี้ย	6,040.55
ลูกหนี้จากการขายเงินลงทุน	18,968.25
เงินวางประกันตามสัญญาซื้อขายตราสารอนุพันธ์	726,746.40
ค่าใช้จ่ายรอตัดบัญชี	215.11
รวมสินทรัพย์	11,530,199.84

หนี้สิน

เจ้าหนี้จากการซื้อเงินลงทุน	17,850.00
ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย	16,372.97
หนี้สินอื่น	742.32
รวมหนี้สิน	34,965.29
สินทรัพย์สุทธิ	11,495,234.55

สินทรัพย์สุทธิ :-

ทุนที่ได้รับจากผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุน	13,066,996.61
บัญชีปรับสมดุล	(416,498.74)
กำไร(ขาดทุน)สะสมจากการดำเนินงาน	(1,155,263.32)
สินทรัพย์สุทธิ	11,495,234.55

จำนวนหน่วยลงทุนที่จำหน่ายแล้ว (หน่วย)

1,306,699.6606

สินทรัพย์สุทธิต่อหน่วยลงทุน

8.7971

กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ แอปโซลูท รีเทิร์น (SCBABSFUND)

งบกำไรขาดทุนเบ็ดเสร็จ

รอบระยะเวลาตั้งแต่วันที่ 1 พฤษภาคม 2564 ถึงวันที่ 31 ตุลาคม 2564

"ยังไม่ได้ตรวจสอบ"

"ยังไม่ได้สอบทาน"

บาท

รายได้จากการลงทุน

รายได้เงินปันผล

116,424.10

รายได้ดอกเบี้ย

6,965.93

รายได้ทั้งสิ้น

123,390.03

ค่าใช้จ่าย

ค่าธรรมเนียมจัดการ

89,894.90

ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์

1,494.27

ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน

3,646.01

ค่าใช้จ่ายอื่น

48,577.47

ค่าใช้จ่ายทั้งสิ้น

143,612.65

รายได้จากการลงทุนสุทธิ

(20,222.62)

รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิจากเงินลงทุน

รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิที่เกิดขึ้นจริง

(61,755.25)

รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิที่ยังไม่เกิดขึ้นจริง

(473,880.18)

รวมรายการกำไร(ขาดทุน)จากการลงทุนที่เกิดขึ้นและที่ยังไม่เกิดขึ้น

(535,635.43)

การเพิ่มขึ้น(ลดลง)ในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงานก่อนภาษีเงินได้

(555,858.05)

หัก ค่าใช้จ่ายภาษีเงินได้

221.60

การเพิ่มขึ้น(ลดลง)ในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงาน หลังหักภาษีเงินได้

(556,079.65)

รายงานการซื้อขายหลักทรัพย์และค่าใช้จ่ายต่าง ๆ

VOLUME TRADE AND EXPENSES REPORT

ตั้งแต่วันที่ 1 พฤษภาคม 2564 ถึง วันที่ 31 ตุลาคม 2564

Period from 1 May 2021 to 31 October 2021

	(พันบาท) / (Thousand Baht)
มูลค่าทรัพย์สินสุทธิเฉลี่ย / Average Net Assets Value	11,080
การซื้อขายหลักทรัพย์รวม / Volume Trade	
มูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์รวม	30,399
Total Volume Trade	
ค่าธรรมเนียมหน้าในการซื้อขายหลักทรัพย์รวม	47
Total Brokerage Fee	
ค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายอื่น ๆ รวม / Fee and other Expenses	97
	(ร้อยละ) / (Percentage)
สัดส่วนค่าธรรมเนียมหน้าในการซื้อขายหลักทรัพย์รวมคิดเป็นร้อยละของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์รวม	0.15
Brokerage Fee as Percentage of Total Trading Volume	
สัดส่วนค่าธรรมเนียมหน้าในการซื้อขายหลักทรัพย์รวมคิดเป็นร้อยละของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิเฉลี่ย	0.84
Brokerage Fee as Percentage of Average Net Assets Value	
สัดส่วนค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายอื่น ๆ รวมคิดเป็นร้อยละของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิเฉลี่ย	1.74
Fee and other Expenses as Percentage of Average Net Assets Value	
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุนของกองทุนรวม (PTR)	0.95
Portfolio Turnover Ratio (PTR)	

รายงานรายชื่อบริษัทนายหน้า และค่าธรรมเนียม ซื้อ-ขาย หลักทรัพย์

ของกองทุนเปิดไทยพาณิชย์ แอปโซลูทีฟ รีเทิร์น

ระหว่างวันที่ 1 พฤษภาคม 2564 ถึงวันที่ 31 ตุลาคม 2564

ลำดับที่	ชื่อบริษัทนายหน้า	ค่านายหน้า (พันบาท)	อัตราส่วนค่านายหน้าแต่ละราย ต่อค่านายหน้าทั้งหมด
1	บริษัทหลักทรัพย์ ไทยพาณิชย์ จำกัด	35.50	76.27%
2	บริษัทหลักทรัพย์ แมคควอรี (ประเทศไทย) จำกัด	4.91	10.54%
3	บริษัทหลักทรัพย์ ยูโอบี เคย์เฮียน (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)	1.72	3.69%
4	บริษัทหลักทรัพย์ อาร์เอชบี (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)	1.54	3.31%
5	บริษัทหลักทรัพย์ เครดิต สวิส (ประเทศไทย) จำกัด	1.31	2.82%
6	บริษัทหลักทรัพย์ ธนชาด จำกัด (มหาชน)	0.89	1.92%
7	บริษัทหลักทรัพย์ บัวหลวง จำกัด (มหาชน)	0.21	0.44%
8	บริษัทหลักทรัพย์ เมย์แบงก์ กิมเอ็ง (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)	0.18	0.38%
9	บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)	0.15	0.32%
10	บริษัทหลักทรัพย์ เคทีบี (ประเทศไทย) จำกัด	0.08	0.17%
11-13	บล.อื่นๆ	0.06	0.13%
รวม		46.55	100.00%

การรับผลประโยชน์ตอบแทนเนื่องจากการที่กองทุนใช้บริการบุคคลอื่น ประจำเดือน ตุลาคม 2564

BENEFIT FROM BROKERAGE SERVICES AS OF OCTOBER 2021

บริษัทที่ให้ผลประโยชน์	BROKERAGE HOUSES	ผลประโยชน์ที่ได้รับ*					
		บทวิเคราะห์ ¹	ข้อมูลพื้นฐาน ²	รายงานสรุปข่าว ³	สัมมนา ⁴	บรรยายกลยุทธ์การลงทุน ⁵	จัดเยี่ยมชมบริษัท ⁶
		Research Paper	Fundamental Data	News Summary	Seminar	Strategy Presentation	Company Visit
บริษัทหลักทรัพย์ เอเซีย พลัส จำกัด	ASIA PLUS SECURITIES COMPANY LIMITED	✓	✓	✓		✓	
บริษัทหลักทรัพย์ บัวหลวง จำกัด (มหาชน)	BUALUANG SECURITIES PUBLIC COMPANY LIMITED	✓	✓	✓	✓	✓	✓
บริษัทหลักทรัพย์ ซี แอล เอส อ (ประเทศไทย) จำกัด	CLSA SECURITIES (THAILAND) LIMITED	✓	✓	✓		✓	
บริษัทหลักทรัพย์ โนมูระ พัฒนสิน จำกัด (มหาชน)	CAPITAL NOMURA SECURITIES PUBLIC COMPANY LIMITED	✓	✓	✓		✓	✓
บริษัทหลักทรัพย์เครดิต สวิส (ประเทศไทย) จำกัด	CREDIT SUISSE SECURITIES (THAILAND) LIMITED	✓	✓	✓		✓	
บริษัทหลักทรัพย์ เมย์แบงก์ กิมเอ็ง (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)	MAYBANK KIM ENG SECURITIES (THAILAND) PUBLIC COMPANY LIMITED	✓	✓	✓		✓	✓
บริษัทหลักทรัพย์ กสิกรไทย จำกัด (มหาชน)	KASIKORN SECURITIES PUBLIC COMPANY LIMITED	✓	✓	✓	✓	✓	✓
บริษัทหลักทรัพย์ กรุงศรี จำกัด (มหาชน)	KRUNGSRI SECURITIES PUBLIC COMPANY LIMITED	✓	✓	✓		✓	✓
บริษัทหลักทรัพย์ เกียรตินาคินภัทร จำกัด (มหาชน)	KIATNAKIN PHATRA SECURITIES PUBLIC COMPANY LIMITED	✓	✓	✓	✓	✓	✓
บริษัทหลักทรัพย์ ไทยพาณิชย์ จำกัด	SCB SECURITIES COMPANY LIMITED	✓	✓	✓		✓	
บริษัทหลักทรัพย์ธนชาต จำกัด (มหาชน)	THANACHART SECURITIES PUBLIC COMPANY LIMITED	✓	✓	✓	✓	✓	✓
บริษัทหลักทรัพย์ ทิสโก้ จำกัด	TISCO SECURITIES COMPANY LIMITED	✓	✓	✓	✓	✓	✓
บริษัทหลักทรัพย์ ซีจีเอส-ซีบีเอ็ม (ประเทศไทย) จำกัด	CGS-CIMB SECURITIES (THAILAND) COMPANY LIMITED	✓	✓	✓		✓	✓
บริษัทหลักทรัพย์ ยูบีเอส (ประเทศไทย) จำกัด	UBS SECURITIES (THAILAND) LIMITED	✓	✓	✓	✓	✓	
บริษัทหลักทรัพย์ แมคควารี (ประเทศไทย) จำกัด	MACQUARIE SECURITIES (THAILAND) LIMITED	✓	✓	✓		✓	✓
บริษัทหลักทรัพย์ เคจีไอ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)	KGI SECURITIES (THAILAND) PUBLIC COMPANY LIMITED	✓	✓	✓		✓	
บริษัทหลักทรัพย์ ดีบีเอส วิกเคอร์ส (ประเทศไทย) จำกัด	DBS VICKERS SECURITIES (THAILAND) COMPANY LIMITED	✓	✓	✓		✓	✓
บริษัทหลักทรัพย์ อาร์เอชบี (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)	RHB SECURITIES (THAILAND) PUBLIC COMPANY LIMITED	✓	✓	✓		✓	
บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)	FINANSIA SYRUS SECURITIES PUBLIC COMPANY LIMITED	✓	✓	✓		✓	
บริษัทหลักทรัพย์ เคทีบี (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)	KTB SECURITIES (THAILAND) PUBLIC COMPANY LIMITED	✓	✓	✓		✓	✓
บริษัทหลักทรัพย์ ยูไอบี เคย์เฮียน (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)	UOB KAYHIAN SECURITIES (THAILAND) PUBLIC COMPANY LIMITED	✓	✓	✓		✓	✓
บริษัทหลักทรัพย์ กรุงไทย ซีมิโก้ จำกัด	KRUNGTHAI ZMICO SECURITIES COMPANY LIMITED	✓	✓	✓		✓	
บริษัทหลักทรัพย์ซีทีคอร์ป (ประเทศไทย) จำกัด	CTICORP SECURITIES (THAILAND) LIMITED	✓	✓	✓		✓	
บริษัทหลักทรัพย์ เจพีมอร์แกน (ประเทศไทย) จำกัด	JPMORGAN SECURITIES (THAILAND) LIMITED	✓	✓	✓		✓	✓

*ผลประโยชน์ที่ได้รับ SERVICES

1. บทวิเคราะห์ (รายบริษัทและสภาพตลาดฯ รายวัน, รายเดือน, รายไตรมาส) Analysis Reports (Market Summary and Companies updated analysis on daily, monthly and quarterly basis)
2. ข้อมูลพื้นฐาน (ข้อมูลตลาดฯ, งบการเงิน บมจ. ย้อนหลัง) (Fundamental Data (Market and historical financial data of listed companies))
3. รายงานสรุปข่าวรายวัน และติดตามข่าวด่วน ผ่าน SMS (Daily news summary and urgent news via SMS)
4. จัดสัมมนาหัวข้อทางเศรษฐกิจหรือกลุ่มธุรกิจ (Arrangement of Seminars on Economics or Industries Issues)
5. บรรยายสรุปกลยุทธ์การลงทุนรายไตรมาส (Strategy Presentation on quarterly basis)
6. จัดเยี่ยมชมบริษัทที่กองทุนสนใจลงทุน (Company Visit arrangement to companies of interest)

ข้อมูลการดำเนินการใช้สิทธิออกเสียงในที่ประชุมผู้ถือหุ้นในนามกองทุนรวมของรอบปีปฏิทินล่าสุด
สามารถตรวจสอบข้อมูลได้จาก Website : www.scbam.com



บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด
ไทยพาณิชย์ ปาร์ค พลัส อาคาร 1 ชั้น 7-8 เลขที่ 18 ถนนรัชดาภิเษก แขวงจตุจักร เขตจตุจักร กรุงเทพฯ 10900

SCBAM Call Center 0 2777 7777 กด 0 กด 6 หรือ WWW.SCBAM.COM