

1I01BSET50

กองทุนเปิดบีแคป เซ็ต 50 เดย์ลี อินเวอร์ส
อีทีเอฟ (-1X)

BCAP SET50 Daily Inverse ETF (-1X)

สำหรับรอบระยะเวลา
ตั้งแต่วันที่ 24 กันยายน 2568 ถึงวันที่ 28 กุมภาพันธ์ 2569



think GLOBAL

ความเห็นของบริษัทจัดการ.....	1
ความเห็นของผู้ดูแลผลประโยชน์.....	2
ข้อมูลของบริษัทจัดการ.....	3
รายชื่อผู้จัดการกองทุน.....	4
ผลการดำเนินงานของกองทุนรวม.....	5
ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุน.....	6
ค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวม.....	7
ข้อมูลอัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุนของกองทุนรวม (Portfolio Turnover Ratio : PTR).....	8
รายละเอียดเงินลงทุน การกู้ยืมเงิน และการก่อภาระผูกพัน.....	9
งบแสดงฐานะการเงิน.....	10
งบกำไรขาดทุนเบ็ดเสร็จ.....	11
รายงานการลงทุนในหลักทรัพย์และทรัพย์สินอื่น.....	12
รายชื่อบุคคลที่เกี่ยวข้องที่มีการทำธุรกรรมกับกองทุน.....	13
รายงานการรับผลประโยชน์ตอบแทนเนื่องจากการประกอบธุรกิจ (Soft/Hard Dollar).....	14
รายงานการลงทุนที่ไม่เป็นไปตามนโยบายการลงทุนเฉลี่ย.....	15

ความเห็นของบริษัทจัดการ

กองทุนเปิดบีแคป เซ็ท 50 เดย์ลี อินเวอร์ส อีทีเอฟ (-1X) (1I01BSET50) มีนโยบายการลงทุนเพื่อมุ่งหวังผลตอบแทนตรงกันข้ามเป็น 1 เท่ากับผลตอบแทนรายวันของดัชนี SET50 Total Return Index โดยจะลงทุนในหลักทรัพย์ และหรือหน่วยลงทุน และหรือ ETF และหรือตราสารหนี้ และหรือเงินฝาก และหรือตราสารหนี้เทียบเท่าเงินฝาก และหรือสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives)

จากวันที่ 24 กันยายน 2568 ถึงวันสิ้นงวด ณ วันที่ 27 กุมภาพันธ์ 2569 กองทุนเปิดบีแคป เซ็ท 50 เดย์ลี อินเวอร์ส อีทีเอฟ (-1X) (1I01BSET50) ให้ผลตอบแทนร้อยละ -22.53 เทียบกับดัชนีชี้วัดที่ร้อยละ -22.90 โดยดัชนีชี้วัดของกองทุนคำนวณจากผลตอบแทนตรงกันข้ามเป็น 1 เท่ากับผลตอบแทนรายวันของดัชนี SET50 Total Return ปรับด้วย funding rate ในช่วงเวลาเดียวกัน โดยมีค่าส่วนต่างของผลตอบแทนของกองทุนรวมและผลตอบแทนของดัชนีอ้างอิง (Tracking Difference) ย้อนหลังตั้งแต่จัดตั้งอยู่ที่ร้อยละ 0.37 และมีค่าความผันผวนของส่วนต่างของผลตอบแทนของกองทุนรวมและผลตอบแทนของดัชนีอ้างอิง (Tracking Error) ตั้งแต่จัดตั้งอยู่ที่ร้อยละ 0.27

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน บางกอกแคปปิตอล จำกัด



ธนาคารกสิกรไทย
开泰银行 KASIKORNBANK



ความเห็นของผู้ดูแลผลประโยชน์

เรียน ผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุน กองทุนเปิดบีแคป เซ็ท 50 เดย์ลี อินเวสต์ อีทีเอฟ (-1X)

ข้าพเจ้า บมจ.ธนาคารกสิกรไทย ในฐานะผู้ดูแลผลประโยชน์ได้ดูแลการจัดการ กองทุนเปิดบีแคป เซ็ท 50 เดย์ลี อินเวสต์ อีทีเอฟ (-1X) ซึ่งจัดการโดย บริษัท หลักทรัพย์จัดการกองทุน บางกอกแคปปิตอล จำกัด สำหรับระยะเวลาตั้งแต่วันที่ 24 กันยายน พ.ศ. 2568 ถึงวันที่ 28 กุมภาพันธ์ พ.ศ. 2569 แล้ว

ข้าพเจ้าเห็นว่า บริษัท หลักทรัพย์จัดการกองทุนบางกอกแคปปิตอล จำกัด ได้ปฏิบัติ หน้าที่ในการจัดการ กองทุนเปิดบีแคป เซ็ท 50 เดย์ลี อินเวสต์ อีทีเอฟ (-1X) เหมาะสมตามสมควรแห่ง วัตถุประสงค์ ที่ได้กำหนดไว้ในโครงการและภายใต้พระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535

ขอแสดงความนับถือ
บมจ. ธนาคารกสิกรไทย

(นางสาวสุภาวดี เมธารากร)
รองผู้อำนวยการฝ่ายบริการธุรกิจหลักทรัพย์

(นายวุฒิชัย รอดภัย)
ผู้ช่วยผู้อำนวยการฝ่ายบริการธุรกิจหลักทรัพย์

วันที่ 11 มีนาคม พ.ศ. 2569

ข้อมูลของบริษัทจัดการ

ข้อมูลเกี่ยวกับบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน บางกอกแคปปิตอล จำกัด

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน บางกอกแคปปิตอล จำกัด

เลขที่ 191 อาคารสีลมคอมเพล็กซ์ ชั้น 24 ห้องเลขที่ A-C

ถนนสีลม แขวงสีลม เขตบางรัก กรุงเทพมหานคร 10500

โทรศัพท์ : 0-2618-1599 โทรสาร : 0-2618-1597

รายชื่อคณะกรรมการบริษัท

- | | | |
|----|--------------------------|---------------------|
| 1. | นางเมธวดี ประเสริฐสินธนา | ประธานกรรมการบริษัท |
| 2. | นายธนาวุฒิ พรโรจนางกูร | กรรมการบริษัท |
| 3. | นายครรชิต พิสุทธิชินวงศ์ | กรรมการบริษัท |
| 4. | นายวรุฒม์ ศรีธานุศาสตร์ | กรรมการบริษัท |

รายชื่อผู้บริหาร

- | | | |
|----|--------------------------|-----------------------------|
| 1. | นางเมธวดี ประเสริฐสินธนา | กรรมการผู้จัดการ |
| 2. | นางกฤษฏีรา พรโรจนางกูร | หัวหน้าสายงานสนับสนุนธุรกิจ |

รายชื่อคณะกรรมการจัดการลงทุน (Investment Committee)

- | | | |
|----|--------------------------|------------------|
| 1. | นางเมธวดี ประเสริฐสินธนา | ประธานคณะกรรมการ |
| 2. | นางสาวปิยพร มณเฑียร | กรรมการ |
| 3. | นายสันติ ชินศิริโชคชัย | กรรมการ |

กองทุนเปิดบีแคป เซ็ท 50 เดย์ลี อินเวรส์ อีทีเอฟ (-1X)

รายชื่อผู้จัดการกองทุนรวม

ตั้งแต่วันที่ 24 กันยายน 2568 ถึงวันที่ 28 กุมภาพันธ์ 2569

ลำดับที่	รายชื่อผู้จัดการกองทุนรวม
1	นายเมธี เมฆอรุณเรือง*

* ปฏิบัติหน้าที่เป็นผู้จัดการกองทุนและผู้จัดการการลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

ผลการดำเนินงานของกองทุนรวม (ข้อมูล ณ วันที่ 27 กุมภาพันธ์ 2569)								
ชื่อกองทุน/ เกณฑ์มาตรฐาน	ผลการดำเนินงานย้อนหลัง (%)							
	Year to Date	ย้อนหลัง 3 เดือน	ย้อนหลัง 6 เดือน	ย้อนหลัง 1 ปี	ย้อนหลัง 3 ปี***	ย้อนหลัง 5 ปี***	ย้อนหลัง 10 ปี***	นับตั้งแต่ วันจดทะเบียน กองทุน*
1I01BSET50	-19.83	-21.57	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	-22.53
ดัชนีอ้างอิง**	-19.91	-21.69	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	-22.90
ความผันผวนของ ผลการดำเนินงาน	16.26	15.35	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	15.42
ความผันผวนของ ดัชนีอ้างอิง	16.27	15.35	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	15.40

* วันที่จดทะเบียนกองทุน 24 กันยายน 2568

** ดัชนีอ้างอิง (Benchmark) คือ ผลตอบแทนตรงกันข้ามเป็น 1 เท่ากับผลตอบแทนรายวันของดัชนี SET50 Total Return ปรับด้วย funding rate ร้อยละ 100.00 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน

funding rate หมายถึง ดอกเบี้ยที่ได้รับจากเงินลงทุนและการ short sale และดอกเบี้ยที่จ่ายให้กับผู้ให้ยืมเงินเพื่อ leverage portfolio

*** ผลตอบแทนเฉลี่ยต่อปีสำหรับผลการดำเนินงานย้อนหลัง 3 ปี, 5 ปี และ 10 ปี ทั้งนี้ หากระยะเวลาตั้งแต่เริ่มบริหารกองทุนมากกว่า 1 ปี จะแสดงผลตอบแทนเฉลี่ยต่อปี

- เอกสารการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวมฉบับนี้ ได้จัดทำขึ้นตามมาตรฐานการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวมของสมาคมบริษัทจัดการลงทุน
- ผลการดำเนินงานในอดีต มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต ผู้ลงทุนโปรดทำความเข้าใจลักษณะสินค้า เงื่อนไข ผลตอบแทน และความเสี่ยงก่อนตัดสินใจลงทุน
- Tracking Difference (TD) ย้อนหลัง 1 ปี ของกองทุนเท่ากับร้อยละ N/A
- Tracking Error (TE) ย้อนหลัง 1 ปี ของกองทุนเท่ากับร้อยละ N/A

กองทุนเปิดบีแคป เซ็ท 50 เดย์ลี อินเวรส์ อีทีเอฟ (-1X)

ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุน

ตั้งแต่วันที่ 24 กันยายน 2568 ถึงวันที่ 28 กุมภาพันธ์ 2569

ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม Fund's direct expenses	จำนวนเงิน (พันบาท)	ร้อยละของมูลค่า ทรัพย์สินสุทธิ
ค่าธรรมเนียมการจัดการ	132.84	0.46%
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์	3.06	0.01%
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน	1.33	0.00%
ค่าธรรมเนียมผู้ร่วมค้าหน่วยลงทุน	19.86	0.07%
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลสภาพคล่อง	19.86	0.07%
ค่าธรรมเนียมวิชาชีพ	19.87	0.07%
ค่าใช้จ่ายอื่นๆ	27.75	0.10%
รวมค่าใช้จ่ายทั้งหมด	224.57	0.78%

- ค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายข้างต้นได้รวมภาษีมูลค่าเพิ่มและภาษีอื่นใดในตนเองเรียบร้อยแล้ว (ถ้ามี)
- ค่าใช้จ่ายทั้งหมดไม่รวมค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ และค่าธรรมเนียมต่าง ๆ ที่เกิดขึ้นจากการซื้อขายหลักทรัพย์
- ไม่รวมค่าภาษีเงินได้นิติบุคคลสำหรับเงินได้ตามมาตรา 40(4) (ก) แห่งประมวลรัษฎากร

ค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวม
ระหว่าง วันที่ 24 กันยายน 2568 ถึงวันที่ 28 กุมภาพันธ์ 2569

- ไม่มี -

ข้อมูลอัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุนของกองทุนรวม

สำหรับระยะเวลาตั้งแต่วันที่ 24 กันยายน 2568 ถึงวันที่ 28 กุมภาพันธ์ 2569

Portfolio Turnover Ratio (PTR) = 182.13%

หมายเหตุ : Portfolio Turnover Ratio ("PTR") ใช้มูลค่าการซื้อขายทรัพย์สินแล้วแต่ตัวใดจะต่ำกว่า หาดด้วยมูลค่าทรัพย์สินสุทธิ ("NAV") เฉลี่ยในรอบระยะเวลาเดียวกัน

รายละเอียดการลงทุน การกู้ยืมเงิน และการก่อภาระผูกพัน

กองทุนเปิดบีแคป เซ็ท 50 เดย์ลี อินเวอร์ส อีทีเอฟ (-1X)

มูลค่า ณ วันที่ 28 กุมภาพันธ์ 2569

รายละเอียดการลงทุน	มูลค่าตามราคาตลาด (บาท)	%NAV
หลักทรัพย์หรือทรัพย์สินในประเทศ	3,931,637.92	101.50%
เงินฝากธนาคาร	935,583.68	24.15%
ออมทรัพย์	935,583.68	24.15%
ธนาคารกสิกรไทย จำกัด (มหาชน)	935,583.68	24.15%
ตราสารหนี้	2,996,054.24	77.35%
พันธบัตร	2,996,054.24	77.35%
ธนาคารแห่งประเทศไทย	2,996,054.24	77.35%
สินทรัพย์อื่นและหนี้สินอื่น	-58,031.38	-1.50%
ทรัพย์สินอื่นๆ	137,883.01	3.56%
หนี้สินอื่นๆ	-195,914.39	-5.06%
มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ	3,873,606.54	100.00%

กองทุนเปิดบีแคป เซ็ท 50 เดย์ลี อินเวอร์ส อีทีเอฟ (-1X)

งบฐานะการเงิน

ณ วันที่ 28 กุมภาพันธ์ 2569

	(หน่วย : บาท)
	ยังไม่ได้สอบทาน
สินทรัพย์	
เงินลงทุนแสดงด้วยมูลค่ายุติธรรม	2,996,054.24
เงินฝากธนาคาร	935,583.68
ลูกหนี้จากดอกเบี้ย	981.82
ค่าใช้จ่ายรอการตัดบัญชี	136,666.60
สินทรัพย์อื่น	151.51
รวมสินทรัพย์	4,069,437.85
หนี้สิน	
ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย	156,222.81
ภาษีเงินได้ค้างจ่าย	147.27
หนี้สินอื่น	39,822.05
รวมหนี้สิน	196,192.13
สินทรัพย์สุทธิ	3,873,245.72
สินทรัพย์สุทธิ:	
ทุนที่ได้รับจากผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุน	5,000,000.00
กำไร(ขาดทุน)สะสม	
บัญชีปรับสมดุล	3,588,615.21
กำไร (ขาดทุน) สะสมจากการดำเนินงาน	(4,715,369.49)
สินทรัพย์สุทธิ	3,873,245.72
สินทรัพย์สุทธิต่อหน่วย	3.8732
จำนวนหน่วยลงทุนที่จำหน่ายแล้วทั้งหมด ณ วันสิ้นงวด (หน่วย)	1,000,000.0000

กองทุนเปิดบีแคป เซ็ท 50 เดย์ลี อินเวรส์ อีทีเอฟ (-1X)
งบกำไรขาดทุนเบ็ดเสร็จ
สำหรับรอบระยะเวลาตั้งแต่วันที่ 24 กันยายน 2568 ถึงวันที่ 28 กุมภาพันธ์ 2569

	(หน่วย : บาท)
	<u>ยังไม่ได้สอบทาน</u>
รายได้จากการลงทุน	
รายได้ดอกเบี้ย	128,058.65
รวมรายได้	<u>128,058.65</u>
ค่าใช้จ่าย	
ค่าธรรมเนียมการจัดการ	132,845.06
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์	3,055.47
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน	1,328.45
ค่าธรรมเนียมผู้ร่วมคำนวณหน่วยลงทุน	19,864.71
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลสภาพคล่อง	19,864.71
ค่าธรรมเนียมวิชาชีพ	19,865.68
ค่าใช้จ่ายในการดำเนินงาน	<u>27,746.96</u>
รวมค่าใช้จ่าย	<u>224,571.04</u>
รายได้ (ขาดทุน) สุทธิ	<u>(96,512.39)</u>
รายการกำไร (ขาดทุน) สุทธิจากเงินลงทุน	
รายการกำไร (ขาดทุน) สุทธิจากเงินลงทุน	<u>(4,617,941.22)</u>
รวมรายการกำไร(ขาดทุน) สุทธิจากการลงทุน	<u>(4,617,941.22)</u>
การเพิ่มขึ้น(ลดลง)ในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงานก่อนภาษีเงินได้	(4,714,453.61)
<u>หัก</u> ภาษีเงินได้	<u>915.88</u>
การเพิ่มขึ้น(ลดลง)ในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงานหลังภาษีเงินได้	<u><u>(4,715,369.49)</u></u>

รายงานการลงทุนในหลักทรัพย์และทรัพย์สินอื่น
กองทุนเปิดบีแคป เชื้อ 50 เดย์ลี อินเวสต์ อีทีเอฟ (-1X) (1I01BSET50)
28 กุมภาพันธ์ 2569

ชื่อหลักทรัพย์	อัตราดอกเบี้ย	การจัดอันดับความน่าเชื่อถือ	วันครบกำหนด	จำนวนหน่วย (หน่วย) /มูลค่าหน้าตัว (บาท)	มูลค่าตามราคาตลาด ไม่รวมดอกเบี้ยค้างรับ (บาท)	%เงินลงทุน	มูลค่าตามราคาตลาด (บาท)	%NAV	
TRIS									
หลักทรัพย์หรือทรัพย์สินในประเทศ									
เงินฝากธนาคาร								936,565.50	24.18
ออมทรัพย์								936,565.50	24.18
CASH	ธนาคารกรุงไทย จำกัด (มหาชน)				935,583.68	0.00	936,565.50	24.18	
ตราสารหนี้								2,996,054.24	77.35
พันธบัตร								2,996,054.24	77.35
ธนาคารแห่งประเทศไทย								2,996,054.24	77.35
CB26416A	ธนาคารแห่งประเทศไทย	0.00	AAA	16/04/2026	3,000	2,996,054.24	100.00	2,996,054.24	77.35
สินทรัพย์อื่นและหนี้สินอื่น								-59,013.20	-1.52
ทรัพย์สินอื่นๆ								136,901.19	3.53
หนี้สินอื่นๆ								-195,914.39	-5.06
รวมทั้งสิ้น					3,872,624.72	100.00	3,873,606.54	100.00	

รายชื่อบุคคลที่เกี่ยวข้องที่มีการทำธุรกรรมกับกองทุน
สำหรับระยะเวลาตั้งแต่วันที่ 24 กันยายน 2568 ถึงวันที่ 28 กุมภาพันธ์ 2569

ลำดับ	รายชื่อ
1	ธนาคารกรุงเทพ จำกัด (มหาชน)
2	บริษัทหลักทรัพย์ บัวหลวง จำกัด (มหาชน)

ผู้ลงทุนสามารถตรวจสอบรายละเอียดการทำธุรกรรมกับบุคคลที่เกี่ยวข้องกับกองทุนรวมได้ที่เว็บไซต์ <http://www.bcap.co.th>
ในหัวข้อข้อมูลนักลงทุน หรือ เว็บไซต์ของสำนักงาน ก.ล.ต. ที่ <http://www.sec.or.th>

รายงานการรับผลประโยชน์ตอบแทนเนื่องจากการประกอบธุรกิจ (Soft/Hard Dollar)

สำหรับระยะเวลาตั้งแต่วันที่ 24 กันยายน 2568 ถึงวันที่ 28 กุมภาพันธ์ 2569

ลำดับ	รายชื่อบริษัทนายหน้าซื้อ-ขายหลักทรัพย์	บทวิเคราะห์	สิทธิในการ จองซื้อหุ้น IPO	สัมมนา	จัดเยี่ยมชม บริษัท
1	บริษัทหลักทรัพย์ บัวหลวง จำกัด (มหาชน)	✓	-	✓	-
2	บริษัทหลักทรัพย์ เกียรตินาคินภัทร จำกัด (มหาชน)	✓	-	✓	-
3	บริษัทหลักทรัพย์ อินโนเวสต์ เอกซ์ จำกัด	✓	-	✓	-
4	บริษัทหลักทรัพย์ ธนชาต จำกัด (มหาชน)	✓	-	✓	-
5	บริษัทหลักทรัพย์ ทิสโก้ จำกัด	✓	-	✓	-
6	บริษัทหลักทรัพย์ ดาโอ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)	✓	-	✓	-
7	บริษัทหลักทรัพย์ กรุงศรี จำกัด (มหาชน)	✓	-	✓	-
8	บริษัทหลักทรัพย์ เมย์แบงก์ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)	✓	-	✓	-
9	บริษัทหลักทรัพย์ กลสิกรไทย จำกัด (มหาชน)	✓	-	✓	-
10	บริษัทหลักทรัพย์ หยวนต้า (ประเทศไทย) จำกัด	✓	-	✓	-
11	บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)	✓	-	✓	-
12	ธนาคารทิสโก้ จำกัด (มหาชน)	✓	-	-	-
13	ธนาคารไทยพาณิชย์ จำกัด (มหาชน)	✓	-	-	-
14	ธนาคารกลสิกรไทย จำกัด (มหาชน)	✓	-	-	-
15	ธนาคารกรุงเทพ จำกัด (มหาชน)	✓	-	-	-
16	ธนาคารดอยช์แบงก์ เอเชีย	✓	-	-	-
17	ธนาคาร ไอ เอ็น จี จำกัด	✓	-	-	-
18	ธนาคาร ซีไอเอ็มบี ไทย จำกัด (มหาชน)	✓	-	-	-
19	ธนาคาร กรุงศรีอยุธยา จำกัด (มหาชน)	✓	-	-	-
20	ธนาคาร กรุงไทย จำกัด (มหาชน)	✓	-	-	-
21	ธนาคาร ทหารไทยธนชาต จำกัด (มหาชน)	✓	-	-	-
22	บล. เคจีไอ (ประเทศไทย) จำกัด	✓	-	-	-
23	ธนาคารเกียรตินาคินภัทร จำกัด (มหาชน)	✓	-	-	-
24	ธนาคารออมสิน	✓	-	-	-
25	ธนาคาร ยูโอบี จำกัด(มหาชน)	✓	-	-	-
26	ธนาคารบีเอ็นพี พารีบาส จำกัด	✓	-	-	-

รายงานการลงทุนที่ไม่เป็นไปตามนโยบายการลงทุนเฉลี่ย
ในช่วงเวลาตั้งแต่วันที่ 24 กันยายน 2568 ถึงวันที่ 28 กุมภาพันธ์ 2569

พบว่ากองทุนมีการลงทุนเป็นไปตามนโยบายการลงทุน

