

# BCAP-USND100

กองทุนเปิดบีแคป หุ้นยูเอส เอ็นดี 100  
BCAP US Equity ND 100 Fund

สำหรับรอบระยะเวลา  
ตั้งแต่วันที่ 1 เมษายน 2564 ถึงวันที่ 30 กันยายน 2564



	หน้า
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
การรับผลประโยชน์ตอบแทนเนื่องจากการที่กองทุนใช้บริการบุคคลอื่น (Soft Commission).....	14
รายงานการลงทุนที่ไม่เป็นไปตามนโยบายการลงทุนเฉลี่ย.....	15

## ความเห็นของบริษัทจัดการ

กองทุนเปิดบีแคป หุ้นยูเอส เอ็นดี 100 (BCAP-USND100) มีนโยบายลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนต่างประเทศ คือ กองทุน Invesco QQQ Trust (กองทุนหลัก) ในอัตราส่วนโดยเฉลี่ยรอบระยะเวลาบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินของกองทุน โดยกองทุนหลักดังกล่าวเป็นกองทุนอิตาลีที่ลงทุนส่วนใหญ่ในหุ้นตามดัชนี Nasdaq-100 โดย BCAP-USND100 ใช้ นโยบายเชิงรับเพื่อสร้างผลตอบแทนได้ใกล้เคียงกับผลตอบแทนจากการลงทุนก่อนหักค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่าย

กองทุนเปิดบีแคป หุ้นยูเอส เอ็นดี 100 (BCAP-USND100) นั้น ถูกจัดตั้งขึ้นเมื่อวันที่ 8 เม.ย. 63 โดยผลตอบแทนของกองทุนในช่วง วันที่ 1 เม.ย. 64 - 30 ก.ย. 64 อยู่ที่ร้อยละ 12.18 ของมูลค่าทรัพย์สินของกองทุน ในขณะที่เกณฑ์มาตรฐาน (Benchmark) ของกองทุนในช่วงเวลาเดียวกันมีผลตอบแทนร้อยละ 12.57 ของมูลค่าทรัพย์สินของกองทุน โดยเกณฑ์มาตรฐานของกองทุนคำนวณจากดัชนี NASDAQ-100 Notional Net Total Return Index ในสัดส่วนร้อยละ 100.00 ของมูลค่าทรัพย์สินของกองทุน ปรับด้วยต้นทุนการป้องกันความเสี่ยงด้านอัตราแลกเปลี่ยนเพื่อคำนวณผลตอบแทนของกองทุนเป็นสกุลเงินบาท ณ สิ้นวันทำการสุดท้ายของเดือน

**บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน บางกอกแคปปิตอล จำกัด**



A member of MUFG  
a global financial group

## รายงานความเห็นผู้ดูแลผลประโยชน์

เลขที่ ผู้ถือหน่วยลงทุน  
กองทุนเปิดบีแคป หุ้นยูเอส เอ็นดี 100

ตามที่ ธนาคารกรุงศรีอยุธยา จำกัด (มหาชน) (“ธนาคารฯ”) ในฐานะผู้ดูแลผลประโยชน์ กองทุนเปิด บีแคป หุ้นยูเอส เอ็นดี 100 (“กองทุน”) ซึ่งมี บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน บางกอกแคปปิตอล จำกัด เป็นผู้จัดตั้งและจัดการกองทุน ได้ปฏิบัติหน้าที่ดูแลผลประโยชน์ของกองทุนดังกล่าว สำหรับรอบระยะเวลาหกเดือนของกองทุน ตั้งแต่วันที่ 1 เมษายน 2564 ถึงวันที่ 30 กันยายน 2564

ธนาคารฯ เห็นว่า บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน บางกอกแคปปิตอล จำกัด ได้ปฏิบัติหน้าที่ในการจัดการ โดยถูกต้องตามที่ควรตามวัตถุประสงค์ที่ได้กำหนดไว้ในโครงการจัดการที่ได้รับอนุมัติจากสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ และภายใต้พระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535

ผู้ดูแลผลประโยชน์

ธนาคารกรุงศรีอยุธยา จำกัด (มหาชน)

(นายจตุภูมิ ปรัชญาวงศ์ปรีชา)

ผู้อำนวยการ ผู้บริหารฝ่าย

ฝ่ายพัฒนามลิตภัณฑ์และควบคุมดูแลผลประโยชน์

ฝ่ายพัฒนามลิตภัณฑ์และควบคุมดูแลผลประโยชน์

วันที่ 4 ตุลาคม 2564

## 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. นายชอง โท            | ประธานกรรมการบริษัท |
| 2. นายพิเชษฐ สิทธิอำนวย | กรรมการบริษัท       |
| 3. นายบรรณรงค์ พิษณุากร | กรรมการบริษัท       |

## รายชื่อผู้บริหาร

- |                             |                           |
|-----------------------------|---------------------------|
| 1. นางเมธวดี ประเสริฐสินธนา | กรรมการผู้จัดการ          |
| 2. ดร. ธนาวุฒิ พรโรจนางกูร  | รองกรรมการผู้จัดการ       |
| 3. นางกฤษณา พรโรจนางกูร     | ผู้ช่วยกรรมการผู้อำนวยการ |

## รายชื่อคณะกรรมการจัดการลงทุน (Investment Committee)

- |                             |                  |
|-----------------------------|------------------|
| 1. นางเมธวดี ประเสริฐสินธนา | ประธานคณะกรรมการ |
| 2. ดร. ธนาวุฒิ พรโรจนางกูร  | กรรมการ          |
| 3. นายชลาติส องอาจ          | กรรมการ          |
| 4. นายคงศิริ เลิศพิชิตกุล   | กรรมการ          |
| 5. นายสันติ ชินศิริโชคชัย   | กรรมการ          |

กองทุนเปิดบีแคป หุ้นยูเอส เอ็นดี 100  
รายชื่อผู้จัดการกองทุนรวม  
ตั้งแต่วันที่ 1 เมษายน 2564 ถึงวันที่ 30 กันยายน 2564

ลำดับที่	รายชื่อผู้จัดการกองทุนรวม
1	ดร. ธนาวุฒิ พรโรจนางกูร
2	นายธวัชชัย วงศ์รัตนศิริกุล
3	นายพลวัต บำรุงสกุลสวัสดิ์*
4	นางสาวพัชรินทร์ ขำเดช*
5	นายเมธี เมฆอรุณเรือง

\* ปฏิบัติหน้าที่เป็นผู้จัดการกองทุนและผู้จัดการการลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

ผลการดำเนินงานของกองทุนรวม (ข้อมูล ณ วันที่ 30 กันยายน 2564)

ชื่อกองทุน/ เกณฑ์มาตรฐาน	ผลการดำเนินงานย้อนหลัง (%)							นับตั้งแต่ วันจดทะเบียน กองทุน*
	Year to Date	ย้อนหลัง 3 เดือน	ย้อนหลัง 6 เดือน	ย้อนหลัง 1 ปี	ย้อนหลัง 3 ปี***	ย้อนหลัง 5 ปี***	ย้อนหลัง 10 ปี***	
BCAP-USND100	14.50%	0.86%	12.18%	28.51%	N/A	N/A	N/A	47.11%
ดัชนีอ้างอิง**	14.88%	1.08%	12.57%	29.45%	N/A	N/A	N/A	48.88%
ความผันผวนของ ผลการดำเนินงาน	18.51%	12.62%	14.46%	19.61%	N/A	N/A	N/A	22.03%
ความผันผวนของ ดัชนีอ้างอิง	18.88%	12.58%	14.60%	20.01%	N/A	N/A	N/A	22.41%

\* วันที่จดทะเบียนกองทุน 8 เมษายน 2563

\*\* ดัชนีอ้างอิง (Benchmark) คือ NASDAQ-100 Notional Net Total Return Index ในสัดส่วนร้อยละ 100.00 ของมูลค่าทรัพย์สินของกองทุน ปรับด้วยต้นทุนการป้องกันความเสี่ยงด้านอัตราแลกเปลี่ยนเพื่อคำนวณผลตอบแทนของกองทุนเป็นสกุลเงินบาท ณ สิ้นวันทำการสุดท้ายของเดือน

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

- เอกสารการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวมฉบับนี้ ได้จัดทำขึ้นตามมาตรฐานการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวมของสมาคมบริษัทจัดการลงทุน
- ผลการดำเนินงานในอดีต มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต ผู้ลงทุนโปรดทำความเข้าใจลักษณะสินค้า เงื่อนไข ผลตอบแทน และความเสี่ยงก่อนตัดสินใจลงทุน

กองทุนเปิดบีแคป หุ้นยูเอส เอ็นดี 100

ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุน

ตั้งแต่วันที่ 1 เมษายน 2564 ถึงวันที่ 30 กันยายน 2564

ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม Fund's direct expenses	จำนวนเงิน (พันบาท)	ร้อยละของมูลค่า ทรัพย์สินสุทธิ
ค่าธรรมเนียมการจัดการ	1,887.98	0.16%
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์	188.80	0.02%
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน	409.06	0.03%
ค่าสอบบัญชี	21.16	0.00%
ค่าโฆษณาประชาสัมพันธ์	60.79	0.01%
ค่าใช้จ่ายอื่น ๆ	103.88	0.01%
<b>รวมค่าใช้จ่ายทั้งหมด</b>	<b>2,671.67</b>	<b>0.23%</b>

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



ค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวม  
ระหว่าง วันที่ 1 เมษายน 2564 ถึงวันที่ 30 กันยายน 2564

- ไม่มี -

## ข้อมูลอัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุนของกองทุนรวม

สำหรับระยะเวลาตั้งแต่วันที่ 1 เมษายน 2564 ถึงวันที่ 30 กันยายน 2564

Portfolio Turnover Ratio (PTR) = 9.13%

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

รายละเอียดการลงทุน การกู้ยืมเงิน และการก่อภาระผูกพัน

กองทุนเปิดบีแคป หุ้นยูเอส เอ็นดี 100

มูลค่า ณ วันที่ 30 กันยายน 2564

รายละเอียดการลงทุน	มูลค่าตามราคาตลาด (บาท)	%NAV
<b>หลักทรัพย์หรือทรัพย์สินในประเทศ</b>	<b>-375,610.18</b>	<b>-0.04%</b>
เงินฝากธนาคาร	21,389,673.34	2.26%
ออมทรัพย์	21,387,673.34	2.26%
ธนาคารกรุงศรีอยุธยา จำกัด (มหาชน)	21,387,673.34	2.26%
กระแสรายวัน	2,000.00	0.00%
ธนาคารกรุงศรีอยุธยา จำกัด (มหาชน)	2,000.00	0.00%
ตราสารอนุพันธ์	-21,765,283.52	-2.30%
สัญญาซื้อขายล่วงหน้า	-21,765,283.52	-2.30%
<b>หลักทรัพย์หรือทรัพย์สินต่างประเทศ</b>	<b>947,881,329.98</b>	<b>100.08%</b>
เงินฝากธนาคาร	1,072,469.33	0.11%
สกุลเงิน ดอลลาร์ สหรัฐอเมริกา	1,072,469.33	0.11%
สหรัฐอเมริกา	946,808,860.65	99.97%
หน่วยลงทุน	946,808,860.65	99.97%
กองทุนตราสารทุน	946,808,860.65	99.97%
<b>สินทรัพย์อื่นและหนี้สินอื่น</b>	<b>-371,724.91</b>	<b>-0.04%</b>
ทรัพย์สินอื่นๆ	1,067,407.56	0.11%
หนี้สินอื่นๆ	-1,439,132.47	-0.15%
<b>มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ</b>	<b>947,133,994.89</b>	<b>100.00%</b>

กองทุนเปิดบีแคป หุ้นยูเอส เอ็นดี 100

งบแสดงฐานะการเงิน

ณ วันที่ 30 กันยายน 2564

(หน่วย : บาท)

30 กันยายน 2564

(ยังไม่ได้สอบทาน)

**สินทรัพย์**

เงินลงทุนแสดงด้วยมูลค่ายุติธรรม	946,808,860.65
เงินฝากธนาคาร	22,456,881.44
ลูกหนี้จากเงินปันผลและดอกเบี้ย	918,590.62
สินทรัพย์อนุพันธ์	
ค่าใช้จ่ายรอการตัดบัญชี	154,078.17
รวมสินทรัพย์	<u>970,338,410.88</u>

**หนี้สิน**

เจ้าหนี้จากการรับซื้อคืนหน่วยลงทุน	337,734.19
หนี้สินอนุพันธ์	22,485,769.08
ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย	353,567.91
ภาษีเงินได้ค้างจ่าย	1,075.28
หนี้สินอื่น	26,269.53
รวมหนี้สิน	<u>23,204,415.99</u>

**สินทรัพย์สุทธิ**

947,133,994.89

**สินทรัพย์สุทธิ:**

ทุนที่ได้รับจากผู้ถือหน่วยลงทุน	535,033,293.55
กำไร(ขาดทุน)สะสม	
บัญชีปรับสมดุล	(68,150,532.34)
กำไร (ขาดทุน) สะสมจากการดำเนินงาน	480,251,233.68
สินทรัพย์สุทธิ	<u>947,133,994.89</u>

**สินทรัพย์สุทธิต่อหน่วย**

17.7023

จำนวนหน่วยลงทุนที่จำหน่ายแล้วทั้งหมด ณ วันสิ้นงวด (หน่วย)

53,503,325.5260

กองทุนเปิดบีแคป หุ้นยูเอส เอ็นดี 100  
งบกำไรขาดทุนเบ็ดเสร็จ  
สำหรับรอบระยะเวลาตั้งแต่วันที่ 1 เมษายน 2564 ถึงวันที่ 30 กันยายน 2564

(หน่วย : บาท)

1 เม.ย. 2564 - 30 ก.ย. 2564

(ยังไม่ได้สอบทาน)

**รายได้จากการลงทุน**

รายได้เงินปันผล	2,164,200.44
รายได้ดอกเบี้ย	13,883.74
รวมรายได้	2,178,084.18

**ค่าใช้จ่าย**

ค่าธรรมเนียมการจัดการ	1,887,982.82
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์	188,798.23
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน	409,062.97
ค่าธรรมเนียมวิชาชีพ	21,154.62
ค่าใช้จ่ายในการดำเนินงาน	164,671.56
รวมค่าใช้จ่าย	2,671,670.20

รายได้ (ขาดทุน) สุทธิ	(493,586.02)
-----------------------	--------------

**รายการกำไร (ขาดทุน) สุทธิจากเงินลงทุน**

รายการกำไร (ขาดทุน) สุทธิจากเงินลงทุน	168,506,696.01
รายการกำไร (ขาดทุน) สุทธิจากสัญญาอนุพันธ์	(83,602,194.39)
รายการกำไร (ขาดทุน) สุทธิจากอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ	70,763,736.13
รวมรายการกำไร(ขาดทุน) สุทธิจากการลงทุน	155,668,237.75

การเพิ่มขึ้น(ลดลง)ในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงานก่อนภาษีเงินได้	155,174,651.73
--	----------------

<b>หัก</b> ภาษีเงินได้	2,082.56
------------------------	----------

การเพิ่มขึ้น(ลดลง)ในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงานหลังภาษีเงินได้	155,172,569.17
--	----------------

รายงานการลงทุนในหลักทรัพย์และทรัพย์สินอื่น  
กองทุนเปิดบีแคป หุ้นยูเอส เอ็นดี 100 (BCAP-USND100)  
30 กันยายน 2564

ชื่อหลักทรัพย์	จำนวนหน่วย (หน่วย) /มูลค่าหน้าตัว (บาท)	มูลค่าตามราคาตลาด ไม่รวมดอกเบี้ยค้างรับ (บาท)	% เงินลงทุน	มูลค่าตาม ราคาตลาด (บาท)	%NAV
<b>หลักทรัพย์หรือทรัพย์สินในประเทศ</b>					
<b>เงินฝากธนาคาร</b>				<b>21,396,841.85</b>	<b>2.26</b>
<b>ออมทรัพย์</b>					
CASH	ธนาคารกรุงศรีอยุธยา จำกัด	21,387,673.34	0.00	21,394,841.85	2.26
<b>กระแสรายวัน</b>					
CASH	ธนาคารกรุงศรีอยุธยา จำกัด	2,000.00	0.00	2,000.00	0.00
<b>ตราสารอนุพันธ์</b>				<b>-21,765,283.52</b>	<b>-2.30</b>
สัญญาซื้อขายล่วงหน้า				-21,765,283.52	-2.30
<b>หลักทรัพย์หรือทรัพย์สินต่างประเทศ</b>					
<b>เงินฝากธนาคาร</b>				<b>1,072,469.33</b>	<b>0.11</b>
<b>ออมทรัพย์</b>					
CASH-USD	ธนาคารเจพีมอร์แกน เซส	1,072,469.33	0.00	1,072,469.33	0.11
<b>หน่วยลงทุน</b>				<b>946,808,860.65</b>	<b>99.97</b>
<b>กองทุนตราสารทุน</b>					
QQQ US	Invesco	78,130	946,808,860.65	100.00	946,808,860.65
<b>สินทรัพย์อื่นและหนี้สินอื่น</b>				<b>-378,893.42</b>	<b>-0.04</b>
<b>ทรัพย์สินอื่น ๆ</b>				1,060,239.05	0.11
<b>หนี้สินอื่น ๆ</b>				-1,439,132.47	-0.15
<b>รวมทั้งสิ้น</b>		<b>947,126,826.38</b>	<b>100.00</b>	<b>947,133,994.89</b>	<b>100.00</b>

รายชื่อบุคคลที่เกี่ยวข้องที่มีการทำธุรกรรมกับกองทุน  
สำหรับระยะเวลาตั้งแต่วันที่ 1 เมษายน 2564 ถึงวันที่ 30 กันยายน 2564

- ไม่มี -

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

การรับผลประโยชน์ตอบแทนเนื่องจากการที่กองทุนใช้บริการบุคคลอื่น (Soft Commission)

ระหว่างวันที่ 1 เมษายน 2564 ถึงวันที่ 30 กันยายน 2564

ลำดับ	บริษัทที่ให้ผลประโยชน์	ผลประโยชน์ที่ได้รับ	เหตุผลในการรับผลประโยชน์
1	บริษัท มอร์แกน สแตนเลย์ จำกัด	ข่าวสาร และบทวิเคราะห์ ฯลฯ	เพื่อประโยชน์ในการลงทุนของกองทุน
2	ธนาคารคอมเมิร์ซ เอจี	ข่าวสาร และบทวิเคราะห์ ฯลฯ	เพื่อประโยชน์ในการลงทุนของกองทุน
3	บริษัท โฟล์ว เทรดเดอร์	ข่าวสาร และบทวิเคราะห์ ฯลฯ	เพื่อประโยชน์ในการลงทุนของกองทุน
4	บริษัท เจน สตรีท โฟแนนเซียล จำกัด	ข่าวสาร และบทวิเคราะห์ ฯลฯ	เพื่อประโยชน์ในการลงทุนของกองทุน
5	บริษัทหลักทรัพย์ มิซูโฮ จำกัด	ข่าวสาร และบทวิเคราะห์ ฯลฯ	เพื่อประโยชน์ในการลงทุนของกองทุน
6	SOCIETE GENERALE S.A.	ข่าวสาร และบทวิเคราะห์ ฯลฯ	เพื่อประโยชน์ในการลงทุนของกองทุน
7	UOB KAY HIAN PRIVATE LIMITED	ข่าวสาร และบทวิเคราะห์ ฯลฯ	เพื่อประโยชน์ในการลงทุนของกองทุน



รายงานการลงทุนที่ไม่เป็นไปตามนโยบายการลงทุนเฉลี่ย  
ในช่วงเวลาตั้งแต่วันที่ 1 เมษายน 2564 ถึงวันที่ 30 กันยายน 2564

พบว่ากองทุนมีการลงทุนเป็นไปตามนโยบายการลงทุน

