



รายงานสถานะกองทุน และผลการดำเนินงาน ณ 30 กันยายน 2559

กองทุนสำรองเลี้ยงชีพ เค มาสเตอร์ พูล ฟันด์
ซึ่งจดทะเบียนแล้ว

นโยบาย ตราสารหนี้

เฉพาะส่วนมหาวิทยาลัยเทคโนโลยีราชมงคลสุวรรณภูมิ

วันพฤหัสบดีที่ 27 ตุลาคม 2559

บริการทุกระดับประทับใจ



สรุป การเปลี่ยนแปลงของกองทุน

มกราคม - กันยายน 2559

อัตราผลตอบแทนสะสม = 1.53%

รายได้สุทธิจากการจัดการกองทุน = 152,094,267.45 บาท

	ณ 31 ธันวาคม 2558	ณ 30 กันยายน 2559	เปลี่ยนแปลง
มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ (NAV) (ล้านบาท)	9,370.36	10,966.90	17.04%
มูลค่าทรัพย์สินสุทธิต่อหน่วย (NAV per unit)	14.9261	15.1544	1.53%
จำนวนนายจ้าง	781	855	9.48%
จำนวนสมาชิก	49,860	58,244	16.82%

บริการทุกระดับประทับใจ



สรุป การเปลี่ยนแปลงของกองทุนเฉพาะส่วน มหาวิทยาลัยเทคโนโลยีราชมงคลสุวรรณภูมิ

	ณ 31 ธันวาคม 2558	ณ 30 กันยายน 2559
จำนวนสมาชิก (คน)	339	370
ส่วนของสมาชิก		
เงินสะสม	6,958,856.64	9,163,124.15
ผลประโยชน์เงินสะสม	387,914.40	510,874.52
รวมส่วนของสมาชิก	7,346,771.04	9,673,998.67
ส่วนของนายจ้าง		
เงินสมทบ	6,958,856.64	9,163,124.15
ผลประโยชน์เงินสมทบ	387,933.83	510,894.18
รวมส่วนของนายจ้าง	7,346,790.47	9,674,018.33
รวมมูลค่าทรัพย์สินสุทธิ	14,693,561.51	19,348,017.00

บริการทุกระดับประทับใจ



รายงานสถานะ และสัดส่วนการลงทุน



สถานะของกองทุน

	ณ 31 ธ.ค. 2558	ณ 30 ก.ย. 2559
จำนวนสมาชิก (คน)	49,860	58,244
จำนวนนายจ้าง (บริษัท)	781	855
ส่วนของสมาชิก		
เงินสะสม	3,749,523,873.65	4,475,498,113.57
ผลประโยชน์เงินสะสม	709,552,735.63	847,732,470.50
รวมส่วนของสมาชิก	4,459,076,609.28	5,323,230,584.07
ส่วนของนายจ้าง		
เงินสมทบ	4,271,001,852.48	4,924,143,381.22
ผลประโยชน์เงินสมทบ	640,279,993.30	719,526,495.27
รวมส่วนของนายจ้าง	4,911,281,845.78	5,643,669,876.49
รวมมูลค่าทรัพย์สินสุทธิ	9,370,358,455.06	10,966,900,460.56
รายการเปลี่ยนแปลงมูลค่าทรัพย์สินสุทธิเพิ่มขึ้น (ลดลง)		1,596,542,005.50
รายได้จากการลงทุนสุทธิ		152,094,267.45
รายได้อื่นนอกเหนือจากการลงทุน		15,815,318.74
เงินนำส่งเข้ากองทุนจากสมาชิกและนายจ้าง		2,787,614,905.21
เงินจ่ายคืน สมาชิกและนายจ้าง		(1,358,982,485.90)

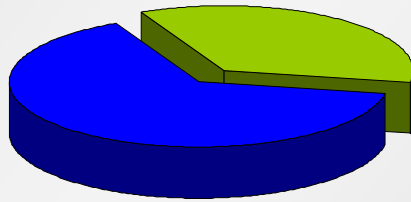
บริการทุกระดับประทับใจ



สัดส่วนการลงทุน

นโยบายการลงทุน*

ตราสารหนี้ภาคเอกชน อาทิ
- หุ้นกู้ ตัวแลกเงิน
บริษัทเอกชน ≤ 35%



≥ 65%

เงินฝาก ตราสารหนี้ภาครัฐ
และสถาบันการเงิน อาทิ

- พันธบัตรรัฐบาล รัฐวิสาหกิจ
- ตัวเงินคลัง
- ตราสารหนี้ของธนาคาร
สถาบันการเงิน

* แผนการลงทุนอาจมีการเปลี่ยนแปลงได้ตามสภาวะตลาด
ภายใต้กรอบของสัญญา

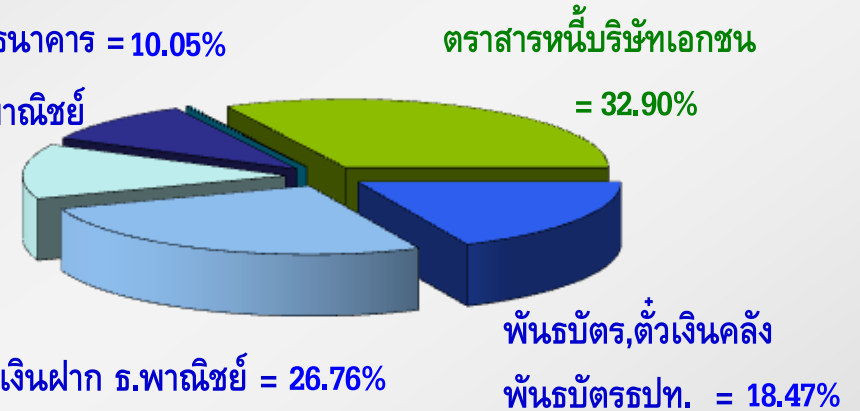
สัดส่วนการลงทุนของกองทุน ณ 30 กันยายน 2559

ตราสารหนี้รัฐวิสาหกิจวิธึงบประมาณ = 0.20%

ตราสารหนี้ธนาคาร = 10.05%

บัตรเงินฝากที่ธนาคารพาณิชย์

เป็นผู้ออก = 13.12%



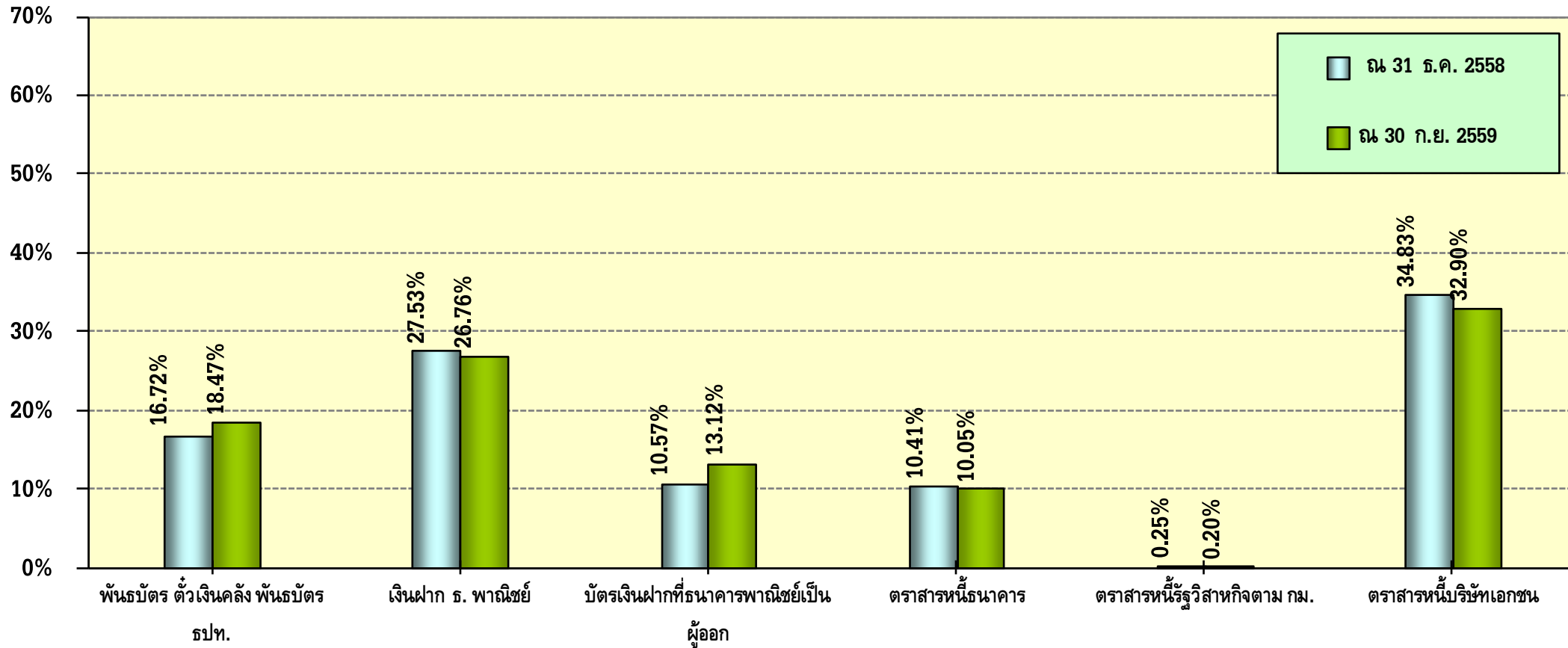
เงินฝาก ธ.พาณิชย์ = 26.76%

พันธบัตร, ตัวเงินคลัง

พันธบัตรรพท. = 18.47%



กราฟเปรียบเทียบสัดส่วนการลงทุน ปี 2558 และ ณ 30 กันยายน 2559



บริการทุกระดับประทับใจ

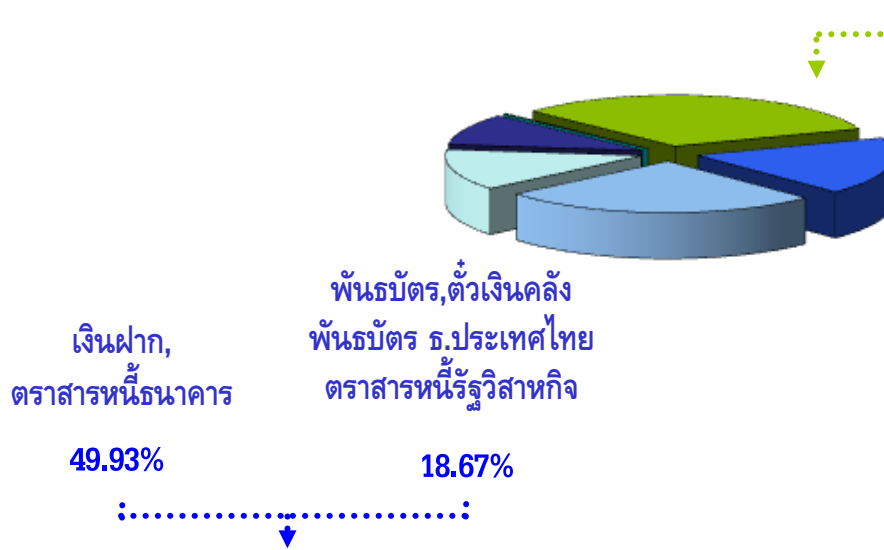


รายละเอียดเงินลงทุน ณ 30 กันยายน 2559





Top Holdings



ตราสารหนี้บริษัทจำกัด 32.90%

ตราสารหนี้บริษัทจำกัด =	14.81%	
หุ้นกู้	%	Rating
บมจ. ซีพี ออลล์	6.03%	A(tha)
บมจ.เจริญโภคภัณฑ์อาหาร	2.63%	A+
บจก. น้ำตาลมิตรผล	2.40%	A+
บมจ. บัตรกรุงไทย	1.93%	A+
บริษัท ไทยโอริกซ์ลีสซิ่ง จำกัด	1.81%	AA+

ตราสารหนี้ภาครัฐ และสถาบันการเงิน (ไม่รวมบัญชีดำเนินการ) =	49.35%
	%
ธนาคารอาคารสงเคราะห์ - เงินฝากประจำ	14.51%
ธนาคารธนชาติ จำกัด (มหาชน) - บัตรเงินฝาก	13.12%
พันธบัตรรัฐบาล	8.20%
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย	7.82%
ธนาคารกรุงไทย จำกัด(มหาชน) - เงินฝากประจำ	5.69%

บริการทุกระดับประทับใจ



รายละเอียดเงินลงทุน ณ 30 กันยายน 2559

พันธบัตร ตัวเงินคลัง พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย	ราคายุติธรรม	ร้อยละของราคายุติธรรม
พันธบัตรรัฐบาล	899,504,557.30	8.20%
พันธบัตรที่กระทรวงการคลังค้ำประกัน	268,439,013.63	2.45%
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย	857,992,862.63	7.82%
รวม	2,025,936,433.56	18.47%

รายละเอียดเงินลงทุน ณ 30 กันยายน 2559

เงินฝากธนาคาร		ราคายุติธรรม	ร้อยละของราคายุติธรรม	Credit Rating
<u>เงินฝากออมทรัพย์ / เงินฝากสกุลเงินต่างประเทศ</u>				
GSB	ธนาคารออมสิน	4,805.67	0.00%	
KBANK	ธนาคารกสิกรไทย จำกัด (มหาชน)	171,055,823.52	1.56%	AA+(tha)
KTB	ธนาคารกรุงไทย จำกัด(มหาชน)	3,411,220.50	0.03%	AA+(tha)
SCB	ธนาคาร ไทยพาณิชย์ จำกัด(มหาชน)	2,346,789.91	0.02%	AA(thai)
<u>เงินฝากประจำ</u>				
GHB	ธนาคารอาคารสงเคราะห์	1,591,131,316.44	14.51%	AAA(thai)
GSB	ธนาคารออมสิน	542,372,465.66	4.95%	
KTB	ธนาคารกรุงไทย จำกัด(มหาชน)	624,430,491.80	5.69%	AA+(tha)
รวม		2,934,752,913.50	26.76%	
<u>บัตรเงินฝากที่ธนาคารพาณิชย์เป็นผู้ออก</u>		ราคายุติธรรม	ร้อยละของราคายุติธรรม	Credit Rating
<u>บัตรเงินฝาก</u>				
TBANK	ธนาคารธนชาติ จำกัด (มหาชน)	1,439,162,479.46	13.12%	AA-
รวม		1,439,162,479.46	13.12%	



รายละเอียดเงินลงทุน ณ 30 กันยายน 2559

ตราสารแห่งหนึ่งที่ธนาคารเป็นผู้ออก		ราคายุติธรรม	ร้อยละของราคายุติธรรม	Credit Rating
พันธบัตร				
KEXIM	ธนาคารเพื่อการส่งออกและนำเข้าแห่งประเทศไทย	1,532,320.17	0.01%	Aa3
หุ้นกู้				
BAY	ธนาคารกรุงศรีอยุธยา จำกัด (มหาชน)	142,623,878.70	1.30%	AAA(tha)
KKP	ธนาคารเกียรตินาคิน จำกัด (มหาชน)	229,431,400.95	2.09%	A-
TISCOB	ธนาคารทีสโก้ จำกัด (มหาชน)	618,741,317.08	5.64%	A
UOBT	ธนาคารยูโอบี จำกัด (มหาชน)	41,443,070.42	0.38%	AAA(tha)
WOORIB	Woori Bank	68,162,724.29	0.62%	AAA(tha)
รวม		1,101,934,711.61	10.05%	



รายละเอียดเงินลงทุน ณ 30 กันยายน 2559

ตราสารแห่งหนึ่งที่รัฐวิสาหกิจตาม กม.ว่าด้วยวิธีการงบประมาณ		ราคายุติธรรม	ร้อยละของราคายุติธรรม	Credit Rating
<u>หุ้นกู้</u>				
SMCMB	บริษัทตลาดรองสินเชื่อที่อยู่อาศัย (บตท.)	22,084,553.44	0.20%	AA-
รวม		22,084,553.44	0.20%	



รายละเอียดเงินลงทุน ณ 30 กันยายน 2559

ตราสารแห่งหนึ่งที่บริษัทจำกัดเป็นผู้ออก		ราคายุติธรรม	ร้อยละของราคายุติธรรม	Credit Rating
<u>หุ้นกู้</u>				
CPALL	บมจ. ซีพี ออลล์	661,547,481.24	6.03%	A(thai)
CPF	บมจ.เจริญโภคภัณฑ์อาหาร	288,083,296.87	2.63%	A+
MPSC	บจก. น้ำตาลมิตรผล	263,390,862.70	2.40%	A+
KTC	บมจ. บัตรกรุงไทย	212,038,728.16	1.93%	A+
TOLC	บริษัท ไทยโอริกซ์ลีสซิ่ง จำกัด	198,783,367.44	1.81%	AA+
AP	บมจ. เอพี (ไทยแลนด์)	166,340,848.71	1.52%	A-
PL	บมจ. ภัทรลีสซิ่ง	161,090,398.90	1.47%	A-
OH	บมจ. ควอลิตี้เฮ้าส์	145,532,529.05	1.33%	A-
MBK	บมจ. เอ็ม บี เค	125,479,420.65	1.14%	A
SPCG	บมจ. เอสพีซีจี	118,723,773.46	1.08%	A-



รายละเอียดเงินลงทุน ณ 30 กันยายน 2559

	ตราสารแห่งหนึ่งที่บริษัทจำกัดเป็นผู้ออก	ราคายุติธรรม	ร้อยละของราคายุติธรรม	Credit Rating
	หุ้นกู้			
EB	บมจ. อีซี บาย	113,777,271.08	1.04%	AA+(tha)
MBTH	บจก.เมอร์เซเดส-เบนซ์ (ประเทศไทย)	102,392,531.72	0.93%	AAA(thai)
ICBCTL	บริษัท ลีส์ซิ่งไอซีบีซี (ไทย) จำกัด (มหาชน)	102,327,024.15	0.93%	AAA(thai)
MINT	บมจ. ไมเนอร์ อินเตอร์เนชั่นแนล	90,697,935.12	0.83%	A+
KSL	บมจ. น้ำตาลขอนแก่น	89,905,593.09	0.82%	A
NTL	บริษัท เงินติดล้อ จำกัด	89,037,671.02	0.81%	A
BJC	บมจ. เบอร์ลี่ ยุคเกอร์	87,460,748.16	0.80%	A+
CPFTH	บริษัท ซีพีเอฟ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)	74,534,253.55	0.68%	A+
GL	บมจ. กรู๊ปลี่ส์	60,022,716.72	0.55%	A-
PTTGC	บมจ. พีทีที โกลบอล เคมิคอล	57,573,309.22	0.52%	AA(thai)



รายละเอียดเงินลงทุน ณ 30 กันยายน 2559

	ตราสารแห่งหนึ่งที่บริษัทจำกัดเป็นผู้ออก	ราคายุติธรรม	ร้อยละของราคายุติธรรม	Credit Rating
	หุ้นกู้			
IVL	บริษัท อินโดรามา เวนเจอร์ส จำกัด(มหาชน)	57,271,420.61	0.52%	A+
PS	บมจ. พุกขารีย์เอสเตท	52,608,932.68	0.48%	A
TCAP	บมจ. ทูมธนาชาติ	50,282,184.66	0.46%	A+
SPALI	บมจ.ศุภาลัย	39,545,707.58	0.36%	A
TTL	บจก. ทิสโก้ โตเกียว ลีสซิ่ง	36,727,988.77	0.33%	AA+
TLT	บจก. โตโยต้า ลีสซิ่ง (ประเทศไทย)	30,841,429.87	0.28%	AAA
THCOM	บริษัท ไทยคม จำกัด (มหาชน)	17,403,823.45	0.16%	A-
LH	บมจ.แลนด์ แอนด์ เฮ้าส์	11,860,318.38	0.11%	A+
HMPRO	บมจ.โฮม โปรดักส์ เซ็นเตอร์	11,538,911.81	0.11%	A+
TOP	บมจ.ไทยออยล์	10,205,521.65	0.09%	AA-(tha)

รายละเอียดเงินลงทุน ณ 30 กันยายน 2559

	ตราสารแห่งหนึ่งที่บริษัทจำกัดเป็นผู้ออก	ราคายุติธรรม	ร้อยละของราคายุติธรรม	Credit Rating
	<u>หุ้นกู้</u>			
SCC	บมจ.ปูนซีเมนต์ไทย	1,750,352.08	0.02%	A(thai)
AWN	บริษัท แอดวานซ์ ไวร์เลส เน็ทเวอร์ค จำกัด	536,617.31	0.00%	AA+(thai)
SCCC	บมจ.ปูนซีเมนต์นครหลวง	512,785.88	0.00%	A(thai)
CPN	บมจ. เซ็นทรัลพัฒนา	455,052.82	0.00%	AA-
TUC	บจก.ทรู มูฟ เอช ยูนิเวอร์แซล คอมมิวนิเคชั่น	307,174.69	0.00%	BBB+
TU	บมจ.ไทยยูเนี่ยน กรุ๊ป	211,218.70	0.00%	AA-
DAD	บริษัท ดีเอตี เอสพีวี จำกัด	163,584.63	0.00%	AAA
GLOW	บมจ. โกลว์ พลังงาน	124,106.56	0.00%	A+
	<u>หุ้นกู้ที่ธนาคารพาณิชย์ค้ำประกัน</u>			
SCB	ธนาคาร ไทยพาณิชย์ จำกัด(มหาชน)	77,500,060.86	0.71%	AA
	รวม	3,608,586,954.00	32.90%	

บริการทุกระดับประทับใจ



โครงสร้างรายได้ และอัตราผลตอบแทนสะสม

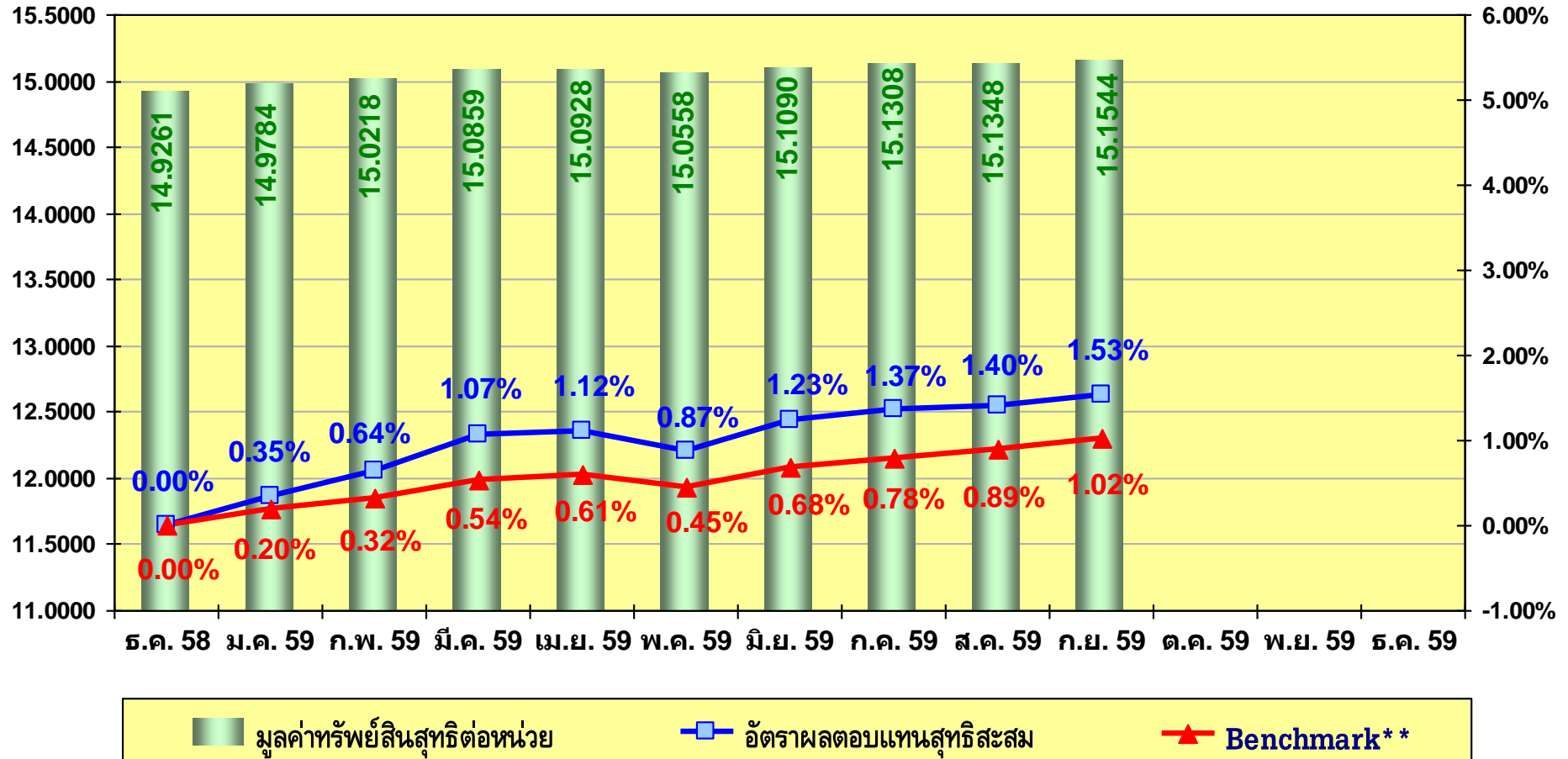


โครงสร้างรายได้สะสม

	ณ 31 ธ.ค. 2558	ณ 30 ก.ย. 2559
รายได้จากเงินลงทุน		
ดอกเบี๋ยรับจากเงินฝากธนาคาร	76,741,705.89	41,912,450.61
ดอกเบี๋ยรับจากบัตรเงินฝาก	19,535,132.88	16,924,618.51
ดอกเบี๋ยรับจากพันธบัตรและตั๋วเงินคลัง	40,506,288.87	24,159,310.42
ดอกเบี๋ยรับจากตั๋วสัญญาใช้เงินและตั๋วแลกเงิน	893,195.84	2,132,500.68
ดอกเบี๋ยรับจากหุ้นกู้	101,221,309.97	91,803,285.93
	238,897,633.45	176,932,166.15
รายได้จากการจัดการอื่นๆ	205,112.50	0.01
กำไร(ขาดทุน)จากเงินลงทุนและจากการตีราคาหลักทรัพย์	96,382,988.32	19,082,940.34
รวมรายได้จากการจัดการและปรับมูลค่าฯ	335,485,734.27	196,015,106.50
ค่าใช้จ่าย	(49,146,025.84)	(43,920,839.05)
รายได้สุทธิจากเงินลงทุน	286,339,708.43	152,094,267.45



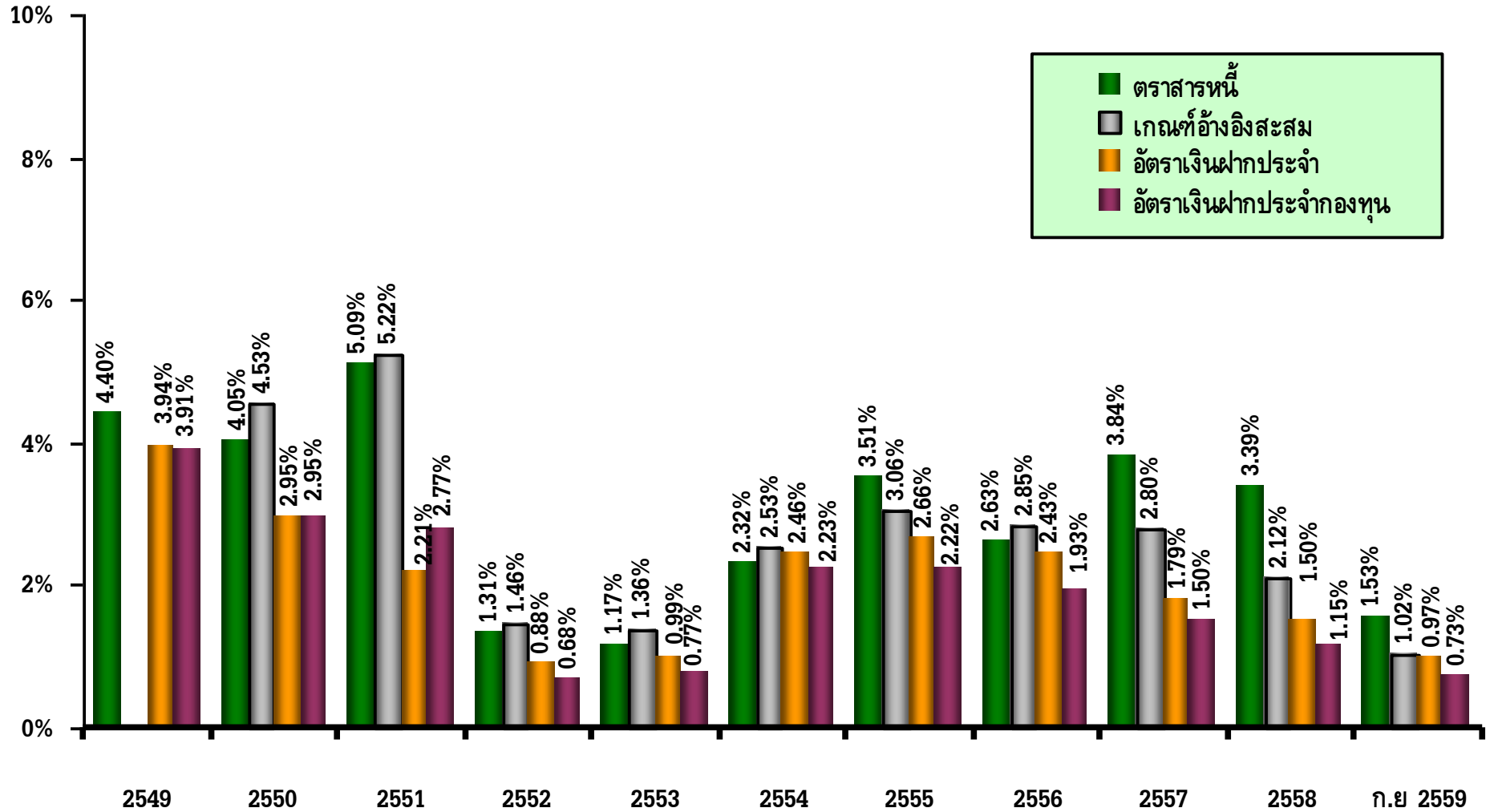
อัตราผลตอบแทนสะสม ม.ค. - ก.ย. 2559



* **Benchmark** = 50% ของอัตราดอกเบี้ยเงินฝากประจำ 1 ปีที่กองทุนสำรองเลี้ยงชีพได้รับวงเงิน 1 ล้านบาทเฉลี่ยของ BBL, KBANK, SCB, KTB + 50% ของอัตราผลตอบแทนดัชนีอัตราผลตอบแทนการลงทุนในพันธบัตรรัฐบาลอายุคงที่ของสมาคมตราสารหนี้ไทยอายุ 2 ปี



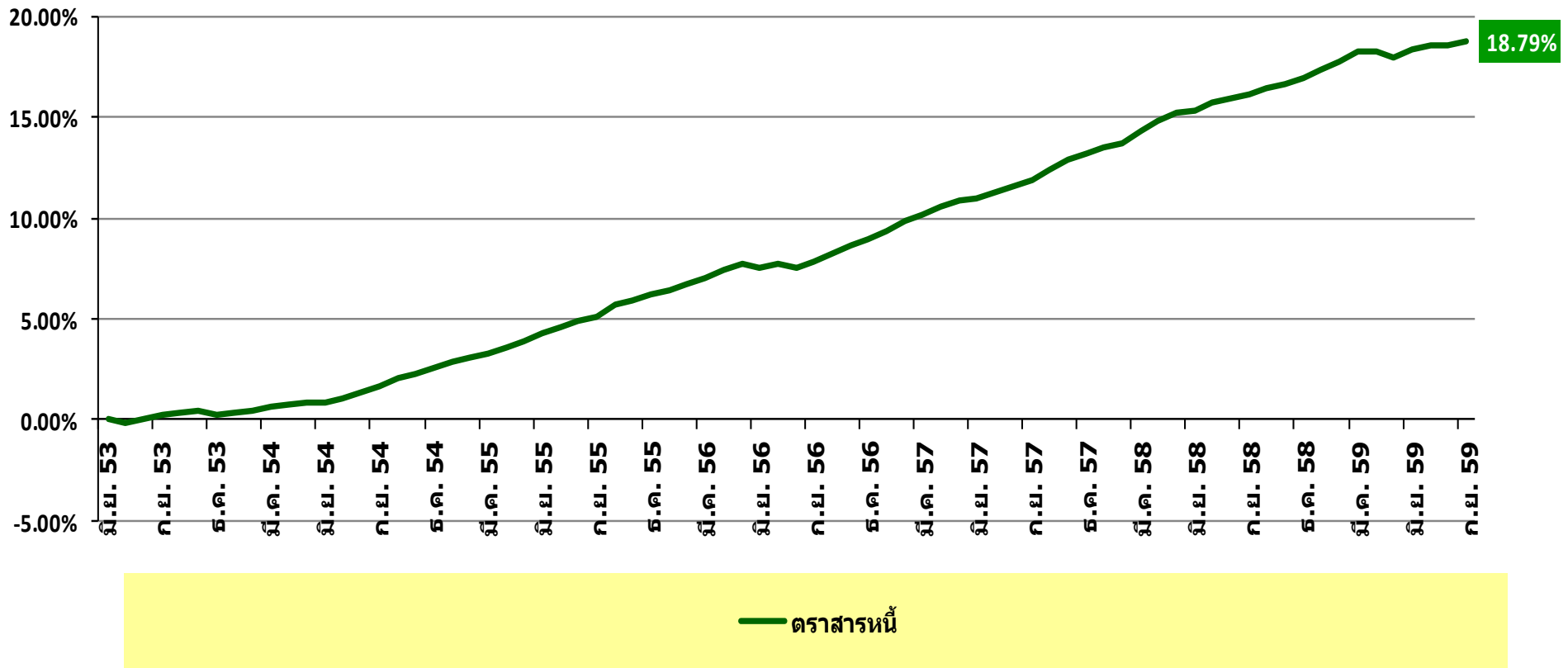
อัตราผลตอบแทนย้อนหลัง



บริการทุกระดับประทับใจ



การเปลี่ยนแปลงของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิต่อหน่วย ระยะเวลา 6 ปี 3 เดือน (1 ก.ค. 2553 – 30 ก.ย. 2559)



บริการทุกระดับประทับใจ



KASIKORNTHAI

บริการทุกระดับประทับใจ