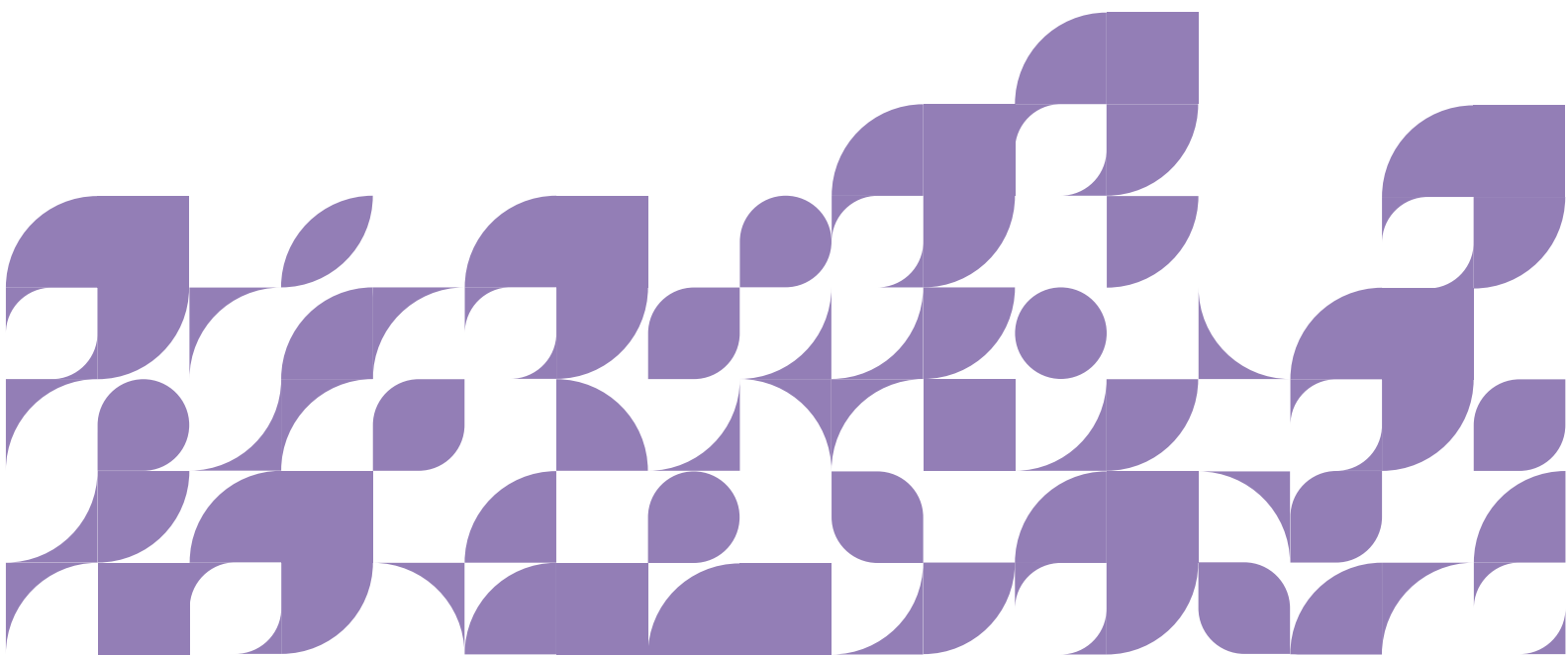




กองทุนเปิดไทยพาณิชย์
SET BANKING SECTOR INDEX
(SCBBANKING)

ร าย ง า น ป ร ะ จ ำ 6 เดือน
วันที่ 1 สิงหาคม 2555 ถึงวันที่ 31 มกราคม 2556



สารสนเทศจากบริษัทจัดการ

เรียน ท่านผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุน

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด ในฐานะบริษัทจัดการกองทุนเปิดไทยพาณิชย์ SET BANKING SECTOR INDEX (SCBBANKING) ซึ่งลงทุนในหุ้นทุนจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยที่เป็นส่วนประกอบของดัชนีหมวดธุรกิจธนาคาร (Banking Sector) ดังนั้น ผลตอบแทนโดยรวมของกองทุนจะใกล้เคียงกับดัชนีของหมวดธุรกิจดังกล่าว (SETBANK Index)

ดัชนีตลาดหลักทรัพย์ของกลุ่มธนาคารปรับตัวสูงขึ้นในช่วงเดือนสิงหาคมถึงกันยายนของปี 2555 ที่อัตรา 5.03% ในขณะที่ตลาดโดยรวม (SET Index) ปรับตัวขึ้น 8.3% เนื่องจากผลประกอบการของกลุ่มธนาคารที่แข็งแกร่ง จากการเติบโตของสินเชื่อรายย่อยสำหรับรถยนต์และบ้านสูงกว่าค่าจากมาตรการของภาครัฐ และปัจจัยหนุนอื่นๆ เช่น การใช้นโยบายการเงินแบบผ่อนคลายเพื่ออัดฉีดเงินเข้าระบบเศรษฐกิจของทั้ง FED ซึ่งออก QE3 แบบปลายเปิด และการที่ ECB ประกาศใช้นโยบายเข้าซื้อพันธบัตรรัฐบาลแบบไม่จำกัด

ในเดือนตุลาคมถึงช่วงกลางพฤศจิกายน ดัชนีตลาดหลักทรัพย์อ่อนตัวลงชั่วคราวจากความกังวลถึงเรื่องความสามารถในการกระตุ้นเศรษฐกิจหลังการเลือกตั้งประธานาธิบดีรวมไปถึงปัญหา Fiscal Cliff ของสหรัฐฯ

นับตั้งปลายเดือนพฤศจิกายน 2555 ถึงมกราคม 2556 ดัชนีปรับตัวสูงขึ้นอีกครั้ง หลังจากรัฐบาลสหรัฐฯ สามารถหาทางออกของประเด็น Fiscal cliff ได้ระดับหนึ่ง ประกอบกับผลการดำเนินงานของธนาคารพาณิชย์ที่ออกมาดี แม้ธนาคารบางแห่งได้ตั้งค่าเผื่อนี้สงสัยจะสูญเพิ่มเติมพิเศษในไตรมาส 4 แต่นับเป็นโอกาสดีที่ฐานะทางการเงินจะแข็งแกร่งยิ่งขึ้น อัตราการขยายตัวของสินเชื่อยังอยู่ในเกณฑ์ดี มีปัจจัยหลักจากการเร่งตัวของการลงทุนภาครัฐและการเติบโตของเศรษฐกิจในประเทศโดยรวม

ท้ายสุด บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด ขอขอบคุณผู้ถือหุ้นทุกท่าน ที่ให้การส่งเสริมและสนับสนุนด้วยดีมาโดยตลอด

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด

ความเห็นของผู้ดูแลผลประโยชน์

เรียน ผู้ถือหน่วยลงทุน กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ SET BANKING SECTOR INDEX

ข้าพเจ้า บมจ. ธนาคารกสิกรไทย ในฐานะผู้ดูแลผลประโยชน์ ได้ดูแลการจัดการกองทุนเปิดไทยพาณิชย์ SET BANKING SECTOR INDEX ซึ่งจัดการโดยบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด สำหรับระยะเวลา ตั้งแต่วันที่ 1 สิงหาคม พ.ศ. 2555 ถึงวันที่ 31 มกราคม พ.ศ. 2556 แล้ว

ข้าพเจ้าเห็นว่า บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด ได้ปฏิบัติหน้าที่ในการจัดการ กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ SET BANKING SECTOR INDEX เหมาะสมตามสมควรแห่งวัตถุประสงค์ ที่ได้กำหนดไว้ใน โครงการและภายใต้พระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535

ผู้ดูแลผลประโยชน์

บมจ. ธนาคารกสิกรไทย



(นางสาวเสาวลักษณ์ จักษ์ตรีมงคล)
ผู้ช่วยผู้อำนวยการ ฝ่ายบริการธุรกิจหลักทรัพย์



(นางสาวอมรศิริ วัฒนวงศ์พิทักษ์)
หัวหน้าส่วน ฝ่ายบริการธุรกิจหลักทรัพย์

วันที่ 21 กุมภาพันธ์ พ.ศ. 2556

ผลการดำเนินงาน

ข้อมูล ณ วันที่ 31 มกราคม 2556

ผลตอบแทนจากการลงทุน	ย้อนหลัง 3 เดือน 31 ต.ค. 55 -31 ม.ค. 56	ย้อนหลัง 6 เดือน 31 ก.ค. 55 -31 ม.ค. 56	ย้อนหลัง 1 ปี 31 ม.ค. 55 -31 ม.ค. 56	ย้อนหลัง 3 ปี 29 ม.ค. 53 -31 ม.ค. 56	นับแต่จัดตั้ง กองทุน 28 มี.ย. 54 -31 ม.ค. 56
กองทุน SCBBANKING	+14.05%	+16.25%	+48.74%	N/A	+47.25%
SETBANK Index	+14.48%	+16.00%	+46.46%	N/A	+46.90%

หมายเหตุ : เอกสารการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวมฉบับนี้ได้จัดทำขึ้นตามมาตรฐานการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวมของสมาคมบริษัทจัดการลงทุน

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด
 กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ SET BANKING SECTOR INDEX
 รายละเอียดหลักทรัพย์ และสัดส่วนการลงทุน
 ณ. วันที่ 31 ม.ค. 2556

ชื่อหลักทรัพย์	ราคา ณ 31 ม.ค. 2556 (บาท)	จำนวนหุ้น (หุ้น)	มูลค่า ตามราคาตลาด (บาท)	ร้อยละของมูลค่า ทรัพย์สินสุทธิ (%)	ค่าประกัน/รับรอง/รับอาวัล หรือสลักหลังโอน แบบมีสิทธิไต่เบี่ย
เงินฝากธนาคาร			19,658,741.00	10.68%	
บมจ.ธนาคารกสิกรไทย (KBANK)			19,658,741.00	10.68%	
หุ้นจดทะเบียน			188,474,437.00	102.37%	
ธนาคาร				%	
บมจ.ธนาคารกรุงศรีอยุธยา (BAY)	33.25	496,600.00	16,511,950.00	8.97%	
บมจ.ธนาคารกรุงเทพ (BBL)	209.00	156,000.00	32,604,000.00	17.71%	
บมจ.ธนาคาร ซีไอเอ็มบี ไทย (CIMBT)	2.60	1,723,730.00	4,481,698.00	2.43%	
บมจ.ธนาคารกสิกรไทย (KBANK)	198.50	195,700.00	38,846,450.00	21.10%	
บมจ.ธนาคารเกียรตินาคิน (KK)	49.75	68,200.00	3,392,950.00	1.84%	
บมจ.ธนาคารกรุงไทย (KTB)	22.90	1,142,575.00	26,164,967.50	14.21%	
บริษัท แอล เอช ไฟแนนซ์เชียล กรุ๊ป จำกัด (มหาชน) (LHBANK)	1.50	979,263.00	1,468,894.50	0.80%	
บมจ.ธนาคารไทยพาณิชย์ (SCB)	179.00	277,400.00	49,654,600.00	26.97%	
บมจ.ทุนธนาชาติ (TCAP)	38.75	109,000.00	4,223,750.00	2.29%	
บมจ.ทีสโก้ไฟแนนเชียลกรุ๊ป (TISCO)	51.75	59,500.00	3,079,125.00	1.67%	
บมจ.ธนาคารทหารไทย (TMB)	2.26	3,560,200.00	8,046,052.00	4.37%	
สินทรัพย์อื่น ๆ			8,335.60	0.00%	
หนี้สิน			-24,029,851.32	-13.05%	
มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ			184,111,662.28	100.00%	
มูลค่าหน่วยลงทุน (บาท)			14.1555		

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด
 กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ SET BANKING SECTOR INDEX
 รายงานสรุปเงินลงทุน
 ณ วันที่ 31 มกราคม 2556

กลุ่มของตราสาร	มูลค่าตามราคาตลาด	%NAV
(ก) ตราสารภาครัฐ ได้แก่ ตั๋วแลกเงิน พันธบัตรรัฐบาล พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย พันธบัตร หรือตราสารแห่งหนึ่งที่กองทุนเพื่อการฟื้นฟูและพัฒนาระบบสถาบันการเงิน หรือกระทรวงการคลัง เป็นผู้ออก ผู้รับรอง ผู้รับอาวัล หรือผู้ค้ำประกัน	-	-
(ข) ตราสารที่ธนาคารที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้น ธนาคารพาณิชย์ หรือบริษัทเงินทุนเป็นผู้ออก ผู้รับรอง ผู้รับอาวัล ผู้สืบทายาท หรือผู้ค้ำประกัน	19,664,161.57	10.68
(ค) ตราสารที่มีบริษัทที่ได้รับ rating ในระดับ investment grade เป็นผู้ออก ผู้รับรอง ผู้รับอาวัล ผู้สืบทายาท หรือผู้ค้ำประกัน	-	-
(ง) ตราสารที่มีบริษัทที่ได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือในระดับที่ต่ำกว่า investment grade หรือไม่มี rating เป็นผู้ออก ผู้รับรอง ผู้รับอาวัล ผู้สืบทายาท หรือผู้ค้ำประกัน	-	-

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

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนไทยพาณิชย์ จำกัด
 กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ SET BANKING SECTOR INDEX
 รายละเอียดตัวตราสารและอันดับความน่าเชื่อถือของตราสารทุกตัวใน Port
 ณ วันที่ 31 มกราคม 2556

ประเภท	ผู้ออก	ผู้ค้ำ/ผู้รับรอง/ผู้สัถหลัก	วันครบกำหนด	อันดับความน่าเชื่อถือของผู้ออกตราสาร		มูลค่าหน้าตัว	มูลค่าตามราคาตลาด
				TRIS Rating	FITCH Rating		
พันธบัตร							-
ตั๋วสัญญาใช้เงิน (สถาบันการเงิน)							-
ตั๋วสัญญาใช้เงิน							-
ตั๋วแลกเงิน (สถาบันการเงิน)							-
ตั๋วแลกเงิน							-
หุ้นกู้							-
อื่น ๆ							-

กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ SET BANKING SECTOR INDEX

SCB SET BANKING SECTOR INDEX FUND

แบบค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม

FUND'S DIRECT EXPENSES REPORT

ตั้งแต่วันที่ 1 สิงหาคม 2555 ถึงวันที่ 31 มกราคม 2556

Period from 1 August 2012 to 31 January 2013

ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม *	จำนวนเงิน หน่วย : พันบาท	ร้อยละต่อปีของ มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ
Fund's direct expenses		
ค่าธรรมเนียมการจัดการ (Management fee)	927	1.11
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ (Trustee fee)	27	0.03
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน (Registrar fee)	-	-
ค่าที่ปรึกษาการลงทุน (Advisory fee)	-	-
ค่าสอบบัญชี (Auditing fee)	28	0.03
ค่าประกาศหนังสือพิมพ์มูลค่าหน่วยลงทุน (Newspaper Publication Expense-NAV.)	39	0.05
ค่าใช้จ่ายงานทะเบียนกองทุน (Registration Expense)	23	0.03
ค่าธรรมเนียมธนาคาร (Bank fee)	51	0.06
ค่าใช้จ่ายอื่น ๆ (Other expenses)	1	-
รวมค่าใช้จ่ายทั้งหมด (Total Expense) **	1,096	1.31

* ค่าใช้จ่ายดังกล่าวได้รวมภาษีมูลค่าเพิ่มแล้ว / Including VAT

** ไม่รวมค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ และค่าธรรมเนียมต่าง ๆ ที่เกิดขึ้นจากการซื้อขายหลักทรัพย์

Excluding brokerage fee and other transactions fees

กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ SET BANKING SECTOR INDEX (SCBBANKING)

งบดุล

ณ วันที่ 31 มกราคม 2556

"ยังไม่ได้ตรวจสอบ"

"ยังไม่ได้สอบทาน"

บาท

สินทรัพย์

เงินลงทุนตามราคายุติธรรม

188,474,437.00

เงินสดและเงินฝากธนาคาร

19,658,741.00

ลูกหนี้จากเงินปันผลและดอกเบี้ย

5,420.57

ค่าใช้จ่ายรอตัดบัญชี

2,915.03

รวมสินทรัพย์

208,141,513.60

หนี้สิน

เจ้าหนี้จากการซื้อเงินลงทุน

18,777,561.84

เจ้าหนี้จากการรับซื้อคืนส่วนได้เสีย

5,041,155.29

เจ้าหนี้อื่น

960.00

ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย

201,968.49

หนี้สินอื่น

8,205.70

รวมหนี้สิน

24,029,851.32

สินทรัพย์สุทธิ

184,111,662.28

สินทรัพย์สุทธิ :-

ทุนที่ได้รับจากผู้ถือหน่วยลงทุน

130,063,529.81

กำไรสะสม

47,373,430.18

บัญชีปรับสมดุล

6,674,702.29

สินทรัพย์สุทธิ

184,111,662.28

จำนวนหน่วยลงทุนที่จำหน่ายแล้ว (หน่วย)

13,006,352.97

สินทรัพย์สุทธิต่อหน่วยลงทุน

14.1555

กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ SET BANKING SECTOR INDEX (SCBBANKING)

งบกำไรขาดทุน

รอบระยะเวลาตั้งแต่วันที่ 1 สิงหาคม 2555 ถึงวันที่ 31 มกราคม 2556

"ยังไม่ได้ตรวจสอบ"

"ยังไม่ได้สอบทาน"

บาท

รายได้จากการลงทุน

รายได้เงินปันผล

1,184,680.00

รายได้ดอกเบี้ย

883,250.82

รายได้ทั้งสิ้น

2,067,930.82

ค่าใช้จ่าย

ค่าธรรมเนียมจัดการ

926,996.42

ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์

26,740.31

ค่าสอบบัญชี

27,725.12

ค่าใช้จ่ายในการขายและรับซื้อคืนหน่วยลงทุน

18.40

ค่าใช้จ่ายอื่น

114,495.57

ค่าใช้จ่ายทั้งสิ้น

1,095,975.82

รายได้จากการลงทุนสุทธิ

971,955.00

รายการกำไรสุทธิจากเงินลงทุน

รายการกำไรสุทธิที่เกิดขึ้นจริง

19,252,702.07

รายการกำไรสุทธิที่ยังไม่เกิดขึ้นจริง

7,196,558.27

รวมรายการกำไรจากการลงทุนที่เกิดขึ้นและที่ยังไม่เกิดขึ้น

26,449,260.34

การเพิ่มขึ้นในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงาน

27,421,215.34

รายงานการซื้อขายหลักทรัพย์และค่าใช้จ่ายต่าง ๆ

VOLUME TRADE AND EXPENSES REPORT

ตั้งแต่วันที่ 1 สิงหาคม 2555 ถึง วันที่ 31 มกราคม 2556

Period from 1 August 2012 to 31 January 2013

	(พันบาท) / (Thousand Baht)
มูลค่าทรัพย์สินสุทธิเฉลี่ย / Average Net Assets Value	165,610
การซื้อขายหลักทรัพย์รวม / Volume Trade	
มูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์รวม	664,696
Total Volume Trade	
ค่าธรรมเนียมรายหน้าในการซื้อขายหลักทรัพย์รวม	571
Total Brokerage Fee	
ค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายอื่น ๆ รวม / Fee and other Expenses	1,096

	(ร้อยละ) / (Percentage)
สัดส่วนค่าธรรมเนียมรายหน้าในการซื้อขายหลักทรัพย์รวมคิดเป็นร้อยละของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์รวม	0.09
Brokerage Fee as	
Percentage of Total Trading Volume	
สัดส่วนค่าธรรมเนียมรายหน้าในการซื้อขายหลักทรัพย์รวมคิดเป็นร้อยละของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิเฉลี่ย	0.68
Brokerage Fee as	
Percentage of Average Net Assets Value	
สัดส่วนค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายอื่น ๆ รวมคิดเป็นร้อยละของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิเฉลี่ย	1.31
Fee and other Expenses as	
Percentage of Average Net Assets Value	

รายงานรายชื่อบริษัทนายหน้า และค่าธรรมเนียม ซื้อ-ขาย หลักทรัพย์
ของกองทุนเปิดไทยพาณิชย์ SET BANKING SECTOR INDEX
ระหว่างวันที่ 1 สิงหาคม 2555 ถึง 31 มกราคม 2556

ลำดับที่	ชื่อบริษัทนายหน้า	ค่านายหน้า (พันบาท)	อัตราส่วนค่านายหน้าแต่ละราย ต่อค่านายหน้าทั้งหมด
1	บริษัทหลักทรัพย์ ไทยพาณิชย์ จำกัด	310.86	54.48%
2	บมจ.หลักทรัพย์ เคจีไอ (ประเทศไทย)	259.77	45.52%
รวม		570.64	100.00%

การรับผลประโยชน์ตอบแทนเนื่องจากการที่กองทุนให้บริการบุคคลอื่น

บริษัทที่ให้ผลประโยชน์	ผลประโยชน์ที่ได้รับ*					
	บทวิเคราะห์ ¹	ข้อมูลพื้นฐาน ²	รายงานสรุปข่าว ³	สัมมนา ⁴	บรรยายกลยุทธ์การลงทุน ⁵	จัดเยี่ยมชมบริษัท ⁶
บริษัทหลักทรัพย์ เอเซีย พลัส จำกัด (มหาชน)	✓	✓	✓		✓	✓
บริษัทหลักทรัพย์ บัวหลวง จำกัด (มหาชน)	✓	✓	✓	✓	✓	✓
บริษัทหลักทรัพย์ ซี แอล เอส เอ (ประเทศไทย) จำกัด	✓	✓	✓		✓	
บริษัทหลักทรัพย์ โนมูระ พัฒนสิน จำกัด (มหาชน)	✓	✓	✓		✓	✓
บริษัทหลักทรัพย์เครดิต สวิส (ประเทศไทย) จำกัด	✓	✓	✓	✓	✓	
บริษัทหลักทรัพย์ เมย์แบงก์ กิมเอ็ง (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)	✓	✓	✓	✓	✓	✓
บริษัทหลักทรัพย์ อภิกรไทย จำกัด (มหาชน)	✓	✓	✓		✓	
บริษัทหลักทรัพย์ ภัทร จำกัด (มหาชน)	✓	✓	✓	✓	✓	✓
บริษัทหลักทรัพย์ ไทยพาณิชย์ จำกัด	✓	✓	✓	✓	✓	✓
บริษัทหลักทรัพย์ธนชาต จำกัด (มหาชน)	✓	✓	✓	✓	✓	
บริษัทหลักทรัพย์ ฝิสโก้ จำกัด	✓	✓	✓		✓	✓
บริษัทหลักทรัพย์ ซีไอเอ็มบี (ประเทศไทย) จำกัด	✓	✓	✓		✓	✓
บริษัทหลักทรัพย์ ยูบีเอส (ประเทศไทย) จำกัด	✓	✓	✓		✓	
บริษัทหลักทรัพย์ เจทีเอ็มอาร์แกม (ประเทศไทย) จำกัด	✓	✓	✓		✓	
บริษัทหลักทรัพย์ แคที ซีมิโก้ จำกัด	✓	✓	✓		✓	
บริษัทหลักทรัพย์ คีนีเอส วิกเกอร์ส (ประเทศไทย) จำกัด	✓	✓	✓		✓	✓
บริษัทหลักทรัพย์ โอเอสเค (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)	✓	✓	✓		✓	

*ผลประโยชน์ที่ได้รับ

- 1. บทวิเคราะห์ (รายบริษัทและสภาพตลาดฯ รายวัน, รายเดือน, รายไตรมาส)
- 2. ข้อมูลพื้นฐาน (ข้อมูลตลาดฯ, งบการเงิน บมจ. ย้อนหลัง)
- 3. รายงานสรุปข่าวรายวัน และติดตามข่าวผ่าน SMS
- 4. จัดสัมมนาหัวข้อทางเศรษฐกิจหรือกลุ่มธุรกิจ
- 5. บรรยายสรุปกลยุทธ์การลงทุนรายไตรมาส
- 6. จัดเยี่ยมชมบริษัทที่กองทุนสนใจลงทุน

ข้อมูลการดำเนินการใช้สิทธิออกเสียงในที่ประชุมผู้ถือหุ้นในนามกองทุนรวมของรอบปีปฏิทินล่าสุด

สามารถตรวจสอบข้อมูลได้จาก Website : www.scbam.com