



# Mutual Funds Report

กองทุนเปิดไทยพาณิชย์  
**SET BANKING SECTOR INDEX**  
**(SCBBANKINGFUND)**

รายงานประจำ 6 เดือน  
ตั้งแต่วันที่ 1 สิงหาคม 2566 - 31 มกราคม 2567

## สารจากบริษัทจัดการ

## เรียน ท่านผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุน

กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ SET BANKING SECTOR INDEX (SCBBANKING) เป็นกองทุนรวมดัชนีที่ลงทุนในหุ้นทุนที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยที่เป็นส่วนประกอบของดัชนีหมวดธุรกิจธนาคาร (Banking Sector) ของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุนรวม ซึ่งจะจำลองการเคลื่อนไหวของดัชนีหมวดธุรกิจธนาคาร (Banking Sector) ของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย โดยผลตอบแทนโดยรวมอาจผันผวนตามราคาดัชนี SET BANK โดยในรอบ 6 เดือน ตั้งแต่วันที่ 1 สิงหาคม 2566 - 31 มกราคม 2567 ดัชนี SET BANK ปรับลงร้อยละ 10.89 สู่ระดับ 360.61 จุด

โดยในช่วงครึ่งปีหลังของปี 2566 ดัชนี SET BANK ปรับตัวลดลง จากแนวโน้มการคงอัตราดอกเบี้ยนโยบายภายหลังจากปรับขึ้นดอกเบี้ยในครั้งสุดท้าย ช่วงปลายเดือน ก.ย. โดยกำไรสุทธิกลุ่มธนาคารในช่วงครึ่งปีหลัง ปรับตัวสูงขึ้นเพิ่มขึ้น +17% YoY แต่ลดลง -9% HoH โดยผลการดำเนินงานในช่วงไตรมาสสี่ ส่วนใหญ่ออกมาต่ำกว่าที่ตลาดคาด โดยมีประเด็นสำคัญดังนี้ (1) ธนาคารส่วนใหญ่มีปริมาณ NPL เพิ่มขึ้นในช่วงไตรมาสสี่ ซึ่งส่งผลให้ Credit Cost ของกลุ่มธนาคารโดยรวมปรับตัวสูงกว่าที่ตลาดกว่าคาด เพราะมีการตั้งสำรองผลขาดทุนด้านเครดิตที่คาดว่าจะเกิดขึ้น ในขณะที่ (2) NIM ของกลุ่มธนาคารขยายตัวตามคาดที่ +19 bps QoQ ในไตรมาส 3 และ +12 bps QoQ ในไตรมาส 4 โดยได้รับการสนับสนุนจากการปรับขึ้นอัตราดอกเบี้ยในช่วงเดือนก.ย.-ต.ค. โดยเชื่อว่า NIM ในช่วงไตรมาส 4 คาดว่าจะเป็นระดับที่สูงสุดแล้ว (3) การเติบโตของสินเชื่อหดตัวเล็กน้อยจากการชำระคืนมากขึ้นของสินเชื่อธุรกิจขนาดใหญ่ และตัดหนี้สูญมากขึ้นในช่วงไตรมาส 4 รวมถึง (4) รายได้ที่ไม่ใช่ดอกเบี้ยของธนาคารส่วนใหญ่ยังคงอ่อนแอในช่วงครึ่งปีหลัง โดยมี (5) ค่าใช้จ่ายในการดำเนินงานเพิ่มมากกว่าที่คาดไว้ใน 4Q23 (+13% YoY, +14% QoQ)

สำหรับแนวโน้ม SET BANK ในช่วงครึ่งปีแรก 2567 คาดว่าจะมีโอกาสฟื้นตัวตามแนวโน้มการฟื้นตัวของกำไรสุทธิในช่วงครึ่งปีแรก โดยมีปัจจัยหนุนจาก NIM ที่สูงขึ้น และ ค่าใช้จ่ายในการดำเนินงานที่ลดลงตามฤดูกาลรวมถึง credit cost ที่คาดว่าจะปรับตัวลดลง แต่อย่างไรก็ตาม กำไรของกลุ่มธนาคารในปี 2567 อาจจะเติบโตในอัตราชะลอตัวลงจาก 16% ในปี 2566 สู่ 6% ในปี 2567 โดยมีสาเหตุมาจาก NIM ที่ขยายตัวน้อยลง โดยเป็นผลมาจาก (1) การตั้งสำรอง management overlay ที่น้อยลง แม้คาดว่า NPL จะเพิ่มขึ้น ทั้งนี้ยังมีความเสี่ยงที่จะมีการปรับลดชั้นสินเชื่อที่ปรับโครงสร้างหนี้แบบเบ็ดเสร็จ (ส่วนใหญ่อยู่ใน stage 2) ลงอีกจากการทยอยปรับเพิ่มอัตราชำระสินเชื่อเหล่านี้ (โดยเฉพาะสินเชื่อเพื่อที่อยู่อาศัย) และการสิ้นสุดการผ่อนปรนการจัดชั้นสินเชื่อและการกันเงินสำรอง ณ สิ้นปี 2566 (2) NIM ของกลุ่มธนาคารอาจขยายตัวน้อยลงจาก +46 bps ในปี 2566 สู่ +7 bps ในปี 2567 จากโอกาสในการคงอัตราดอกเบี้ย หรือลดอัตราดอกเบี้ยในปี 2567 (3) การเติบโตของสินเชื่อจะเพิ่มขึ้นจาก 1% ในปี 2566 สู่ 3% ในปี 2567 โดยได้รับแรงหนุนจากการฟื้นตัวของการส่งออกและการลงทุนภาคเอกชน รวมถึงการตัดหนี้สูญที่ลดลง ในขณะที่ (4) รายได้ที่ไม่ใช่ดอกเบี้ย คาดว่าจะอยู่ในระดับทรงตัวในปี 2567 ซึ่งเป็นผลมาจากกำไรจากเครื่องมือทางการเงินที่วัดมูลค่าด้วยวิธี FVTPL ที่ลดลง และรายได้ค่าธรรมเนียมที่ฟื้นตัวเล็กน้อย

สุดท้ายนี้ บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด ขอขอบพระคุณผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุนทุกท่านที่ได้มอบความไว้วางใจลงทุนในกองทุนรวมของ บลจ. ด้วยดีเสมอมา

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด



ธนาคารกรุงเทพ

## ความเห็นของผู้ดูแลผลประโยชน์

วันที่ 20 กุมภาพันธ์ 2567

เรียน ผู้ถือหน่วยลงทุนกองทุนเปิดไทยพาณิชย์ SET BANKING SECTOR INDEX

ธนาคารกรุงเทพ จำกัด (มหาชน) ในฐานะผู้ดูแลผลประโยชน์ ได้ดูแลการจัดการกองทุนเปิดไทยพาณิชย์ SET BANKING SECTOR INDEX ซึ่งจัดการโดยบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนไทยพาณิชย์ จำกัด สำหรับระยะเวลาตั้งแต่วันที่ 1 สิงหาคม 2566 ถึงวันที่ 31 มกราคม 2567 แล้ว

ธนาคารฯ เห็นว่าบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด ได้ปฏิบัติตามหน้าที่ในการจัดการกองทุนเปิดไทยพาณิชย์ SET BANKING SECTOR INDEX เหมาะสมตามสมควรแห่งวัตถุประสงค์ที่ได้กำหนดไว้ในโครงการ และภายใต้พระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535

(นาถฤดี สีโทขวลิต)

ธนาคารกรุงเทพ จำกัด (มหาชน)

ในฐานะผู้ดูแลผลประโยชน์

ผลการดำเนินงาน  
ข้อมูล ณ วันที่ 31 มกราคม 2567

| ผลตอบแทนจากการลงทุน         | YTD    | 3 เดือน | 6 เดือน | 1 ปี   | 3 ปี   | 5 ปี   | 10 ปี  | ตั้งแต่จัดตั้ง |
|-----------------------------|--------|---------|---------|--------|--------|--------|--------|----------------|
| SCBBANKING                  | -5.94% | -4.51%  | -9.96%  | -3.94% | 7.35%  | -2.58% | 0.86%  | 2.46%          |
| เกณฑ์มาตรฐาน                | -5.90% | -4.36%  | -9.71%  | -3.33% | 5.01%  | -3.64% | 0.88%  | 2.94%          |
| ความผันผวนของผลการดำเนินงาน | 3.63%  | 5.42%   | 8.51%   | 13.38% | 17.22% | 23.48% | 20.24% | 21.54%         |
| ความผันผวนของเกณฑ์มาตรฐาน   | 3.65%  | 5.44%   | 8.56%   | 13.48% | 17.69% | 23.83% | 20.49% | 21.77%         |

เกณฑ์มาตรฐาน : ดัชนีผลตอบแทนรวมธุรกิจธนาคาร (BANK TRI) ของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย ในอัตราส่วนร้อยละ 100

| ผลตอบแทนจากการลงทุน         | YTD    | 3 เดือน | 6 เดือน | 1 ปี   | 3 ปี   | 5 ปี   | 10 ปี | ตั้งแต่จัดตั้ง |
|-----------------------------|--------|---------|---------|--------|--------|--------|-------|----------------|
| SCBBANKINGA                 | -5.94% | -4.51%  | -9.94%  | -3.93% | 7.39%  | -2.55% | n.a.  | -2.29%         |
| เกณฑ์มาตรฐาน                | -5.90% | -4.36%  | -9.71%  | -3.33% | 5.01%  | -3.64% | n.a.  | -3.13%         |
| ความผันผวนของผลการดำเนินงาน | 3.63%  | 5.42%   | 8.51%   | 13.38% | 17.22% | 23.48% | n.a.  | 22.46%         |
| ความผันผวนของเกณฑ์มาตรฐาน   | 3.65%  | 5.44%   | 8.56%   | 13.48% | 17.69% | 23.83% | n.a.  | 22.78%         |

เกณฑ์มาตรฐาน : ดัชนีผลตอบแทนรวมธุรกิจธนาคาร (BANK TRI) ของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย ในอัตราส่วนร้อยละ 100

| ผลตอบแทนจากการลงทุน         | YTD    | 3 เดือน | 6 เดือน | 1 ปี   | 3 ปี   | 5 ปี | 10 ปี | ตั้งแต่จัดตั้ง |
|-----------------------------|--------|---------|---------|--------|--------|------|-------|----------------|
| SCBBANKINGE                 | -5.88% | -4.35%  | -9.64%  | -3.30% | 8.10%  | n.a. | n.a.  | -1.97%         |
| เกณฑ์มาตรฐาน                | -5.90% | -4.36%  | -9.71%  | -3.33% | 5.01%  | n.a. | n.a.  | -3.68%         |
| ความผันผวนของผลการดำเนินงาน | 3.63%  | 5.42%   | 8.51%   | 13.38% | 17.22% | n.a. | n.a.  | 24.24%         |
| ความผันผวนของเกณฑ์มาตรฐาน   | 3.65%  | 5.44%   | 8.56%   | 13.48% | 17.69% | n.a. | n.a.  | 24.60%         |

เกณฑ์มาตรฐาน : ดัชนีผลตอบแทนรวมธุรกิจธนาคาร (BANK TRI) ของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย ในอัตราส่วนร้อยละ 100

| ผลตอบแทนจากการลงทุน         | YTD    | 3 เดือน | 6 เดือน | 1 ปี   | 3 ปี   | 5 ปี   | 10 ปี | ตั้งแต่จัดตั้ง |
|-----------------------------|--------|---------|---------|--------|--------|--------|-------|----------------|
| SCBBANKINGP                 | -5.87% | -4.45%  | -10.78% | -5.36% | -0.47% | -6.85% | n.a.  | -4.27%         |
| เกณฑ์มาตรฐาน                | -5.90% | -4.36%  | -9.71%  | -3.33% | 5.01%  | -3.64% | n.a.  | -1.60%         |
| ความผันผวนของผลการดำเนินงาน | 3.61%  | 5.37%   | 8.34%   | 13.32% | 19.93% | 24.72% | n.a.  | 22.66%         |
| ความผันผวนของเกณฑ์มาตรฐาน   | 3.65%  | 5.44%   | 8.56%   | 13.48% | 17.69% | 23.83% | n.a.  | 21.92%         |

เกณฑ์มาตรฐาน : ดัชนีผลตอบแทนรวมธุรกิจธนาคาร (BANK TRI) ของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย ในอัตราส่วนร้อยละ 100

หมายเหตุ : เอกสารการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวมฉบับนี้ได้จัดทำขึ้นตามมาตรฐานการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวมของสมาคมบริษัทจัดการลงทุน

**บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด**  
**กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ SET BANKING SECTOR INDEX**  
**รายละเอียดหลักทรัพย์ และสัดส่วนการลงทุน**  
**ณ วันที่ 31 มกราคม 2567**

| ชื่อหลักทรัพย์                      | ราคา ณ<br>31 ม.ค. 2567<br>(บาท) | จำนวนหุ้น<br>(หุ้น) | มูลค่า<br>ตามราคาตลาด<br>(บาท) | ร้อยละของมูลค่า<br>ทรัพย์สินสุทธิ<br>(%) | ค่าประกัน/รับรอง/รับอาวัล<br>หรือสลักหลังโอน<br>แบบมีสิทธิไล่เบี้ย |
|-------------------------------------|---------------------------------|---------------------|--------------------------------|------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------|
| <b>หลักทรัพย์จดทะเบียน</b>          |                                 |                     | <b>1,120,483,921.30</b>        | <b>99.51%</b>                            |                                                                    |
| <b>หุ้นสามัญ</b>                    |                                 |                     | <b>1,120,483,921.30</b>        | <b>99.51%</b>                            |                                                                    |
| <b>ธนาคาร</b>                       |                                 |                     | <b>1,120,483,921.30</b>        | <b>99.51%</b>                            |                                                                    |
| บมจ.เอสซีบี เอกซ์(SCB)              | 104.00                          | 2,203,400.00        | 229,153,600.00                 | 20.35%                                   |                                                                    |
| บมจ.ธนาคารกรุงไทย(KBANK)            | 120.00                          | 1,550,400.00        | 186,048,000.00                 | 16.52%                                   |                                                                    |
| บมจ.ธนาคารกรุงเทพ(BBL)              | 141.00                          | 1,249,100.00        | 176,123,100.00                 | 15.64%                                   |                                                                    |
| บมจ.ธนาคารกรุงไทย(KTB)              | 15.90                           | 9,145,775.00        | 145,417,822.50                 | 12.91%                                   |                                                                    |
| บมจ.ธนาคารกรุงศรีอยุธยา(BAY)        | 26.75                           | 4,813,500.00        | 128,761,125.00                 | 11.43%                                   |                                                                    |
| บมจ.ธนาคารทหารไทยธนชาต(TTB)         | 1.79                            | 63,543,300.00       | 113,742,507.00                 | 10.10%                                   |                                                                    |
| บมจ.ทีเอสไฟแนนซ์เฮลท์กรุป(TISCO)    | 99.00                           | 523,900.00          | 51,866,100.00                  | 4.61%                                    |                                                                    |
| บมจ.ทุนธนชาต(TCAP)                  | 50.75                           | 686,200.00          | 34,824,650.00                  | 3.09%                                    |                                                                    |
| บมจ.ธนาคารเกียรตินาคินภัทร(KKP)     | 48.75                           | 554,100.00          | 27,012,375.00                  | 2.40%                                    |                                                                    |
| บมจ.แอล เอช ไฟแนนซ์เฮลท์ กรุป(LHFG) | 1.00                            | 13,862,317.00       | 13,862,317.00                  | 1.23%                                    |                                                                    |
| บมจ.ธนาคาร ซีไอเอ็มบี ไทย(CIMBT)    | 0.60                            | 22,787,208.00       | 13,672,324.80                  | 1.21%                                    |                                                                    |
| <b>เงินฝากธนาคาร</b>                |                                 |                     | <b>3,854,148.47</b>            | <b>0.34%</b>                             |                                                                    |
| บมจ.ธนาคารกรุงเทพ(BBL)              | 0.00                            | 0.00                | 3,854,148.47                   | 0.34%                                    |                                                                    |
| <b>สินทรัพย์อื่น</b>                |                                 |                     | <b>2,645,534.11</b>            | <b>0.23%</b>                             |                                                                    |
| <b>หนี้สินอื่น</b>                  |                                 |                     | <b>(947,917.93)</b>            | <b>(0.08%)</b>                           |                                                                    |
| <b>มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ</b>         |                                 |                     | <b>1,126,035,685.95</b>        | <b>100.00%</b>                           |                                                                    |
| <b>มูลค่าหน่วยลงทุน (บาท)</b>       | <b>8.0617</b>                   |                     |                                |                                          |                                                                    |

**บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด**  
**กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ SET BANKING SECTOR INDEX**  
**รายงานสรุปเงินลงทุน**  
**ณ วันที่ 31 มกราคม 2567**

| กลุ่มของตราสาร                                                                                                                                                                                                               | มูลค่าตามราคาตลาด | %NAV |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------|------|
| (ก) ตราสารภาครัฐ ได้แก่ คิวแลงเงิน พันธบัตรรัฐบาล พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย พันธบัตร หรือตราสารแห่งหนึ่งที่กองทุนเพื่อการฟื้นฟูและพัฒนาสถาบันการเงิน หรือกระทรวงการคลัง เป็นผู้ออก ผู้รับรอง ผู้รับอ่าวัด หรือผู้ค้ำประกัน | -                 | -    |
| (ข) ตราสารที่ธนาคารที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้น ธนาคารพาณิชย์ หรือบริษัทเงินทุนเป็นผู้ออก ผู้รับรอง ผู้รับอ่าวัด ผู้สละหลัก หรือผู้ค้ำประกัน                                                                                  | 3,854,148.47      | 0.34 |
| (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 SET BANKING SECTOR INDEX  
 รายละเอียดตัวตราสารและอันดับความน่าเชื่อถือของตราสารทุกตัวใน Port  
 ณ วันที่ 31 มกราคม 2567

| ประเภท        | ผู้ออก            | ผู้ค้ำ/ผู้รับรอง/ผู้หลักหลัง | วันครบกำหนด | อันดับความน่าเชื่อถือของผู้ออกตราสาร |              | มูลค่าหน้าตัว | มูลค่าตามราคาตลาด |
|---------------|-------------------|------------------------------|-------------|--------------------------------------|--------------|---------------|-------------------|
|               |                   |                              |             | TRIS Rating                          | FITCH Rating |               |                   |
| เงินฝากธนาคาร | บมจ.ธนาคารกรุงเทพ |                              |             |                                      | AA+(tha)     | -             | 3,854,148.47      |

กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ SET BANKING SECTOR INDEX

SCB SET BANKING SECTOR INDEX FUND

แบบค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม

FUND'S DIRECT EXPENSES REPORT

ตั้งแต่วันที่ 01 สิงหาคม 2566 ถึงวันที่ 31 มกราคม 2567

Period from 01 August 2023 to 31 January 2024

| ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม *        | จำนวนเงิน<br>หน่วย : พันบาท | ร้อยละต่อปีของ<br>มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ |
|---------------------------------------------|-----------------------------|----------------------------------------|
| Fund's direct expenses                      |                             |                                        |
| ค่าธรรมเนียมบริหารกองทุน (Management fee)   |                             |                                        |
| - ชนิดผู้ลงทุนกลุ่ม/บุคคล (SCBBANKINGP)     | -                           | -                                      |
| - ชนิดช่องทางอิเล็กทรอนิกส์ (SCBBANKINGE)   | -                           | -                                      |
| - ชนิดสะสมมูลค่า (SCBBANKINGA)              | 353                         | 0.65                                   |
| - ชนิดจ่ายเงินปันผล (SCBBANKING)            | 3,572                       | 0.65                                   |
| ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ (Trustee fee) | 162                         | 0.03                                   |
| ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน (Registrar fee)      | 412                         | 0.07                                   |
| ค่าที่ปรึกษาการลงทุน (Advisory fee)         | -                           | -                                      |
| ค่าใช้จ่ายอื่น ๆ (Other expenses)           | 45                          | 0.01                                   |
| รวมค่าใช้จ่ายทั้งหมด (Total Expense) **     | 4,544                       | 0.76                                   |

\* 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 SET BANKING SECTOR INDEX

งบแสดงฐานะการเงิน

ณ วันที่ 31 มกราคม 2567

(ยังไม่ได้ตรวจสอบ ยังไม่ได้สอบทาน)

|                                                                          | บาท              |                         |
|--------------------------------------------------------------------------|------------------|-------------------------|
|                                                                          | 2567             |                         |
| <hr/>                                                                    |                  |                         |
| สินทรัพย์                                                                |                  |                         |
| เงินลงทุนแสดงด้วยมูลค่ายุติธรรม                                          | 1,120,483,921.30 |                         |
| เงินฝากธนาคาร                                                            | 3,850,143.87     |                         |
| เงินประกันตามสัญญาซื้อขายตราสารอนุพันธ์                                  | 384,473.70       |                         |
| ลูกหนี้                                                                  |                  |                         |
| จากเงินปันผลและดอกเบี้ย                                                  | 4,037.15         |                         |
| จากการขายเงินลงทุน                                                       | 2,261,027.86     |                         |
| รวมสินทรัพย์                                                             | 1,126,983,603.88 |                         |
| <hr/>                                                                    |                  |                         |
| หนี้สิน                                                                  |                  |                         |
| เจ้าหนี้                                                                 |                  |                         |
| จากการรับซื้อคืนหน่วยลงทุน                                               | 152,899.10       |                         |
| ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย                                                       | 773,540.62       |                         |
| ภาษีเงินได้ค้างจ่าย                                                      | 605.57           |                         |
| หนี้สินอื่น                                                              | 20,872.64        |                         |
| รวมหนี้สิน                                                               | 947,917.93       |                         |
| <hr/>                                                                    |                  |                         |
| สินทรัพย์สุทธิ                                                           | 1,126,035,685.95 |                         |
| <hr/>                                                                    |                  |                         |
| สินทรัพย์สุทธิ:                                                          |                  |                         |
| ทุนที่ได้รับจากผู้ถือหน่วยลงทุน                                          | 1,396,772,077.44 |                         |
| กำไร(ขาดทุน)สะสม                                                         |                  |                         |
| บัญชีปรับสมดุล                                                           | 642,455,075.50   |                         |
| กำไร(ขาดทุน)สะสมจากการดำเนินงาน                                          | (913,191,466.99) |                         |
| สินทรัพย์สุทธิ                                                           | 1,126,035,685.95 |                         |
| <hr/>                                                                    |                  |                         |
| สินทรัพย์สุทธิต่อหน่วย                                                   | 8.0617           |                         |
| จำนวนหน่วยลงทุนที่จำหน่ายแล้วทั้งหมด ณ วันสิ้นสุด (หน่วย)                | 139,677,207.7447 |                         |
| <hr/>                                                                    |                  |                         |
| สินทรัพย์สุทธิต่อหน่วยลงทุนที่คำนวณแยกตามประเภทผู้ถือหน่วยลงทุน มีดังนี้ |                  |                         |
| ชนิดหรือประเภทผู้ถือหน่วยลงทุน                                           | ต่อหน่วย (บาท)   | จำนวนหน่วยลงทุน (หน่วย) |
| ชนิดผู้ลงทุนกลุ่ม/บุคคล                                                  | 8.0617           | 0.0000                  |
| ชนิดช่องทางอิเล็กทรอนิกส์                                                | 10.5099          | 1,022,151.1113          |
| ชนิดสะสมมูลค่า                                                           | 10.2687          | 10,150,427.7170         |
| ชนิดจ่ายเงินปันผล                                                        | 7.8678           | 128,504,628.9164        |
| <hr/>                                                                    |                  |                         |
| รวม                                                                      |                  | 139,677,207.7447        |

กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ SET BANKING SECTOR INDEX

งบกำไรขาดทุนเบ็ดเสร็จ

สำหรับรอบระยะเวลาตั้งแต่วันที่ 1 สิงหาคม 2566 ถึงวันที่ 31 มกราคม 2567

(ยังไม่ได้ตรวจสอบ ยังไม่ได้สอบทาน)

|                                                                              | บาท                     |
|------------------------------------------------------------------------------|-------------------------|
|                                                                              | 2567                    |
| <b>รายได้</b>                                                                |                         |
| รายได้เงินปันผล                                                              | 16,185,470.00           |
| รายได้ดอกเบี้ย                                                               | 20,533.15               |
| รายได้ค่าธรรมเนียมในการซื้อขายหน่วยลงทุน                                     | 232,247.12              |
| <b>รวมรายได้</b>                                                             | <b>16,438,250.27</b>    |
| <b>ค่าใช้จ่าย</b>                                                            |                         |
| ค่าธรรมเนียมการจัดการ                                                        | 3,925,089.94            |
| ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์                                                | 161,866.99              |
| ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน                                                       | 411,993.42              |
| ค่าธรรมเนียมวิชาชีพ                                                          | 37,705.28               |
| ค่าใช้จ่ายอื่น                                                               | 62,396.11               |
| <b>รวมค่าใช้จ่าย</b>                                                         | <b>4,599,051.74</b>     |
| <b>รายได้(ขาดทุน)สุทธิ</b>                                                   | <b>11,839,198.53</b>    |
| <b>รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิจากเงินลงทุน</b>                                   |                         |
| รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิที่เกิดขึ้นจากเงินลงทุน                               | 1,386,880.18            |
| รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิที่ยังไม่เกิดขึ้นจากเงินลงทุน                         | (138,580,147.41)        |
| <b>รวมรายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิจากเงินลงทุนที่เกิดขึ้นและที่ยังไม่เกิดขึ้น</b> | <b>(137,193,267.23)</b> |
| <b>การเพิ่มขึ้น(ลดลง)ในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงานก่อนภาษีเงินได้</b>      | <b>(125,354,068.70)</b> |
| หัก ภาษีเงินได้                                                              | 3,079.97                |
| <b>การเพิ่มขึ้น(ลดลง)ในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงานหลังหักภาษีเงินได้</b>   | <b>(125,357,148.67)</b> |

การเพิ่มขึ้น(ลดลง)ในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงานแยกตามประเภทผู้ถือหน่วยลงทุน มีดังนี้

| ชนิดหรือประเภทผู้ถือหน่วยลงทุน | ต่อหน่วย (บาท) | จำนวนเงิน               |
|--------------------------------|----------------|-------------------------|
| ชนิดผู้ลงทุนกลุ่ม/บุคคล        | 0.0000         | 0.00                    |
| ชนิดช่องทางอิเล็กทรอนิกส์      | (1.0946)       | (1,118,849.33)          |
| ชนิดสะสมมูลค่า                 | (1.1304)       | (11,474,714.50)         |
| ชนิดจ่ายเงินปันผล              | (0.8775)       | (112,763,584.84)        |
| <b>รวม</b>                     |                | <b>(125,357,148.67)</b> |

## รายงานการซื้อขายหลักทรัพย์และค่าใช้จ่ายต่าง ๆ

### VOLUME TRADE AND EXPENSES REPORT

ตั้งแต่วันที่ 1 สิงหาคม 2566 ถึง วันที่ 31 มกราคม 2567

Period from 1 August 2023 to 31 January 2024

|                                                                                                                                                    | (พันบาท) / (Thousand Baht) |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------|
| มูลค่าทรัพย์สินสุทธิเฉลี่ย / Average Net Assets Value                                                                                              | 1,200,843                  |
| การซื้อขายหลักทรัพย์รวม / Volume Trade                                                                                                             |                            |
| มูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์รวม                                                                                                                      | 163,123                    |
| Total Volume Trade                                                                                                                                 |                            |
| ค่าธรรมเนียมรายหน้าในการซื้อขายหลักทรัพย์รวม                                                                                                       | 55                         |
| Total Brokerage Fee                                                                                                                                |                            |
| ค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายอื่น ๆ รวม / Fee and other Expenses                                                                                       | 4,544                      |
|                                                                                                                                                    | (ร้อยละ) / (Percentage)    |
| <ul style="list-style-type: none"> <li>สัดส่วนค่าธรรมเนียมรายหน้าในการซื้อขายหลักทรัพย์รวมคิดเป็นร้อยละของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์รวม</li> </ul> | 0.03                       |
| Brokerage Fee as<br>Percentage of Total Trading Volume                                                                                             |                            |
| <ul style="list-style-type: none"> <li>สัดส่วนค่าธรรมเนียมรายหน้าในการซื้อขายหลักทรัพย์รวมคิดเป็นร้อยละของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิเฉลี่ย</li> </ul>    | 0.01                       |
| Brokerage Fee as<br>Percentage of Average Net Assets Value                                                                                         |                            |
| <ul style="list-style-type: none"> <li>สัดส่วนค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายอื่น ๆ รวมคิดเป็นร้อยละของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิเฉลี่ย</li> </ul>             | 0.76                       |
| Fee and other Expenses as<br>Percentage of Average Net Assets Value                                                                                |                            |
| <ul style="list-style-type: none"> <li>อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุนของกองทุนรวม (PTR)</li> </ul>                                                     | 0.05                       |
| Portfolio Turnover Ratio (PTR)                                                                                                                     |                            |

**รายงานรายชื่อบริษัทย่อย และค่าธรรมเนียม ซื้อ-ขาย หลักทรัพย์**  
**ของกองทุนเปิดไทยพาณิชย์ SET BANKING SECTOR INDEX**  
**ระหว่างวันที่ 1 สิงหาคม 2566 ถึงวันที่ 31 มกราคม 2567**

| ลำดับที่ | ชื่อบริษัทย่อย                                       | ค่านายหน้า<br>(พันบาท) | อัตราส่วนค่านายหน้าแต่ละราย<br>ต่อค่านายหน้าทั้งหมด |
|----------|------------------------------------------------------|------------------------|-----------------------------------------------------|
| 1        | INNOVESTX SECURITIES CO.,LTD.                        | 26.08                  | 47.56%                                              |
| 2        | บริษัทหลักทรัพย์ เมย์แบงก์ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) | 11.51                  | 20.98%                                              |
| 3        | KRUNGTHAI XSPRING SECURITIES CO.,LTD.                | 10.43                  | 19.02%                                              |
| 4        | บริษัทหลักทรัพย์ เคจีไอ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)    | 6.82                   | 12.44%                                              |
| รวม      |                                                      | 54.83                  | 100.00%                                             |

หมายเหตุ : บริษัทหลักทรัพย์ ไทยพาณิชย์ จำกัด ประกาศเปลี่ยนชื่อบริษัทเป็น “บริษัทหลักทรัพย์ อินโนเวสต์ เอกซ์ จำกัด” มีผลตั้งแต่วันที่ 12 กันยายน 2565

การรับผลประโยชน์ตอบแทนเนื่องจากการที่กองทุนใช้บริการบุคคลอื่น ประจำเดือน มกราคม 2567

BENEFIT FROM BROKERAGE SERVICES AS OF JANUARY 2024

| บริษัทที่ให้ผลประโยชน์                                      | BROKERAGE HOUSES                                         | ผลประโยชน์ที่ได้รับ*     |                            |                             |                     |                                    |                                |
|-------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------|--------------------------|----------------------------|-----------------------------|---------------------|------------------------------------|--------------------------------|
|                                                             |                                                          | บทวิเคราะห์ <sup>1</sup> | ข้อมูลพื้นฐาน <sup>2</sup> | รายงานสรุปข่าว <sup>3</sup> | สัมมนา <sup>4</sup> | บรรยายกลยุทธ์การลงทุน <sup>5</sup> | จัดเยี่ยมชมบริษัท <sup>6</sup> |
|                                                             |                                                          | Research Paper           | Fundamental Data           | News Summary                | Seminar             | Strategy Presentation              | Company Visit                  |
| บริษัทหลักทรัพย์ เอเชีย พลัส จำกัด                          | ASIA PLUS SECURITIES COMPANY LIMITED                     | ✓                        | ✓                          | ✓                           |                     | ✓                                  |                                |
| บริษัทหลักทรัพย์ บัวหลวง จำกัด (มหาชน)                      | BUALUANG SECURITIES PUBLIC COMPANY LIMITED               | ✓                        | ✓                          | ✓                           |                     | ✓                                  | ✓                              |
| บริษัทหลักทรัพย์ ซี แอล เอส เอ (ประเทศไทย) จำกัด            | CLSA SECURITIES (THAILAND) LIMITED                       | ✓                        | ✓                          | ✓                           |                     | ✓                                  |                                |
| บริษัทหลักทรัพย์ กรุงศรี พัฒนสิน จำกัด (มหาชน)              | KRUNGSRI CAPITAL SECURITIES PUBLIC COMPANY LIMITED       | ✓                        | ✓                          | ✓                           |                     | ✓                                  | ✓                              |
| บริษัทหลักทรัพย์เครดิต สวิส (ประเทศไทย) จำกัด               | CREDIT SUISSE SECURITIES (THAILAND) LIMITED              | ✓                        | ✓                          | ✓                           |                     | ✓                                  |                                |
| บริษัทหลักทรัพย์ เมย์แบงก์ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)        | MAYBANK SECURITIES (THAILAND) PUBLIC COMPANY LIMITED     | ✓                        | ✓                          | ✓                           |                     | ✓                                  | ✓                              |
| บริษัทหลักทรัพย์ กสิกรไทย จำกัด (มหาชน)                     | KASIKORN SECURITIES PUBLIC COMPANY LIMITED               | ✓                        | ✓                          | ✓                           | ✓                   | ✓                                  |                                |
| บริษัทหลักทรัพย์ กรุงศรี จำกัด (มหาชน)                      | KRUNGSRI SECURITIES PUBLIC COMPANY LIMITED               | ✓                        | ✓                          | ✓                           |                     | ✓                                  |                                |
| บริษัทหลักทรัพย์ เคทีเอ็นเคทีเอ็น จำกัด (มหาชน)             | KIATNAKIN PHATRA SECURITIES PUBLIC COMPANY LIMITED       | ✓                        | ✓                          | ✓                           |                     | ✓                                  |                                |
| บริษัทหลักทรัพย์ อินโนเวสตซ์ เอกซ์ จำกัด                    | INNOVESTX SECURITIES COMPANY LIMITED                     | ✓                        | ✓                          | ✓                           |                     | ✓                                  |                                |
| บริษัทหลักทรัพย์ธนชาต จำกัด (มหาชน)                         | THANACHART SECURITIES PUBLIC COMPANY LIMITED             | ✓                        | ✓                          | ✓                           |                     | ✓                                  |                                |
| บริษัทหลักทรัพย์ ทีเอส โก้ จำกัด                            | TISCO SECURITIES COMPANY LIMITED                         | ✓                        | ✓                          | ✓                           |                     | ✓                                  |                                |
| บริษัทหลักทรัพย์ ซีจีเอส-ซีบีเอ็มบี (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 วีเคเคเอส (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 ดาโอ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)             | DAOL SECURITIES (THAILAND) PUBLIC COMPANY LIMITED        | ✓                        | ✓                          | ✓                           |                     | ✓                                  |                                |
| บริษัทหลักทรัพย์ ยูโอบี เคย์ฮิยัน (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) | UOB KAYHIAN SECURITIES (THAILAND) PUBLIC COMPANY LIMITED | ✓                        | ✓                          | ✓                           | ✓                   | ✓                                  | ✓                              |
| บริษัทหลักทรัพย์ กรุงไทย เอ็กซ์ปรีมิ่ง จำกัด                | KRUNGTHAI XSPRING SECURITIES COMPANY LIMITED             | ✓                        | ✓                          | ✓                           |                     | ✓                                  |                                |
| บริษัท หลักทรัพย์ซีทีคอร์ป (ประเทศไทย) จำกัด                | CITICORP SECURITIES (THAILAND) LIMITED                   | ✓                        | ✓                          | ✓                           |                     | ✓                                  |                                |
| บริษัทหลักทรัพย์ เจพีมอร์แกน (ประเทศไทย) จำกัด              | JPMORGAN SECURITIES (THAILAND) LIMITED                   | ✓                        | ✓                          | ✓                           |                     | ✓                                  | ✓                              |
| บริษัทหลักทรัพย์ หยวนต้า (ประเทศไทย) จำกัด                  | YUANTA SECURITIES (THAILAND) COMPANY 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 บมข. 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](http://www.scbam.com)



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

SCBAM Call Center 0 2777 7777 หรือ [WWW.SCBAM.COM](http://WWW.SCBAM.COM)