

ร าย ง าน ป ระ จ ำ 6 เ ลื อ น 2 5 5 2

กองทุนเปิดไทยพาณิชย์
เซ็ก อินเวสต์ ฟันด์ (SCBSET)

สารจากบริษัทจัดการ

เรียน ท่านผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุน

ดัชนีตลาดหลักทรัพย์ในช่วงเดือนแรกของต้นปี ปรับตัวเพิ่มขึ้น จากแรงเข้าซื้อหุ้นของนักลงทุนทั่วโลก ที่มีความมั่นใจเพิ่มขึ้นจากตัวเศรษฐกิจต่างเริ่มส่งสัญญาณดีขึ้น หลังจากทั้งรัฐบาลและธนาคารกลางทุกประเทศช่วยกันผลักดันมาตรการต่างๆ ออกมาเพื่อพยุงเศรษฐกิจ และการให้ความช่วยเหลือกับอุตสาหกรรมต่าง ๆ ที่มีผลกระทบจากการตกต่ำของเศรษฐกิจทั่วโลก อย่างไรก็ตามในวันที่ 14 มกราคม ได้มีการปรับลดดอกเบี้ยลงอีกร้อยละ 0.75 ของ ธปท. มาอยู่ที่ร้อยละ 2.00 ต่อมาจากดัชนีตลาดหลักทรัพย์เคลื่อนไหวอยู่ในกรอบแคบๆ ด้วยปริมาณการซื้อขายที่เบาบางลง เนื่องจากไม่มีปัจจัยใหม่เข้ามากระตุ้นการลงทุน โดยส่วนใหญ่ยังกังวลกับภาวะกดดันจากปัญหาการถดถอยทางเศรษฐกิจโลก ที่เริ่มจากสหรัฐฯ และลุกลามไปยังทวีปยุโรป และมีผลกระทบมายังทวีปเอเชีย นักลงทุนยังชะลอการลงทุนในตลาดหลักทรัพย์ และเพิ่มการถือครองเงินสด และทองคำเพิ่มขึ้น เนื่องจากมีความกังวลกับตัวเลขเศรษฐกิจในประเทศต่างๆ ที่ออกมาไม่ดี ไม่ว่าจะเป็นตัวเลขการส่งออก ตัวเลขการขยายตัวของเศรษฐกิจ และตัวเลขการว่างงานที่มีแนวโน้มปรับตัวขึ้น จากความต้องการสินค้าที่ลดลงอย่างมาก ในวันที่ 23 กุมภาพันธ์ คณะกรรมการพัฒนาการเศรษฐกิจและสังคมแห่งชาติ (สภาพัฒน์) ประกาศตัวเลขการขยายตัวของเศรษฐกิจ ไตรมาสสุดท้ายของปี 2551 หดตัว ร้อยละ 4.3 เปรียบเทียบกับเวลาเดียวกันปีก่อนหน้าและหดตัวร้อยละ 6.1 เปรียบเทียบกับไตรมาสก่อนหน้า ทำให้การขยายตัวของเศรษฐกิจในปี 2551 ทั้งปี ขยายตัวเพียงร้อยละ 2.6 นับเป็นการชะลอตัวลงมากเมื่อเทียบกับการขยายตัวร้อยละ 4.9 ในปี 2550 และคาดว่าเศรษฐกิจในปี 2552 จะหดตัวครั้งแรกในรอบ 10 ปี และการตัดสินใจปรับลดอัตราดอกเบี้ยลงอีกร้อยละ 0.5 ของคณะกรรมการนโยบายการเงิน ธปท.ในวันที่ 25 กุมภาพันธ์ มาอยู่ที่ร้อยละ 1.50 ต่อมาดัชนีตลาดหลักทรัพย์เริ่มปรับตัวเพิ่มอีกครั้ง จากแรงซื้อกลับของนักลงทุนต่างประเทศ หลังจากดัชนีตลาดหลักทรัพย์สำคัญทั่วโลกปรับตัวเพิ่มขึ้นอย่างต่อเนื่อง เนื่องจากนักลงทุนคาดว่าเศรษฐกิจที่หดตัวและการปรับตัวลดลงของราคาน้ำมันอย่างรุนแรงได้ผ่านจุดต่ำสุดไปแล้ว โดยนักลงทุนมองว่ามาตรการกระตุ้นเศรษฐกิจของประเทศต่างๆ โดยเฉพาะของจีนและสหรัฐฯ จะทำให้การใช้จ่ายปรับตัวดีขึ้นได้ ทำให้ราคาสินค้าโภคภัณฑ์ต่างๆ ปรับตัวขึ้นได้ รวมทั้งราคาน้ำมันโลกและปิโตรเคมีซึ่งปรับตัวเพิ่มขึ้นตามความต้องการที่เพิ่มขึ้นจากการกระตุ้นเศรษฐกิจของจีน โดยราคาน้ำมันได้ปรับเพิ่มขึ้นจากระดับ 40 ดอลลาร์สหรัฐฯ ต่อบาร์เรล มาอยู่ที่ระดับ 70 ดอลลาร์สหรัฐฯ ต่อบาร์เรล ในช่วงเดือนมิถุนายน ทำให้หุ้นในกลุ่มพลังงานและสินค้าโภคภัณฑ์ ต่างๆ ปรับตัวเพิ่มขึ้น ส่งผลให้ดัชนีตลาดหลักทรัพย์ปรับตัวเพิ่มขึ้น นอกจากนี้จากการที่ผลตอบแทนในรูปอัตราดอกเบี้ยได้ปรับตัวลดลงมาอยู่ในระดับต่ำ ทำให้มีเงินไหลกลับเข้ามาในตลาดหุ้นเพิ่มมากขึ้น และการที่รัฐบาลได้ผ่านพระราชกำหนดให้อำนาจกระทรวงการคลังกู้เงินไม่เกิน 4 แสนล้านบาท ระบุสกุลเงินบาท เพื่อใช้ในการกระตุ้นเศรษฐกิจก็ยิ่งเพิ่มความมั่นใจให้กับนักลงทุนว่าเศรษฐกิจไทยมีแนวโน้มขยายตัวได้ดีขึ้นในอนาคต

ทั้งนี้ ในเดือนกรกฎาคมดัชนีตลาดหลักทรัพย์ปรับตัวลดลงตามแรงขายทำกำไร เนื่องจากราคาหลักทรัพย์ปรับตัวปรับขึ้นมามากตั้งแต่ต้นปี และนักลงทุนกังวลว่าอาจมีแรงขายในตลาดหุ้นทั่วโลกต่อเนื่องในช่วงฤดูร้อน ซึ่งมักเป็นช่วงที่ตลาดปรับตัวลดลงและปริมาณการซื้อขายลดลงทุกปี พร้อมกับแรงเทขายในตลาดน้ำมันและสินค้า

โภคภัณฑ์ต่างๆ อย่างไรก็ตาม หลังจากที่เริ่มมีการประกาศผลการดำเนินงานไตรมาส 2 ของสถาบันการเงินในสหรัฐฯ ซึ่งออกมาดีกว่าที่มีการคาดการณ์มาก พร้อมกับการประกาศตัวเลขการขยายตัวทางเศรษฐกิจ และความเชื่อมั่นอย่างต่อเนื่องของจีนและสหรัฐฯ ทำให้ตลาดหุ้นทั่วโลกปรับตัวขึ้นอีกครั้ง พร้อมกับการปรับตัวขึ้นของตลาดสินค้าโภคภัณฑ์และราคาน้ำมันปรับตัวขึ้นในช่วงสิ้นเดือนที่ระดับ 71.48 ดอลลาร์สหรัฐฯ ต่อบาร์เรล ซึ่งเป็นระดับที่สูงที่สุดตั้งแต่ต้นปี ทั้งนี้ดัชนีตลาดหลักทรัพย์ ณ สิ้นเดือนกรกฎาคม ปรับตัวเพิ่มขึ้น 190 จุด หรือประมาณร้อยละ 42 มาอยู่ที่ 624 จุด จากราคาปิด ณ สิ้นเดือนมกราคม ที่ 449.96 จุด

ท้ายสุด บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด ขอขอบคุณผู้ถือหุ้นทุกท่าน ที่ให้การส่งเสริมและสนับสนุนด้วยดีมาโดยตลอด

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด

รายงานผู้ดูแลผลประโยชน์

เสนอ ผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุนกองทุนเปิดไทยพาณิชย์ เซ็ท อินเด็กซ์ ฟันด์

ธนาคารซีทีแบงก์ เอ็ม.เอ. สาขากรุงเทพฯ ในฐานะผู้ดูแลผลประโยชน์กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ เซ็ท อินเด็กซ์ ฟันด์ อันมีบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด เป็นผู้จัดตั้งและจัดการกองทุน ได้ปฏิบัติหน้าที่ดูแลผลประโยชน์กองทุนรวมดังกล่าว สำหรับระยะเวลารอบปีบัญชีตั้งแต่วันที่ 1 กุมภาพันธ์ 2552 ถึงวันที่ 31 กรกฎาคม 2552 แล้วนั้น

ธนาคารฯ เห็นว่าบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด ได้ปฏิบัติหน้าที่ในการจัดการกองทุนเปิดไทยพาณิชย์ เซ็ท อินเด็กซ์ ฟันด์ โดยถูกต้องตามที่ควรตามวัตถุประสงค์ที่ได้กำหนดไว้ในโครงการจัดการที่ได้รับอนุมัติจากสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ และภายใต้พระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535

ธนาคารซีทีแบงก์ เอ็ม.เอ. สาขากรุงเทพฯ



ผู้ดูแลผลประโยชน์

Vunvipa Kusakul

Vice President

ผลการดำเนินงาน

	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี	3 ปี	ตั้งแต่จัดตั้ง
	30 เม.ย. 52 - 31 ก.ค. 52	30 ม.ค. 52 - 31 ก.ค. 52	31 ก.ค. 51 - 31 ก.ค. 52	31 ก.ค. 49 - 31 ก.ค. 52	20 ส.ค. 39 - 31 ก.ค. 52
กองทุนเปิดไทยพาณิชย์เซ็ท อินเด็กซ์ ฟันด์	27.35%	47.19%	(3.08%)	(0.85%)	(33.92%)
ดัชนีตลาดหลักทรัพย์ฯ	26.91%	42.57%	(7.74%)	(9.76%)	(41.76%)

การวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวมนี้นี้ จัดทำขึ้นตามมาตรฐานการวัดผลการดำเนินงาน ของสมาคมบริษัทจัดการลงทุน

การลงทุนมีความเสี่ยง ผู้ลงทุนควรศึกษาข้อมูลก่อนการตัดสินใจลงทุน

ผู้ลงทุนสามารถตรวจดูแนวทางในการใช้สิทธิออกเสียงและการดำเนินการใช้สิทธิออกเสียงได้ที่บริษัทจัดการ หรือ <http://www.scbam.com>

และสามารถตรวจสอบการทำธุรกรรมกับบุคคลที่เกี่ยวข้องกับกองทุนรวมได้ที่ บริษัทจัดการโดยตรงหรือที่ website ของบริษัทจัดการและสำนักงาน ก.ล.ต

รายละเอียดหลักทรัพย์ และสัดส่วนการลงทุน
ณ วันที่ 31 กรกฎาคม 2552

ชื่อหลักทรัพย์	ราคา ณ 31 มี.ค. 2552 (บาท)	จำนวนหุ้น (หุ้น)	มูลค่า ตามราคาตลาด (บาท)	ร้อยละของมูลค่า ทรัพย์สินสุทธิ (%)	ค่าประกัน/รับรอง/รับอาวัล หรือสลักหลังโอน แบบมีสิทธิไต่เบี่ย
หุ้นจดทะเบียน			1,781,984,996.91	95.54%	
ธุรกิจการเกษตร			15,837,150.00	0.85%	
บมจ.เจริญโภคภัณฑ์อาหาร (CPF)	5.25	3,016,600.00	15,837,150.00	0.85%	
ยานยนต์			7,581,100.00	0.41%	
บมจ.ไทยสแตนเลย์-การไฟฟ้า (STANLY)	88.75	64,400.00	5,715,500.00	0.31%	
บมจ.ไทยรุ่งยูเนี่ยนคาร์ (TRU)	1.60	1,166,000.00	1,865,600.00	0.10%	
ธนาคาร			359,162,676.38	19.26%	
บมจ.ธนาคารกรุงศรีอยุธยา (BAY)	18.10	2,394,800.00	43,345,880.00	2.32%	
บมจ.ธนาคารกรุงเทพ (BBL)	111.00	730,500.00	81,085,500.00	4.35%	
บมจ.ธนาคารกสิกรไทย (KBANK)	72.50	937,400.00	67,961,500.00	3.64%	
บมจ.ธนาคารเกียรตินาคิน (KK)	18.10	255,200.00	4,619,120.00	0.25%	
บมจ.ธนาคารกรุงไทย (KTB)	8.40	4,398,800.00	36,949,920.00	1.98%	
บมจ.ธนาคารไทยพาณิชย์ (SCB)	77.25	1,053,700.00	81,398,325.00	4.36%	
บมจ.ธนาคารนครหลวงไทย (SCIB)	18.00	892,000.00	16,056,000.00	0.86%	
บมจ.ทุนธนาชาติ (TCAP)	13.80	609,200.00	8,406,960.00	0.45%	
บมจ.ทิสโก้ไฟแนนเชียลกรุ๊ป (TISCO)	18.30	281,800.00	5,156,940.00	0.28%	
บมจ.ธนาคารทหารไทย (TMB)	0.81	17,509,298.00	14,182,531.38	0.76%	
พาณิชย์			73,737,683.40	3.95%	
บมจ.บีจี ซูเปอร์เซ็นเตอร์ (BIGC)	48.00	340,400.00	16,339,200.00	0.88%	
บมจ.เบอริลียูคเกอร์ (BJC)	4.52	930,400.00	4,205,408.00	0.23%	
บมจ.ซีพี ออลล์ จำกัด (CPALL)	16.70	1,715,400.00	28,647,180.00	1.54%	
บมจ.ล็อกซ์เลย์ (LOXLEY)	2.54	1,486,700.00	3,776,218.00	0.20%	
บมจ.สยามแม็คโคร (MAKRO)	71.75	118,400.00	8,495,200.00	0.46%	
บมจ.ไมด้า แอสเซ็ท (MIDA)	0.66	1,208,100.00	797,346.00	0.04%	
บมจ.ห้างสรรพสินค้าโรบินสัน (ROBINS)	9.50	615,000.00	5,842,500.00	0.31%	
บมจ.สหพัฒนพิบูล (SPC)	17.90	190,066.00	3,402,181.40	0.18%	
บมจ.สหพัฒน์อินเตอร์โฮลดิ้ง (SPI)	16.50	135,300.00	2,232,450.00	0.12%	
เทคโนโลยีสารสนเทศและการสื่อสาร			171,486,381.75	9.19%	
บมจ.แอดวานซ์ อินโฟร์ เซอร์วิส (ADVANC)	86.50	1,110,500.00	96,058,250.00	5.15%	
บริษัท โทเทิล แอ็คเซ็ส คอมมูนิเคชั่น จำกัด (มหาชน) (DTAC)	33.25	888,195.00	29,532,483.75	1.58%	
บมจ.จัสมินอินเตอร์เนชั่นแนล (JAS)	0.42	6,704,500.00	2,815,890.00	0.15%	
บมจ.สามารทดอร์ปอเรชั่น (SAMART)	6.20	715,000.00	4,433,000.00	0.24%	

รายละเอียดหลักทรัพย์ และสัดส่วนการลงทุน

ณ วันที่ 31 กรกฎาคม 2552

ชื่อหลักทรัพย์	ราคา ณ 31 มี.ค. 2552 (บาท)	จำนวนหุ้น (หุ้น)	มูลค่า ตามราคาตลาด (บาท)	ร้อยละของมูลค่า หลักทรัพย์สุทธิ (%)	ค่าประกัน/รับรอง/รับอาวัล หรือสลักหลังโอน แบบมีสิทธิไต่เบี่ย
บมจ.ชิน คอร์ปอเรชั่น (SHIN)	21.20	1,274,600.00	27,021,520.00	1.45%	
บมจ.ไทยคม (THCOM)	6.20	618,700.00	3,835,940.00	0.21%	
บมจ.ทรู คอร์ปอเรชั่น (TRUE)	2.22	2,957,900.00	6,566,538.00	0.35%	
บมจ.ทีทีแอลดี (TT&T)	0.55	2,223,200.00	1,222,760.00	0.07%	
วัสดุก่อสร้าง			124,045,275.10	6.65%	
บมจ.ไดนาสตีเซรามิค (DCC)	19.20	278,400.00	5,345,280.00	0.29%	
บมจ.ปูนซิเมนต์ไทย (SCC)	184.00	450,200.00	82,836,800.00	4.44%	
บมจ.ปูนซิเมนต์นครหลวง (SCCC)	183.00	101,900.00	18,647,700.00	1.00%	
บมจ.ทีปโก้แอสฟัลท์ (TASCO)	14.70	181,178.00	2,663,316.60	0.14%	
บมจ.ทีพีโอ โพลีน (TPIPL)	7.10	839,100.00	5,957,610.00	0.32%	
บมจ.ทาทา สตีล (ประเทศไทย) (TSTH)	1.75	3,437,570.00	6,015,747.50	0.32%	
บมจ.วนชัยกรุ๊ป (VNG)	1.59	1,621,900.00	2,578,821.00	0.14%	
ใบแสดงสิทธิในผลประโยชน์ของหลักทรัพย์อ้างอิง			3,032,256.00	0.16%	
บมจ.บางจากปิโตรเลียม (BCP-DR1)	13.60	222,960.00	3,032,256.00	0.16%	
ชิ้นส่วนอิเล็กทรอนิกส์			24,467,926.50	1.31%	
บมจ.แคล-คอมพ์ อิเล็กทรอนิกส์ (ประเทศไทย) (CCET)	2.96	1,701,300.00	5,035,848.00	0.27%	
บมจ.เดลต้า อิเล็กทรอนิกส์ (ประเทศไทย) (DELTA)	15.60	551,140.00	8,597,784.00	0.46%	
บมจ.ฮานา ไมโครอิเล็กทรอนิกส์ (HANA)	18.90	349,900.00	6,613,110.00	0.35%	
บมจ.เคซีอี อิเล็กทรอนิกส์ (KCE)	1.79	1,025,550.00	1,835,734.50	0.10%	
บมจ.มูราโมโต้ อิเล็กทรอนิกส์ (METCO)	139.50	17,100.00	2,385,450.00	0.13%	
พลังงานและสาธารณูปโภค			611,898,165.60	32.81%	
บมจ.บ้านปู (BANPU)	375.00	107,600.00	40,350,000.00	2.16%	
บมจ.บางจากปิโตรเลียม (BCP)	14.10	583,000.00	8,220,300.00	0.44%	
บริษัท ผลิตไฟฟ้า จำกัด (มหาชน) (EGCO)	74.00	240,000.00	17,760,000.00	0.95%	
บมจ.โกลว์ พลังงาน (GLOW)	29.75	628,800.00	18,706,800.00	1.00%	
บมจ.ไออาร์พีซี (IRPC)	3.42	7,856,700.00	26,869,914.00	1.44%	
บมจ.ปิคนิค คอร์ปอเรชั่น (PICNI)	0.21	9,502,000.00	1,995,420.00	0.11%	
บมจ.ปตท. (PTT)	239.00	1,052,700.00	251,595,300.00	13.49%	
บริษัท ปตท. อะโรมาติกส์และการกลั่น จำกัด (มหาชน) (PTTAR)	19.60	1,141,971.00	22,382,631.60	1.20%	
บมจ.ปตท.สำรวจและผลิตปิโตรเลียม (PTTEP)	138.00	1,240,200.00	171,147,600.00	9.18%	
บมจ.ผลิตไฟฟ้าราชบุรี โฮลดิ้ง (RATCH)	38.50	617,700.00	23,781,450.00	1.28%	
บมจ.ไทยออยล์ (TOP)	37.50	775,700.00	29,088,750.00	1.56%	

รายละเอียดหลักทรัพย์ และสัดส่วนการลงทุน

ณ วันที่ 31 กรกฎาคม 2552

ชื่อหลักทรัพย์	ราคา ณ 31 มี.ค. 2552 (บาท)	จำนวนหุ้น (หุ้น)	มูลค่า ตามราคาตลาด (บาท)	ร้อยละของมูลค่า ทรัพย์สินสุทธิ (%)	ค่าประกัน/รับรอง/รับอาวัล หรือสลักหลังโอน แบบมีสิทธิไต่เบี่ย
แฟชั่น			15,113,923.00	0.81%	
บมจ.เอเชียไฟเบอร์ (AFC)	2.12	261,900.00	555,228.00	0.03%	
บมจ.ไอ.ซี.ซี.อินเตอร์เนชั่นแนล (ICC)	40.50	110,000.00	4,455,000.00	0.24%	
บมจ.แพนเอเชียฟู้ดแวร์ (PAF)	0.93	2,868,500.00	2,667,705.00	0.14%	
บมจ.สหยูเนี่ยน (SUC)	14.20	267,700.00	3,801,340.00	0.20%	
บมจ.ไทยเรยอน (TR)	30.75	118,200.00	3,634,650.00	0.19%	
เงินทุนและหลักทรัพย์			14,392,706.36	0.77%	
บมจ.อีออน ธนสินทรัพย์ (ไทยแลนด์) (AEONTS)	31.00	139,400.00	4,321,400.00	0.23%	
บมจ.หลักทรัพย์เอเชีย พลัส (ASP)	1.80	1,134,800.00	2,042,640.00	0.11%	
บมจ.เงินทุนธนสยาม (DS)		19,800.00	0.00	0.00%	
บมจ.เงินทุนเอกธนกิจ (FIN1)		10,600.00	0.00	0.00%	
บมจ.หลักทรัพย์ กิมเอ็ง (ประเทศไทย) (KEST)	13.20	258,100.00	3,406,920.00	0.18%	
บมจ.หลักทรัพย์ เคจีไอ (ประเทศไทย) (KGI)	1.27	1,391,100.00	1,766,697.00	0.09%	
บมจ.เงินทุน สินอุตสาหกรรม (SICCO)	3.26	441,636.00	1,439,733.36	0.08%	
บมจ.เงินทุนหลักทรัพย์ซิทก้า (SITCA)		13,000.00	0.00	0.00%	
บมจ.ธูติกร (TK)	3.32	426,300.00	1,415,316.00	0.08%	
อาหารและเครื่องดื่ม			37,394,818.85	2.00%	
บมจ.น้ำตาลขอนแก่น (KSL)	10.60	724,300.00	7,677,580.00	0.41%	
บมจ.ไมเนอร์ อินเตอร์เนชั่นแนล (MINT)	8.45	1,354,033.00	11,441,578.85	0.61%	
บมจ.เสริมสุข (SSC)	12.30	254,900.00	3,135,270.00	0.17%	
บมจ.ไทยยูเนี่ยน โฟรเซ่น โปรดักส์ (TUF)	26.00	399,500.00	10,387,000.00	0.56%	
บมจ.น้ำมันพืชไทย (TVO)	14.80	321,175.00	4,753,390.00	0.25%	
การแพทย์			21,294,785.00	1.14%	
บมจ.กรุงเทพดุสิตเวชการ (BGH)	23.20	527,300.00	12,233,360.00	0.66%	
บมจ.โรงพยาบาลบำรุงราษฎร์ (BH)	25.75	351,900.00	9,061,425.00	0.49%	
ประกันภัยและประกันชีวิต			13,250,820.00	0.71%	
บมจ.กรุงเทพประกันภัย (BKI)	230.00	28,514.00	6,558,220.00	0.35%	
บมจ.ไทยพาณิชย์นิวยอร์กไลฟ์ประกันชีวิต (SCNYL)	218.00	30,700.00	6,692,600.00	0.36%	
วัสดุอุตสาหกรรมและเครื่องจักร			15,596,940.00	0.84%	
บมจ.จตุไทย ไวร์แอนด์เคเบิล (CTW)	3.00	489,500.00	1,468,500.00	0.08%	
บมจ.จี เจ สตีล (GJS)	0.18	12,505,900.00	2,251,062.00	0.12%	
บมจ.จี สตีล (GSTEEL)	0.41	4,803,400.00	1,969,394.00	0.11%	

รายละเอียดหลักทรัพย์ และสัดส่วนการลงทุน

ณ วันที่ 31 กรกฎาคม 2552

ชื่อหลักทรัพย์	ราคา ณ 31 มี.ค. 2552 (บาท)	จำนวนหุ้น (หุ้น)	มูลค่า ตามราคาตลาด (บาท)	ร้อยละของมูลค่า หลักทรัพย์สุทธิ (%)	ค่าประกัน/รับรอง/รับอาวัล หรือสลักหลังโอน แบบมีสิทธิไต่เบี่ย
บมจ.ไทยนิโอรซ์ สเตนเลส (INOX)	1.16	4,945,400.00	5,736,664.00	0.31%	
บมจ.สหวิริยาสติลอินดัสตรี (SSI)	0.90	4,634,800.00	4,171,320.00	0.22%	
สื่อและสิ่งพิมพ์			34,821,150.00	1.87%	
บมจ.บีอีซี เวิลด์ (BEC)	19.80	821,400.00	16,263,720.00	0.87%	
บมจ.จีเอ็มเอ็ม แกรมมี่ (GRAMMY)	13.70	358,500.00	4,911,450.00	0.26%	
บมจ.ไอทีวี (ITV)		585,200.00	0.00	0.00%	
บมจ.ไลฟ์ อินคอร์ปอเรชั่น (LIVE)	0.13	13,806,300.00	1,794,819.00	0.10%	
บมจ.เมเจอร์ ซินีเพล็กซ์ กรุ๊ป (MAJOR)	7.05	527,100.00	3,716,055.00	0.20%	
บมจ.อสมท (MCOT)	18.80	312,500.00	5,875,000.00	0.31%	
บมจ.มีเดีย ออฟ มีเดียส์ (MEDIAS)	5.30	201,300.00	1,066,890.00	0.06%	
บมจ.เนชั่น มัลติมีเดีย กรุ๊ป (NMG)	3.16	377,600.00	1,193,216.00	0.06%	
เหมืองแร่			5,468,400.00	0.29%	
บมจ.ผาแดงอินดัสตรี (PDI)	14.70	372,000.00	5,468,400.00	0.29%	
บรรจุภัณฑ์			1,134,992.00	0.06%	
บมจ.ไทยฟิล์มอินดัสตรี (TFI)	1.00	1,134,992.00	1,134,992.00	0.06%	
ปิโตรเคมีและเคมีภัณฑ์			52,112,290.00	2.79%	
บมจ.อินโดรามา โพลีเมอร์ส (IRP)	10.40	562,500.00	5,850,000.00	0.31%	
บมจ.ปตท. เคมีคอล (PTTCH)	60.00	544,900.00	32,694,000.00	1.75%	
บมจ.ไทยคาร์บอนแบล็ค (TCB)	14.00	193,300.00	2,706,200.00	0.15%	
บมจ.ไทยพลาสติกและเคมีภัณฑ์ (TPC)	18.60	371,300.00	6,906,180.00	0.37%	
บมจ.วินไทย (VNT)	6.20	638,050.00	3,955,910.00	0.21%	
พัฒนาอสังหาริมทรัพย์			110,687,087.32	5.93%	
บมจ.อมตะ คอร์ปอเรชั่น (AMATA)	5.05	777,300.00	3,925,365.00	0.21%	
บมจ.เอเชียนพร็อพเพอร์ตี้ ดีเวลลอปเม้นท์ (AP)	4.90	1,257,100.00	6,159,790.00	0.33%	
บมจ.ช.การช่าง (CK)	3.78	1,020,700.00	3,858,246.00	0.21%	
บมจ.เซ็นทรัลพัฒนา (CPN)	18.50	933,900.00	17,277,150.00	0.93%	
บมจ.แผ่นดินทอง พร็อพเพอร์ตี้ ดีเวลลอปเม้นท์ (GOLD)	2.52	826,175.00	2,081,961.00	0.11%	
บมจ.เหมราชพัฒนาที่ดิน (HEMRAJ)	0.61	7,232,600.00	4,411,886.00	0.24%	
บมจ.อิตาเลียนไทย ดีเวลลอปเม้นท์ (ITD)	2.70	2,391,600.00	6,457,320.00	0.35%	
บมจ.ลลิต พร็อพเพอร์ตี้ (LALIN)	1.43	1,390,800.00	1,988,844.00	0.11%	
บมจ.แลนด์แอนด์เฮาส์ (LH)	5.15	4,069,100.00	20,955,865.00	1.12%	
บมจ.เอ็ม บี เค (MBK)	57.50	136,000.00	7,820,000.00	0.42%	
บมจ.โนเบิล ดีเวลลอปเม้นท์ (NOBLE)	2.90	940,200.00	2,726,580.00	0.15%	

รายละเอียดหลักทรัพย์ และสัดส่วนการลงทุน

ณ วันที่ 31 กรกฎาคม 2552

ชื่อหลักทรัพย์	ราคา ณ 31 มี.ค. 2552 (บาท)	จำนวนหุ้น (หุ้น)	มูลค่า ตามราคาตลาด (บาท)	ร้อยละของมูลค่า ทรัพย์สินสุทธิ (%)	ค่าประกัน/รับรอง/รับอาวัล หรือสลักหลังโอน แบบมีสิทธิไต่เบี่ย
บมจ.แมกเนติก พาร์ค (N-PARK)	0.01	145,865,800.00	1,458,658.00	0.08%	
บมจ.พร็อพเพอร์ตี้ เพอร์เฟค (PF)	2.74	938,500.00	2,571,490.00	0.14%	
บมจ.พญาธร วิลล์เอสเตท (PS)	9.60	1,068,000.00	10,252,800.00	0.55%	
บมจ.ควอลิตี้เฮาส์ (QH)	1.66	4,282,200.00	7,108,452.00	0.38%	
บมจ.สวนอุตสาหกรรมโรจนะ (ROJNA)	6.05	685,100.00	4,144,855.00	0.22%	
บมจ.แสนสิริ (SIRI)	3.02	1,158,966.00	3,500,077.32	0.19%	
บมจ.ซีโน-ไทย เอ็นจิเนียริงแอนด์คอนสตรัคชั่น (STEC)	4.12	967,900.00	3,987,748.00	0.21%	
การท่องเที่ยวและสันทนาการ			18,888,580.00	1.01%	
บมจ.โรงแรมเซ็นทรัล พลาซา (CENTEL)	3.10	1,267,700.00	3,929,870.00	0.21%	
บมจ.ดิ เอราวัณ กรุ๊ป (ERAWAN)	1.79	2,119,000.00	3,793,010.00	0.20%	
บมจ.ลาгуน่า รีสอร์ท แอนด์ โฮเทล (LRH)	26.25	117,200.00	3,076,500.00	0.16%	
บมจ.โอเชียนเทล (OHTL)	504.00	16,050.00	8,089,200.00	0.43%	
ขนส่งและโลจิสติกส์			49,454,110.00	2.65%	
บมจ.ท่าอากาศยานไทย (AOT)	32.00	543,100.00	17,379,200.00	0.93%	
บมจ.ทางด่วนกรุงเทพ (BECL)	17.20	347,000.00	5,968,400.00	0.32%	
บมจ.รถไฟฟ้ากรุงเทพ (BMCL)	0.68	5,662,500.00	3,850,500.00	0.21%	
บมจ.พรีเมียมส์ ชิปปิ้ง (PSL)	16.20	355,900.00	5,765,580.00	0.31%	
บมจ.อาร์ ซี แอล (RCL)	9.70	258,300.00	2,505,510.00	0.13%	
บมจ.การบินไทย (THAI)	13.60	622,500.00	8,466,000.00	0.45%	
บมจ.ไทรเจนไทย เอเยนซีส์ (TTA)	22.60	244,200.00	5,518,920.00	0.30%	
ใบสำคัญแสดงสิทธิ			1,125,779.65	0.06%	
บมจ.ไลฟ์ อินคอร์ปอเรชั่น (LIVE-W1)	0.05	4,144,550.00	207,227.50	0.01%	
บมจ.สวนอุตสาหกรรมโรจนะ (ROJNA-W2/U)	2.05	239,833.00	491,657.65	0.03%	
บมจ.น้ำมันพืชไทย (TVO-W2)	5.90	72,355.00	426,894.50	0.02%	
รวมหลักทรัพย์ประเภทหุ้น			1,781,984,996.91	95.54%	
เงินฝากธนาคาร			81,973,075.71	4.39%	
ธนาคารซีทีแบงก์ (CITIBANK)			81,973,075.71	4.39%	
สินทรัพย์อื่น ๆ			36,014,963.68	1.93%	
หนี้สิน			-34,825,985.03	-1.87%	
มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ			1,865,147,051.27	100.00%	
มูลค่าหน่วยลงทุน (บาท)			6.6082		

แบบค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม
วันที่ 1 กุมภาพันธ์ 2552 ถึงวันที่ 31 กรกฎาคม 2552

ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม *	จำนวนเงิน หน่วย : พันบาท	ร้อยละต่อปีของ มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ
ค่าธรรมเนียมการจัดการ (Management fee)	6,337	0.80
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ (Trustee fee)	422	0.05
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน (Registrar fee)	1,267	0.16
ค่าที่ปรึกษาการลงทุน (Advisory fee)	-	-
ค่าสอบบัญชี (Auditing fee)	129	0.02
ค่าใช้จ่ายงานทะเบียนกองทุน (Registration Expense)	140	0.02
ค่าจัดทำรายงานประจำปีและสิ่งพิมพ์ (Annual report and Printing expense)	229	0.03
ค่าธรรมเนียมธนาคาร (Bank fee)	162	0.02
ค่าใช้จ่ายอื่น ๆ (Other expenses)	106	0.01
รวมค่าใช้จ่ายทั้งหมด (Total Expense) **	8,792	1.11

* ค่าใช้จ่ายดังกล่าวได้รวมภาษีมูลค่าเพิ่มแล้ว

** ไม่รวมค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ และค่าธรรมเนียมต่าง ๆ ที่เกิดขึ้นจากการซื้อขายหลักทรัพย์

งบดุล
ณ วันที่ 31 กรกฎาคม 2552

	ยังไม่ได้ตรวจสอบ ยังไม่ได้สอบทาน บาท
สินทรัพย์	
เงินลงทุนตามราคายุติธรรม	1,781,984,996.91
เงินสดและเงินฝากธนาคาร	81,973,075.71
ลูกหนี้จากเงินปันผลและดอกเบี้ย	5,373.77
ลูกหนี้จากการขายเงินลงทุน	35,911,677.56
ค่าใช้จ่ายรอตัดบัญชี	97,912.35
รวมสินทรัพย์	1,899,973,036.30
หนี้สิน	
เจ้าหนี้จากการรับซื้อคืนส่วนได้เสีย	33,012,408.57
เจ้าหนี้อื่น	2,020.00
ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย	1,753,095.21
หนี้สินอื่น	58,461.25
รวมหนี้สิน	34,825,985.03
สินทรัพย์สุทธิ	1,865,147,051.27
สินทรัพย์สุทธิ :-	
ทุนที่ได้รับจากผู้ถือหุ้นลงทุน	2,822,454,320.14
กำไร(ขาดทุน)สะสม	339,523,043.06
บัญชีปรับสมดุล	(1,296,830,311.93)
สินทรัพย์สุทธิ	1,865,147,051.27
จำนวนหน่วยลงทุนที่จำหน่ายแล้ว (หน่วย)	282,245,432.01
สินทรัพย์สุทธิต่อหน่วยลงทุน	6.6082

กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ เซ็ท อินเด็กซ์ ฟันด์ (SCBSET)

งบกำไรขาดทุน

วันที่ 1 กุมภาพันธ์ 2552 ถึงวันที่ 31 กรกฎาคม 2552

	ยังไม่ได้ตรวจสอบ ยังไม่ได้สอบทาน บาท
รายได้จากการลงทุน	
รายได้เงินปันผล	44,819,812.04
รายได้ดอกเบี้ย	33,293.02
รายได้ทั้งสิ้น	44,853,105.06
ค่าใช้จ่าย	
ค่าธรรมเนียมจัดการ	6,337,346.16
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์	422,489.76
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน	1,267,469.29
ค่าสอบบัญชี	128,931.73
ค่าใช้จ่ายอื่น	636,599.84
ค่าใช้จ่ายทั้งสิ้น	8,792,836.78
รายได้จากการลงทุนสุทธิ	36,060,268.28
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิจากเงินลงทุน	
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิที่เกิดขึ้นจริง	(78,147,804.46)
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิที่ยังไม่เกิดขึ้นจริง	660,982,632.95
รวมรายการกำไร(ขาดทุน)จากการลงทุนที่เกิดขึ้นและที่ยังไม่เกิดขึ้น	582,834,828.49
การเพิ่มขึ้น(ลดลง)ในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงาน	618,895,096.77

รายงานรายชื่อบริษัทนายหน้า และค่าธรรมเนียม ซื้อ-ขาย หลักทรัพย์

วันที่ 1 กุมภาพันธ์ 2552 ถึงวันที่ 31 กรกฎาคม 2552

ลำดับที่	ชื่อบริษัทนายหน้า	ค่านายหน้า (พันบาท)	อัตราส่วนค่านายหน้าแต่ละราย ต่อค่านายหน้าทั้งหมด
1	บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด	460.29	39.95%
2	บมจ.หลักทรัพย์ พัฒนสิน	346.18	30.05%
3	บมจ.หลักทรัพย์ ธนชาติ	345.57	30.00%
รวม		1,152.04	100.00%

รายงานการซื้อขายหลักทรัพย์และค่าใช้จ่ายต่าง ๆ
วันที่ 1 กุมภาพันธ์ 2552 ถึงวันที่ 31 กรกฎาคม 2552

	พันบาท
มูลค่าทรัพย์สินสุทธิเฉลี่ย	1,592,394
การซื้อขายหลักทรัพย์รวม	
มูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์รวม	490,899
ค่าธรรมเนียมนายหน้าในการซื้อขายหลักทรัพย์รวม	1,152
ค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายอื่น ๆ รวม	8,792
	ร้อยละ
- สัดส่วนค่าธรรมเนียมนายหน้าในการซื้อขายหลักทรัพย์รวมคิดเป็นร้อยละของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์รวม	0.23
- สัดส่วนค่าธรรมเนียมนายหน้าในการซื้อขายหลักทรัพย์รวมคิดเป็นร้อยละของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิเฉลี่ย	0.15
- สัดส่วนค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายอื่น ๆ รวมคิดเป็นร้อยละของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิเฉลี่ย	1.11

การรับผลประโยชน์ต่อแบบแผนเนื่องจากการใช้บริการมูลค่าอื่น

บริษัทที่ให้ผลประโยชน์	ผลประโยชน์ที่ได้รับ*				
	บทวิเคราะห์ ¹	ข้อมูลพื้นฐาน ²	รายงานสรุปข่าว ³	สัมภาษณ์ ⁴	บรรยายกลยุทธ์การลงทุน ⁵
บริษัทหลักทรัพย์ เอเซีย พลัส จำกัด (มหาชน)	✓	✓	✓	✓	✓
บริษัทหลักทรัพย์ บัวหลวง จำกัด (มหาชน)	✓	✓	✓	✓	✓
บริษัทหลักทรัพย์ ซี แอล เอส เอ (ประเทศไทย) จำกัด	✓	✓	✓	✓	✓
บริษัทหลักทรัพย์ จีดีเอสบี (ประเทศไทย) จำกัด	✓	✓	✓	✓	✓
บริษัทหลักทรัพย์ เครดิท สวิส (ประเทศไทย) จำกัด	✓	✓	✓	✓	✓
บริษัทหลักทรัพย์ พัฒนสิน จำกัด (มหาชน)	✓	✓	✓	✓	✓
บริษัทหลักทรัพย์ กลีรไทย จำกัด (มหาชน)	✓	✓	✓	✓	✓
บริษัทหลักทรัพย์ กิมเอ็ง (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)	✓	✓	✓	✓	✓
บริษัทหลักทรัพย์ เคจีไอ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)	✓	✓	✓	✓	✓
บริษัทหลักทรัพย์ เคที ซีมิโก้ จำกัด	✓	✓	✓	✓	✓
บริษัทหลักทรัพย์ กัทธ จำกัด (มหาชน)	✓	✓	✓	✓	✓
บริษัทหลักทรัพย์ ไทยพาณิชย์ จำกัด	✓	✓	✓	✓	✓
บริษัทหลักทรัพย์ นครหลวงไทย จำกัด	✓	✓	✓	✓	✓
บริษัทหลักทรัพย์ ทีเอสไอ จำกัด	✓	✓	✓	✓	✓
บริษัทหลักทรัพย์ ธนชาด จำกัด (มหาชน)	✓	✓	✓	✓	✓
บริษัทหลักทรัพย์ ยูบีเอส (ประเทศไทย) จำกัด	✓	✓	✓	✓	✓

*ผลประโยชน์ที่ได้รับ

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