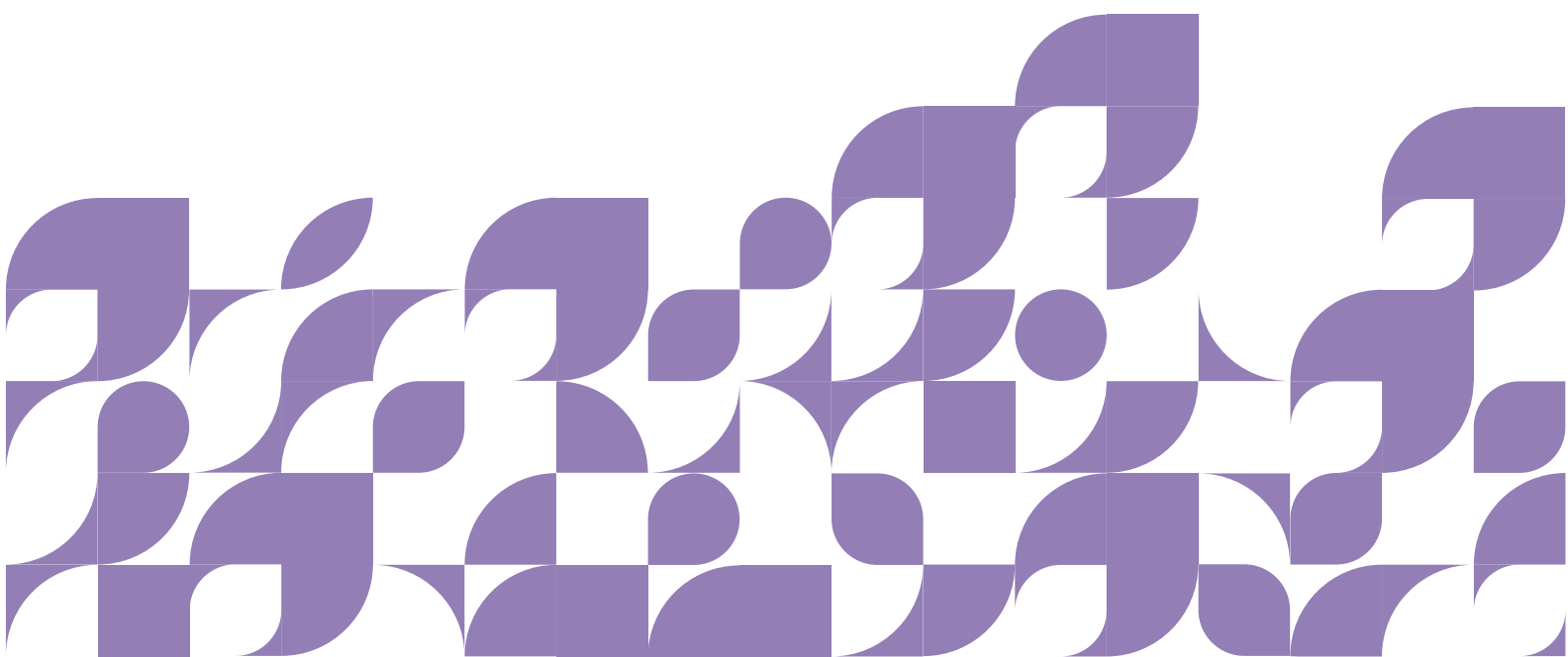




กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ เซิท อินเวสท์ ฟันด์ (SCBSET)

ร าย ง า น ป ร ะ จ ำ 6 เดือน
วันที่ 1 กุมภาพันธ์ 2554 ถึงวันที่ 31 กรกฎาคม 2554



สาส์นจากบริษัทจัดการ

เรียน ท่านผู้ถือหน่วยลงทุน

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด ในฐานะบริษัทจัดการกองทุนเปิดไทยพาณิชย์เซ็ทอินเด็กซ์ฟันด์ (SCBSET) ซึ่งกองทุนนี้เป็นกองทุนที่ลงทุนในหลักทรัพย์จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ ดังนั้นผลตอบแทนโดยรวมของกองทุนจะใกล้เคียงและผันผวนตามดัชนีตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย โดยในช่วง 6 เดือนแรกของปี 2554 ดัชนีตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยปรับตัวเพิ่มขึ้นร้อยละ 0.84 จาก 1032.76 จุด ณ สิ้นปี 2553 มาปิดที่ 1041.48 จุด ในขณะที่ อัตราผลตอบแทนของกองทุนอยู่ที่ประมาณร้อยละ 1.41

ในช่วงไตรมาสแรกของปี 2554 ดัชนีตลาดหุ้นไทยนับว่ามีการปรับตัวผันผวนอย่างมาก โดยมีปัจจัยกดดันจากทั้งความกังวลเกี่ยวกับสถานะทางการเงินของประเทศและสถาบันการเงินในภูมิภาคยุโรป สถานการณ์ตึงเครียดทางการเมืองในตะวันออกกลางและแอฟริกาเหนือ ภัยพิบัติแผ่นดินไหวและวิกฤตนิวเคลียร์ในญี่ปุ่น รวมถึงความกังวลเกี่ยวกับการเพิ่มขึ้นของอัตราดอกเบี้ยและอัตราเงินเฟ้อทั้งในภูมิภาคเอเชียและประเทศไทย ในระหว่างไตรมาสดัชนีจึงปรับตัวลดลงไปต่ำสุดที่ 937 จุด เนื่องจากนักลงทุนต่างชาติขายสุทธิเพื่อปรับลดการลงทุน แต่หลังจากนั้นก็ฟื้นตัวกลับขึ้นมาได้ โดยมีปัจจัยสนับสนุนหลักจากปัจจัยด้านเศรษฐกิจและผลการดำเนินงานที่แข็งแกร่งของบริษัทจดทะเบียนในไทยส่งผลให้เงินทุนต่างชาติไหลกลับเข้ามาลงทุน

ในไตรมาสที่ 2 ของปี 2554 ดัชนีตลาดหุ้นไทยกลับมาปรับตัวขึ้นในช่วงต้นไตรมาสต่อเนื่องจากปลายไตรมาสที่ 1 โดยปัจจัยที่มีอิทธิพลต่อตลาดได้แก่ การประกาศผลการดำเนินงานไตรมาสที่ 1/54 ที่ดีกว่าคาดการณ์ค่อนข้างมาก การประกาศยุบสภาและวันเลือกตั้ง อย่างไรก็ดี ข้อมูลชี้วัดทางเศรษฐกิจของสหรัฐฯ ยุโรป และจีน ที่ประกาศออกมาแยกว่าที่นักลงทุนคาดการณ์ไว้ รวมถึง วิกฤตหนี้ในยุโรปที่รุนแรงขึ้นและสร้างความกังวลให้กับนักลงทุน ส่งผลทำให้ราคาน้ำมันปรับตัวลดลงจากความกังวลว่าอุปสงค์จะลดลงตามเศรษฐกิจโลกที่อาจจะชะลอตัว ในขณะที่สถานการณ์การเมืองมีความเสี่ยงมากขึ้นช่วงก่อนเลือกตั้งส่งผลให้นักลงทุนต่างประเทศเปลี่ยนมุมมองการลงทุนในตลาดหุ้นไทยเป็นเชิงลบและขายสุทธิออกมาอย่างมีนัยสำคัญในช่วงปลายไตรมาสที่ 2

สำหรับครึ่งหลังของปี 2554 ปัจจัยสำคัญที่คาดว่าจะมีอิทธิพลอย่างมากต่อการเคลื่อนไหวของตลาดหุ้นไทยได้แก่ ความสับสนและการแก้ไขปัญหานี้สินของประเทศในภูมิภาคยุโรป อัตราเงินเฟ้อที่มีแนวโน้มว่าจะสูงขึ้นซึ่งจะทำให้ธนาคารกลางส่วนใหญ่ปรับอัตราดอกเบี้ยนโยบายขึ้น สำหรับปัจจัยบวกที่จะสนับสนุนทิศทางตลาด ได้แก่ ผลประกอบการของบริษัทจดทะเบียนที่น่าจะยังคงอยู่ในเกณฑ์ดี ผลการเลือกตั้งภายในประเทศและการดำเนินนโยบายของรัฐบาลที่จะได้รับเลือกเพื่อกระตุ้นเศรษฐกิจอย่างเป็นรูปธรรม ซึ่งปัจจัยเหล่านี้จะมีผลต่อความเคลื่อนไหวของกระแสเงินทุนของนักลงทุนต่างชาติ

สุดท้ายนี้ บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด ขอขอบคุณผู้ถือหน่วยทุกท่าน ที่ให้การส่งเสริมและสนับสนุนด้วยดีมาโดยตลอด

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด

รายงานผู้ดูแลผลประโยชน์

เสนอ ผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุนกองทุนเปิดไทยพาณิชย์เซ็ท อินเด็กซ์ ฟันด์

ธนาคารซีทีแบงก์ เอ็น เอ สาขากรุงเทพฯ ในฐานะผู้ดูแลผลประโยชน์กองทุนเปิดไทยพาณิชย์เซ็ท อินเด็กซ์ ฟันด์ อันมีบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนไทยพาณิชย์ จำกัด เป็นผู้จัดตั้งและจัดการกองทุน ได้ปฏิบัติหน้าที่ดูแลผลประโยชน์กองทุนรวมถึงกล่าว สำหรับรอบระยะเวลา ตั้งแต่วันที่ 1 กุมภาพันธ์ 2554 ถึงวันที่ 31 กรกฎาคม 2554 แล้วนั้น

ธนาคารฯ ได้จัดทำรายงานฉบับนี้ขึ้นบนพื้นฐานของแหล่งข้อมูลที่ได้รับ ณ วันที่ในจดหมายนี้ โดยเชื่อว่า เชื่อถือได้ แต่ธนาคารไม่รับรองความถูกต้องหรือความสมบูรณ์ของข้อมูลดังกล่าว และขอสงวนสิทธิในความรับผิดชอบต่อความผิดพลาด ความละเอียด (รวมถึงไปถึงความรับผิดชอบต่อบุคคลที่สาม) อย่างชัดเจน ไม่มีการรับประกันว่าเหตุการณ์หรือผลลัพธ์ในอนาคตจะตรงกันกับรายงานดังกล่าว ธนาคารฯ กรรมการ พนักงาน หรือตัวแทนของธนาคารไม่รับประกันใดๆ ต่อการจ่ายเงินทุน การกระทำการ หรือการแจกจ่ายกองทุน และไม่รับผิดชอบต่อความเสียหายที่เป็นผลมาจากการกระทำ หรือการละเอียดที่เกิดขึ้นอันเกี่ยวข้องกับรายงานฉบับนี้

ธนาคารฯ เห็นว่าบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนไทยพาณิชย์ จำกัด ได้ปฏิบัติหน้าที่ในการจัดการกองทุนเปิดไทยพาณิชย์เซ็ท อินเด็กซ์ ฟันด์ โดยถูกต้องตามที่ควรตามวัตถุประสงค์ที่ได้กำหนดไว้ในโครงการจัดการที่ได้รับอนุมัติจากสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์และภายใต้พระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535

ธนาคารซีทีแบงก์ เอ็น เอ สาขากรุงเทพฯ



Nitchamon Khajitsuwan
Vice President

ผู้ดูแลผลประโยชน์

ธนาคารซีทีแบงก์ เอ็น เอ สาขากรุงเทพฯ
4 สิงหาคม 2554

ผลการดำเนินงาน

ข้อมูล ณ วันที่ 31 กรกฎาคม 2554

ผลตอบแทนจากการลงทุน	ย้อนหลัง	ย้อนหลัง	ย้อนหลัง	ย้อนหลัง	นับแต่จัดตั้ง
	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี	3 ปี	กองทุน
	29 เม.ย. 54 -29 ก.ค. 54	31 ม.ค. 54 -29 ก.ค. 54	30 ก.ค. 53 -29 ก.ค. 54	31 ก.ค. 51 -29 ก.ค. 54	20 ส.ค. 39 -29 ก.ค. 54
กองทุน SCBSET	+3.31%	+18.87%	+34.79%	+81.78%	+23.94%
SET Index	+3.66%	+17.57%	+32.45%	+67.60%	+5.80%

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด
 กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ เซ็ท อินดีกซ์ ฟันด์
 รายละเอียดหลักทรัพย์ และสัดส่วนการลงทุน
 ณ. วันที่ 31 ก.ค. 2554

ชื่อหลักทรัพย์	ราคา ณ 31 ก.ค. 2554 (บาท)	จำนวนหุ้น (หุ้น)	มูลค่า ตามราคาตลาด (บาท)	ร้อยละของมูลค่า ทรัพย์สินสุทธิ (%)	ค่าประกัน/รับรอง/รับอาวัล หรือสลากหลังโอน แบบมีสิทธิไต่เบี่ย
หุ้นจดทะเบียน			2,457,639,354.02	99.07%	
ธุรกิจการเกษตร			84,486,090.00	3.41%	
บมจ.เจริญโภคภัณฑ์อาหาร (CPF)	31.75	1,945,900.00	61,782,325.00	2.49%	
บมจ.จีเอฟทีที (GFPT)	11.20	577,200.00	6,464,640.00	0.26%	
บมจ.ศรีลังกาไกรอินดัสทรี (STA)	29.25	410,500.00	12,007,125.00	0.48%	
บมจ.ยูนิวันนิชั่นมันปาล์ม (UVAN)	80.00	52,900.00	4,232,000.00	0.17%	
ยานยนต์			17,774,232.00	0.72%	
บมจ.อีโนเว รันเบอร์ (ประเทศไทย) (IRC)	11.90	536,000.00	6,378,400.00	0.26%	
บมจ.สมบูรณ์ แอ็คควาซ์ เทคโนโลยี (SAT)	27.00	192,616.00	5,200,632.00	0.21%	
บมจ.ไทอัสแคนเคย์-การไฟฟ้า (STANLY)	176.00	35,200.00	6,195,200.00	0.25%	
ธนาคาร			470,690,309.44	18.97%	
บมจ.ธนาคารกรุงศรีอยุธยา (BAY)	27.50	1,640,800.00	45,122,000.00	1.82%	
บมจ.ธนาคารกรุงเทพ (BBL)	174.00	507,500.00	88,305,000.00	3.56%	
บมจ.ธนาคาร ซีไอเอ็มบี ไทย (CIMBT)	3.04	4,797,588.00	14,584,667.52	0.59%	
บมจ.ธนาคารกสิกรไทย (KBANK)	141.00	634,300.00	89,436,300.00	3.61%	
บมจ.ธนาคารเกียรตินาคิน (KK)	34.50	182,500.00	6,296,250.00	0.25%	
บมจ.ธนาคารกรุงไทย (KTB)	20.80	2,994,600.00	62,287,680.00	2.51%	
LH FINANCIAL GROUP PLC. (LHBANK)	1.68	4,130,200.00	6,938,736.00	0.28%	
บมจ.ธนาคารไทยพาณิชย์ (SCB)	126.50	907,200.00	114,760,800.00	4.63%	
บมจ.ทุนธนชาต (TCAP)	30.50	369,200.00	11,260,600.00	0.45%	
บมจ.ทีสโก้ไฟแนนเชียลกรุ๊ป (TISCO)	40.00	205,600.00	8,224,000.00	0.33%	
บมจ.ธนาคารทหารไทย (TMB)	2.04	11,506,998.00	23,474,275.92	0.95%	
พาณิชย์			154,925,206.50	6.25%	
บมจ.บิ๊กซี ซูเปอร์เซ็นเตอร์ (BIGC)	120.00	215,600.00	25,872,000.00	1.04%	
บมจ.เบอร์ลี่ ยุคเกอร์ (BJC)	21.30	463,600.00	9,874,680.00	0.40%	
บมจ.ซีพี ออลล์ จำกัด (CPALL)	49.50	1,195,700.00	59,187,150.00	2.39%	
บริษัท สยามโกลบอลเฮ้าส์ จำกัด (มหาชน) (GLOBAL)	9.50	760,300.00	7,222,850.00	0.29%	
บมจ.โฮม โปรดักส์ เซ็นเตอร์ (HMPRO)	9.20	1,516,800.00	13,954,560.00	0.56%	
บมจ.สยามแม็คโคร (MAKRO)	233.00	68,600.00	15,983,800.00	0.64%	
บมจ.ห้างสรรพสินค้าโรบินสัน (ROBINS)	36.75	324,700.00	11,932,725.00	0.48%	
บมจ.สหพัฒน์พิบูล (SPC)	27.75	199,866.00	5,546,281.50	0.22%	
บมจ.สหพัฒนาอินเตอร์โฮลดิ้ง (SPI)	22.80	234,700.00	5,351,160.00	0.22%	
เทคโนโลยีสารสนเทศและการสื่อสาร			205,270,842.26	8.28%	
บมจ. แอดวานซ์ อินโฟร์ เซอร์วิส (ADVANC)	115.50	796,600.00	92,007,300.00	3.71%	
บริษัท ไทเทิล แอ็กเซ็ส คอมมูนิเคชั่น จำกัด (มหาชน) (DTAC)	67.50	654,695.00	44,191,912.50	1.78%	
บมจ.อิน คอร์ปอเรชั่น (INTUCH)	39.50	908,300.00	35,877,850.00	1.45%	
บมจ.จัสตินอินเตอร์เนชั่นแนล (JAS)	3.20	2,658,800.00	8,508,160.00	0.34%	
บมจ.สามารจ ไอ-โมบาย (SIM)	2.04	4,034,600.00	8,230,584.00	0.33%	
บมจ.ทรู คอร์ปอเรชั่น (TRUE)	4.08	4,033,097.00	16,455,035.76	0.66%	
วัสดุก่อสร้าง			167,006,160.40	6.73%	
บมจ.ไดนาสตีเชรอนิก (DCC)	51.75	181,600.00	9,397,800.00	0.38%	
บมจ.ปูนซิเมนต์ไทย (SCC)	381.00	316,600.00	120,624,600.00	4.86%	
บมจ.ปูนซิเมนต์นครหลวง (SCCC)	232.00	66,300.00	15,381,600.00	0.62%	
บมจ.ทีปโก้เอสพีแอล (TASCO)	50.50	97,078.00	4,902,439.00	0.20%	
บมจ.ทีพีไอ โพลีน (TIPL)	13.00	799,700.00	10,396,100.00	0.42%	
บมจ.ทาทา สตีล (ประเทศไทย) (TSTH)	1.42	4,439,170.00	6,303,621.40	0.25%	

ชื่อหลักทรัพย์	ราคา ณ 31 ก.ค. 2554 (บาท)	จำนวนหุ้น (หุ้น)	มูลค่า ตามราคาตลาด (บาท)	ร้อยละของมูลค่า ทรัพย์สินสุทธิ (%)	ค่าประกัน/รับรอง/รับอาวัล หรือสัถกหลังโอน แบบมีสิทธิไถ่เบี่ย
จีนส่วนอิเล็กทรอนิกส์			26,854,650.00	1.08%	
บมจ.แมก-คอมพ์ อีเล็กทรอนิกส์ (ประเทศไทย) (CCET)	3.40	1,809,600.00	6,152,640.00	0.25%	
บมจ.เดลต้า อีเลคโทรนิคส์ (ประเทศไทย) (DELTA)	27.25	346,440.00	9,440,490.00	0.38%	
บมจ.ฮานา ไมโครอิเล็กทรอนิกส์ (HANA)	24.90	269,800.00	6,718,020.00	0.27%	
บมจ.มูราไม ได้อิเล็กทรอนิกส์ (METCO)	233.00	19,500.00	4,543,500.00	0.18%	
พลังงานและสาธารณูปโภค			685,980,602.50	27.65%	
บมจ.บ้านปู (BANPU)	732.00	73,000.00	53,436,000.00	2.15%	
บมจ.บางจากปิโตรเลียม (BCP)	22.60	503,800.00	11,385,880.00	0.46%	
บมจ.จัดการและพัฒนาทรัพยากรน้ำภาคตะวันออก (EASTW)	6.30	1,081,800.00	6,815,340.00	0.27%	
บริษัท ผลิตภัณฑ์ไฟฟ้า จำกัด (มหาชน) (EGCO)	94.25	145,500.00	13,713,375.00	0.55%	
บมจ.เอสโซ่ (ประเทศไทย) (ESSO)	12.20	1,133,400.00	13,827,480.00	0.56%	
บมจ.โกลว์ พลังงาน (GLOW)	56.50	399,100.00	22,549,150.00	0.91%	
บมจ.ไออาร์พีซี (IRPC)	5.75	5,337,500.00	30,690,625.00	1.24%	
บมจ.ปิคนิค คอร์ปอเรชั่น (PICNI)	0.21	9,502,000.00	1,995,420.00	0.08%	
บมจ.ปตท. (PTT)	347.00	754,800.00	261,915,600.00	10.56%	
บริษัท ปตท. อะโรมาติกส์และการกลั่น จำกัด (มหาชน) (PTTAR)	42.50	824,171.00	35,027,267.50	1.41%	
บมจ.ปตท.สำรวจและผลิตปิโตรเลียม (PTTEP)	184.00	860,300.00	158,295,200.00	6.38%	
บมจ.ผลิตไฟฟ้าราชบุรีโฮลดิ้ง (RATCH)	43.00	394,900.00	16,980,700.00	0.68%	
บมจ.สยามแก๊ส แอนด์ ปิโตรเคมีกลั่น (SGP)	18.60	496,400.00	9,233,040.00	0.37%	
บมจ.ไทยออยล์ (TOP)	76.75	538,700.00	41,345,225.00	1.67%	
บมจ.น้ำประปาไทย (TTW)	5.95	1,474,000.00	8,770,300.00	0.35%	
แพคเกจ			21,290,750.00	0.86%	
บมจ.ไอ.ซี.ซี.อินเตอร์เนชั่นแนล (ICC)	43.00	113,200.00	4,867,600.00	0.20%	
บมจ.ซาบิน่า (SABINA)	111.50	54,500.00	6,076,750.00	0.24%	
บมจ.สหยูนิย่น (SUC)	34.00	134,400.00	4,569,600.00	0.18%	
บมจ.ไทยเรอชน (TR)	83.00	69,600.00	5,776,800.00	0.23%	
เงินทุนและหลักทรัพย์			12,682,830.00	0.51%	
บมจ.เออีเอส ทรัสต์ (ไทยแลนด์) (AEONTS)	35.50	179,800.00	6,382,900.00	0.26%	
บมจ.เงินทุนธนชาต (DS)		19,800.00	0.00	0.00%	
บมจ.เงินทุนเอกรัง (FINI)		10,600.00	0.00	0.00%	
บมจ.หลักทรัพย์ กิมเฮง (ประเทศไทย) (KEST)	16.10	391,300.00	6,299,930.00	0.25%	
บมจ.เงินทุนหลักทรัพย์ซิทกา (SITCA)		13,000.00	0.00	0.00%	
อาหารและเครื่องดื่ม			62,462,034.70	2.52%	
บมจ.น้ำตาลขอนแก่น (KSL)	15.60	511,200.00	7,974,720.00	0.32%	
บมจ.ไมเนอร์ อินเตอร์เนชั่นแนล (MINT)	13.40	849,833.00	11,387,762.20	0.46%	
บมจ.โออิชิ กรุ๊ป (OISHI)	95.00	86,600.00	8,227,000.00	0.33%	
บมจ.เสริมสุข (SSC)	59.75	106,600.00	6,369,350.00	0.26%	
บมจ.ไทยเพอร์ซิเมนต์ฟู๊ดส์ (TF)	126.00	62,900.00	7,925,400.00	0.32%	
บมจ.ไทยยูเนียน ไฟฟร่าร์ โปรดัคส์ (TUF)	57.00	248,020.00	14,137,140.00	0.57%	
บมจ.น้ำมันพืชไทย (TVO)	25.50	252,575.00	6,440,662.50	0.26%	
การแพทย์			40,493,911.00	1.63%	
บมจ.กรุงเทพดุสิตเวชการ (BGH)	57.75	432,500.00	24,976,875.00	1.01%	
บมจ.โรงพยาบาลบำรุงราษฎร์ (BH)	37.75	242,000.00	9,135,500.00	0.37%	
บมจ.บางกอก เชน สอส์พิทอล (KH)	6.20	1,029,280.00	6,381,536.00	0.26%	
ของใช้ในชีวิตประจำวันและสำนักงาน			5,013,175.00	0.20%	
บมจ.ศรีไทยซูเปอร์มาร์เก็ต (SITHAI)	9.65	519,500.00	5,013,175.00	0.20%	
ประกันภัยและประกันชีวิต			40,125,060.00	1.62%	
บมจ.กรุงเทพประกันภัย (BKI)	260.00	31,721.00	8,247,460.00	0.33%	
บริษัท กรุงเทพประกันชีวิต จำกัด (มหาชน) (BLA)	52.00	379,300.00	19,723,600.00	0.80%	
(SCBLIF)	472.00	25,750.00	12,154,000.00	0.49%	

ชื่อหลักทรัพย์	ราคา ณ 31 ก.ค. 2554 (บาท)	จำนวนหุ้น (หุ้น)	มูลค่า ตามราคาตลาด (บาท)	ร้อยละของมูลค่า ทรัพย์สินสุทธิ (%)	ค่าประกัน/รับรอง/รับอาวัล หรือหลักประกัน แบบมีสิทธิไถ่เบี่ย
วิสาหกิจอุตสาหกรรมและเครื่องจักร			22,351,089.60	0.90%	
บมจ.จี เจ สตีล (GJS)	0.25	26,390,500.00	6,597,625.00	0.27%	
บมจ.จี สตีล (GSTEEL)	0.69	5,336,300.00	3,682,047.00	0.15%	
บมจ.ไทยนิโอกซ์ สแตนเลส (INOX)	2.10	2,917,800.00	6,127,380.00	0.25%	
บมจ.สหวิริยาเสถียรคัตติ้ง (SSI)	1.18	5,037,320.00	5,944,037.60	0.24%	
สื่อและสิ่งพิมพ์			38,460,530.00	1.55%	
บมจ.บีอีซี เวิลด์ (BEC)	41.00	599,800.00	24,591,800.00	0.99%	
บมจ.ไอทีวี (ITV)		585,200.00	0.00	0.00%	
บมจ.เมเจอร์ ซินีเพล็กซ์ กรุ๊ป (MAJOR)	16.40	359,700.00	5,899,080.00	0.24%	
บมจ.อสมท (MCOT)	30.50	261,300.00	7,969,650.00	0.32%	
เหมืองแร่			4,957,080.00	0.20%	
บมจ.ผาแดงอินดัสทรี (PDI)	20.20	245,400.00	4,957,080.00	0.20%	
บรรณภัณฑ์			11,859,256.25	0.48%	
บมจ.เอ.เจ. พลาซ่า (AJ)	28.75	185,411.00	5,330,566.25	0.21%	
บมจ. โพลิเพล็กซ์ (ประเทศไทย) (PTL)	24.10	270,900.00	6,528,690.00	0.26%	
ปิโตรเคมีและเคมีภัณฑ์			139,242,145.00	5.61%	
บมจ. อินโดรามา เวนเจอร์ส (IVL)	43.75	1,296,200.00	56,708,750.00	2.29%	
บมจ.ปตท. เคมีคอล (PTTCH)	162.50	386,200.00	62,757,500.00	2.53%	
บมจ.ไทยเซ็นทรัลเคมี (TCCC)	21.10	241,000.00	5,085,100.00	0.20%	
บมจ.ไทยพลาสติกและเคมีภัณฑ์ (TPC)	29.75	253,000.00	7,526,750.00	0.30%	
บมจ.วินไทย (VNT)	18.90	379,050.00	7,164,045.00	0.29%	
พัฒนาอสังหาริมทรัพย์			156,702,474.00	6.32%	
บมจ.อมตะ คอร์ปอเรชั่น (AMATA)	15.60	442,800.00	6,907,680.00	0.28%	
บมจ.เอเชียนพร็อพเพอร์ตี้ ดีเวลลอปเม้นท์ (AP)	6.05	1,144,560.00	6,924,588.00	0.28%	
บมจ.บางกอกแลนด์ (BLAND)	0.72	8,819,900.00	6,350,328.00	0.26%	
บมจ.ช.การช่าง (CK)	7.90	694,642.00	5,487,671.80	0.22%	
บมจ.เซ็นทรัลพัฒนา (CPN)	36.75	625,100.00	22,972,425.00	0.93%	
บมจ.เหมราชพัฒนาที่ดิน (HEMRAJ)	2.42	3,487,400.00	8,439,508.00	0.34%	
บมจ.อิตาเลียนไทย ดีเวลลอปเม้นท์ (ITD)	4.58	1,868,500.00	8,557,730.00	0.34%	
บมจ.แลนด์แอนด์เฮาส์ (LH)	6.80	2,791,800.00	18,984,240.00	0.77%	
บมจ.เอส.พี.เอ็น. ดีเวลลอปเม้นท์ (LPN)	11.30	655,600.00	7,408,280.00	0.30%	
บมจ.เอ็ม บี เค (MBK)	98.00	77,700.00	7,614,600.00	0.31%	
บมจ.พญาบุรุษ เรือทะเล (PS)	20.60	711,700.00	14,661,020.00	0.59%	
บมจ.กวอดิตีเฮาส์ (QH)	1.89	3,251,600.00	6,145,524.00	0.25%	
บมจ.สวนอุตสาหกรรมโรจนะ (ROJNA)	9.95	536,200.00	5,335,190.00	0.22%	
บมจ.แสนสิริ (SIRI)	5.40	1,108,377.00	5,985,235.80	0.24%	
บมจ.สุภาลัย (SPALI)	13.90	650,900.00	9,047,510.00	0.36%	
บมจ.ซีโน-ไทย เอ็นจิเนียริงแอนด์คอนสตรัคชั่น (STEC)	11.50	546,600.00	6,285,900.00	0.25%	
บมจ.เอสทีที แอนด์ ไอ (STPI)	23.10	177,614.00	4,102,883.40	0.17%	
บมจ.ไทกอน อินดัสเทรียล คอนเนคชั่น (TICON)	14.40	381,400.00	5,492,160.00	0.22%	
การทอใยแก้วและเส้นใย			23,393,394.00	0.94%	
บมจ.โรงงานเส้นใย พลาซ่า (CENTEL)	10.30	535,600.00	5,516,680.00	0.22%	
บมจ.ดี เออาร์ กรุ๊ป (ERW)	2.98	1,819,300.00	5,421,514.00	0.22%	
บมจ.ลาอูน่า รีสอร์ท แอนด์ โฮเทล (LRH)	58.00	89,800.00	5,208,400.00	0.21%	
บมจ.โอเอชทีแอล (OHTL)	488.00	14,850.00	7,246,800.00	0.29%	

ชื่อหลักทรัพย์	ราคา ณ 31 ก.ค. 2554 (บาท)	จำนวนหุ้น (หุ้น)	มูลค่า ตามราคาตลาด (บาท)	ร้อยละของมูลค่า ทรัพย์สินสุทธิ (%)	ค่าประกัน/รับรอง/รับอาวัล หรือสลากหังโงน แบบมีสิทธิไต่เบื้อ
ชนสงและไอจีซีคิส			64,210,776.25	2.59%	
บมจ.ท่าอากาศยานไทย (AOT)	47.00	393,400.00	18,489,800.00	0.75%	
บมจ.ทางด่วนกรุงเทพ (BECL)	18.50	268,900.00	4,974,650.00	0.20%	
บริษัท บีทีเอส กรุ๊ป โฮลดิ้งส์ จำกัด (มหาชน) (BTS)	0.73	18,228,500.00	13,306,805.00	0.54%	
บมจ.พีรเชิยส ชิพปีง (PSL)	17.50	295,500.00	5,171,250.00	0.21%	
บมจ.อรรพ์ ซี แอล (RCL)	8.05	624,000.00	5,023,200.00	0.20%	
บมจ.การบินไทย (THAI)	28.25	610,445.00	17,245,071.25	0.70%	
ใบสำคัญแสดงสิทธิ			1,406,755.12	0.06%	
บมจ.บางกอกแอนด์ (BLAND-W3)	0.18	721,584.00	129,885.12	0.01%	
(ROJNA-W3/U)	5.95	214,600.00	1,276,870.00	0.05%	
รวมหลักทรัพย์ประเภทหุ้น			2,457,639,354.02	99.07%	
เงินฝากธนาคาร			81,856,258.05	3.30%	
ธนาคารซีทีแบงก์ (CITIBANK)			69,664,679.28	2.81%	
บมจ.ธนาคาร ยูโอบี (UOBT)			12,191,578.77	0.49%	
			1,353.21	0.00%	
(INCISBLSCBSset)			1,353.21	0.00%	
สินทรัพย์อื่น ๆ			31,658,547.71	1.28%	
หนี้สิน			-90,560,043.69	-3.65%	
มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ			2,480,595,469.30	100.00%	
มูลค่าหน่วยลงทุน (บาท)			12.3931		

กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ เซ็ท อินเด็กซ์ ฟันด์

SCB SET INDEX OPEN-ENDED FUND

แบบค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม

FUND'S DIRECT EXPENSES REPORT

ตั้งแต่วันที่ 1 กุมภาพันธ์ 2554 ถึงวันที่ 31 กรกฎาคม 2554

Period from 1 February 2011 to 31 July 2011

ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม *	จำนวนเงิน	ร้อยละต่อปีของ
Fund's direct expenses	หน่วย : พันบาท	มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ
ค่าธรรมเนียมการจัดการ (Management fee)	12,526	0.96
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ (Trustee fee)	557	0.04
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน (Registrar fee)	-	-
ค่าที่ปรึกษาการลงทุน (Advisory fee)	-	-
ค่าสอบบัญชี (Auditing fee)	140	0.01
ค่าใช้จ่ายงานทะเบียนกองทุน (Registration Expense)	300	0.02
ค่าธรรมเนียมธนาคาร (Bank fee)	337	0.03
ค่าใช้จ่ายอื่น ๆ (Other expenses)	212	0.02
รวมค่าใช้จ่ายทั้งหมด (Total Expense) **	14,072	1.08

* ค่าใช้จ่ายดังกล่าวได้รวมภาษีมูลค่าเพิ่มแล้ว / Including VAT

** ไม่รวมค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ และค่าธรรมเนียมต่าง ๆ ที่เกิดขึ้นจากการซื้อขายหลักทรัพย์

Excluding brokerage fee and other transactions fees

กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ เซ็ท อินเด็กซ์ ฟันด์ (SCBSET)

งบดุล

ณ วันที่ 31 กรกฎาคม 2554

	"ยังไม่ได้ตรวจสอบ" "ยังไม่ได้สอบทาน"
	บาท
สินทรัพย์	
เงินลงทุนตามราคายุติธรรม	2,469,832,286.00
เงินสดและเงินฝากธนาคาร	69,664,679.28
ลูกหนี้จากเงินปันผลและดอกเบี้ย	815,054.08
ลูกหนี้จากการขายเงินลงทุน	30,745,556.48
ค่าใช้จ่ายรอตัดบัญชี	97,937.15
รวมสินทรัพย์	2,571,155,512.99
หนี้สิน	
เจ้าหนี้จากการรับซื้อคืนส่วนได้เสีย	87,975,935.98
เจ้าหนี้อื่น	6,820.00
ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย	2,450,881.34
หนี้สินอื่น	126,406.37
รวมหนี้สิน	90,560,043.69
สินทรัพย์สุทธิ	2,480,595,469.30
สินทรัพย์สุทธิ :-	
ทุนที่ได้รับจากผู้ถือหน่วยลงทุน	2,001,593,842.85
กำไร(ขาดทุน)สะสม	1,637,134,685.60
บัญชีปรับสมดุล	(1,158,133,059.15)
สินทรัพย์สุทธิ	2,480,595,469.30
จำนวนหน่วยลงทุนที่จำหน่ายแล้ว (หน่วย)	200,159,384.28
สินทรัพย์สุทธิต่อหน่วยลงทุน	12.3931

กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ เซ็ท อินเด็กซ์ ฟันด์ (SCBSET)

งบกำไรขาดทุน

รอบระยะเวลาตั้งแต่วันที่ 1 กุมภาพันธ์ 2554 ถึงวันที่ 31 กรกฎาคม 2554

"ยังไม่ได้ตรวจสอบ"

"ยังไม่ได้สอบทาน"

บาท

รายได้จากการลงทุน

รายได้เงินปันผล 53,226,212.60

รายได้ดอกเบี้ย 191,654.24

รายได้ทั้งสิ้น 53,417,866.84

ค่าใช้จ่าย

ค่าธรรมเนียมจัดการ 12,525,656.32

ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ 556,695.84

ค่าสอบบัญชี 140,336.54

ค่าใช้จ่ายในการขายและรับซื้อคืนหน่วยลงทุน 751.67

ค่าใช้จ่ายอื่น 848,981.15

ค่าใช้จ่ายทั้งสิ้น 14,072,421.52

รายได้จากการลงทุนสุทธิ 39,345,445.32

รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิจากเงินลงทุน

รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิที่เกิดขึ้นจริง 251,880,625.29

รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิที่ยังไม่เกิดขึ้นจริง 177,710,742.62

รวมรายการกำไร(ขาดทุน)จากการลงทุนที่เกิดขึ้นและที่ยังไม่เกิดขึ้น 429,591,367.91

การเพิ่มขึ้น(ลดลง)ในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงาน 468,936,813.23

รายงานรายชื่อบริษัทนายหน้า และค่าธรรมเนียม ซื้อ-ขาย หลักทรัพย์
ของกองทุนเปิดไทยพาณิชย์ เซ็ท อินเด็กซ์ ฟันด์
ระหว่างวันที่ 1 กุมภาพันธ์ 2554 ถึง 31 กรกฎาคม 2554

ลำดับที่	ชื่อบริษัทนายหน้า	ค่านายหน้า (พันบาท)	อัตราส่วนค่านายหน้าแต่ละราย ต่อค่านายหน้าทั้งหมด
1	บมจ.หลักทรัพย์ ธนชาติ	2,849.38	37.50%
2	บมจ.หลักทรัพย์ พัฒนสิน	2,801.57	36.87%
3	บริษัทหลักทรัพย์ ไทยพาณิชย์ จำกัด	1,946.63	25.62%
			0.00%
			0.00%
			0.00%
			0.00%
			0.00%
รวม		7,597.58	100.00%

การรับผลประโยชน์ตอบแทนเนื่องจากการที่กองทุนให้บริการบุคคลอื่น ประจำปีไตรมาส 2 ปี 2554

บริษัทที่ผลประโยชน์	ผลประโยชน์ที่ได้รับ*					
	บทวิเคราะห์ ¹	ข้อมูลพื้นฐาน ²	รายงานสรุป ³	สัมภาษณ์ ⁴	บรรยายกลยุทธการลงทุน ⁵	จัดเยี่ยมชมบริษัท ⁶
บริษัทหลักทรัพย์ เอเซีย พลัส จำกัด (มหาชน)	✓	✓	✓		✓	
บริษัทหลักทรัพย์ บัวหลวง จำกัด (มหาชน)	✓	✓	✓	✓	✓	✓
บริษัทหลักทรัพย์ ซี แอล เอส เอ (ประเทศไทย) จำกัด	✓	✓	✓	✓	✓	
บริษัทหลักทรัพย์ พัฒนาสิน จำกัด (มหาชน)	✓	✓	✓		✓	
บริษัทหลักทรัพย์เคเรดิท ซีวิส (ประเทศไทย) จำกัด	✓	✓	✓	✓	✓	
บริษัทหลักทรัพย์ กิมเอ็ง (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)	✓	✓	✓	✓	✓	✓
บริษัทหลักทรัพย์ แมคควอรี (ประเทศไทย) จำกัด	✓	✓	✓		✓	✓
บริษัทหลักทรัพย์ ภัทร จำกัด (มหาชน)	✓	✓	✓	✓	✓	✓
บริษัทหลักทรัพย์ ไทยพาณิชย์ จำกัด	✓	✓	✓	✓	✓	✓
บริษัทหลักทรัพย์ชนชาติ จำกัด (มหาชน)	✓	✓	✓	✓	✓	
บริษัทหลักทรัพย์ ทีเอสไอ จำกัด	✓	✓	✓	✓	✓	
บริษัทหลักทรัพย์ ยูบีเอส (ประเทศไทย) จำกัด	✓	✓	✓		✓	

*ผลประโยชน์ที่ได้รับ

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

-

รายงานการซื้อขายหลักทรัพย์และค่าใช้จ่ายต่าง ๆ

VOLUME TRADE AND EXPENSES REPORT

ตั้งแต่วันที่ 1 กุมภาพันธ์ 2554 ถึง วันที่ 31 กรกฎาคม 2554

Period from 1 February 2011 to 31 July 2011

	(พันบาท) / (Thousand Baht)
มูลค่าทรัพย์สินสุทธิเฉลี่ย / Average Net Assests Value	2,622,784
การซื้อขายหลักทรัพย์รวม / Volume Trade	
มูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์รวม	4,244,384
Total Volume Trade	
ค่าธรรมเนียมหน้าในการซื้อขายหลักทรัพย์รวม	7,598
Total Brokerage Fee	
ค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายอื่น ๆ รวม / Fee and other Expenses	14,072
	(ร้อยละ) / (Percentage)
สัดส่วนค่าธรรมเนียมหน้าในการซื้อขายหลักทรัพย์รวมคิดเป็นร้อยละของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์รวม	0.18
Brokerage Fee as	
Percentage of Total Trading Volume	
สัดส่วนค่าธรรมเนียมหน้าในการซื้อขายหลักทรัพย์รวมคิดเป็นร้อยละของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิเฉลี่ย	0.59
Brokerage Fee as	
Percentage of Average Net Assests Value	
สัดส่วนค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายอื่น ๆ รวมคิดเป็นร้อยละของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิเฉลี่ย	1.08
Fee and other Expenses as	
Percentage of Average Net Assests Value	