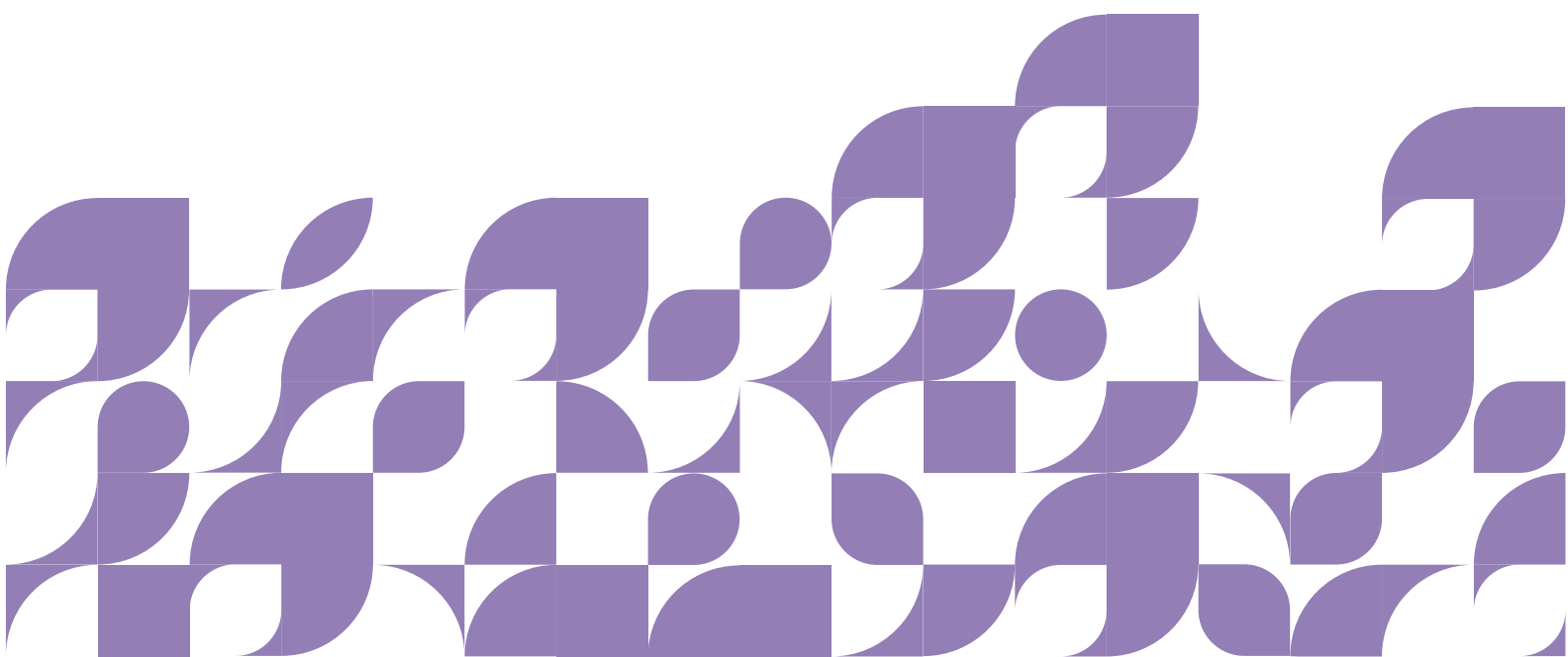




กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ เซ็ก อินดิคซ์ ฟันด์ (SCBSET)

ร าย ง า น ป ร ะ จ ำ 6 เดือน
ตั้งแต่วันที่ 1 กุมภาพันธ์ 2558 ถึงวันที่ 31 กรกฎาคม 2558



สารจากบริษัทจัดการ

เรียน ท่านผู้ถือหน่วยลงทุน

กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ซีทีอินเด็กซ์ฟันด์ (SCBSET) เป็นกองทุนที่ลงทุนในหลักทรัพย์จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ ดังนั้นผลตอบแทนของกองทุนจะผันผวนตามดัชนีตลาดหลักทรัพย์ (SET Index) โดยในช่วงวันที่ 1 กุมภาพันธ์ 2558 ถึง 31 กรกฎาคม 2558 ดัชนีตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยปรับตัวลงร้อยละ 8.93 มาปิดที่ 1440.12 จุด

ในช่วงต้นไตรมาสที่ 1 ของปี 2558 ดัชนีตลาดหุ้นไทยปรับตัวขึ้นแรงหลังจากที่มีปัจจัยบวกสนับสนุนจากการที่ธนาคารกลางยุโรปประกาศใช้มาตรการอัดฉีดสภาพคล่องสู่ในตลาด ผ่านมาตรการผ่อนคลายทางการเงินมูลค่า 6 แสนล้านยูโรต่อเดือนจนถึงปลายปี 2559 และปรับตัวผันผวนในกรอบแคบในเดือนกุมภาพันธ์ ถึงแม้ว่าปัจจัยบวกจากข่าวความคืบหน้าของแผนการลงทุนโครงสร้างพื้นฐานภายในประเทศที่เข้ามาอย่างต่อเนื่อง ไม่ได้เพิ่มความเชื่อมั่นในการลงทุนมากนัก ประกอบกับมีปัจจัยเสี่ยงจากการที่รัฐบาลของประเทศกรีซที่ยังไม่มีข้อสรุปที่ชัดเจนว่าจะปฏิบัติตามข้อเสนอที่เคยให้ไว้กับเจ้าหนี้เพื่อขอความช่วยเหลือทางการเงินเพิ่มเติม อย่างไรก็ตาม ดัชนีปรับตัวลงในเดือนมีนาคม โดยมีปัจจัยกดดันจาก ผลประกอบการไตรมาส 4 ของ 2557 ของบริษัทจดทะเบียนที่ออกมาไม่ดี ความกังวลเกี่ยวกับการชะลอตัวของเศรษฐกิจไทย แผนการประมูลคลื่นความถี่ 4G ที่ยังไม่มีผลชัดเจนและ และการที่องค์การการบินพลเรือนระหว่างประเทศ (ICAO) สั่งห้ามเครื่องบินไทยบินเข้าประเทศญี่ปุ่นและเกาหลีระหว่างการพิจารณามาตรฐานด้านการบินของไทย

ภาวะการลงทุนในไตรมาส 2 ของปี 2558 ปรับตัวลงเนื่องจากตัวเลขเศรษฐกิจที่ออกมาแย่กว่าตลาดคาด แม้ว่าในช่วงแรกของไตรมาสมีปัจจัยภายในประเทศเข้ามาสนับสนุนได้แก่ การประกาศยกเลิกกฎอัยการศึก และการปรับลดดอกเบี้ยนโยบายครั้งที่ 3 แต่มีปัจจัยเสี่ยงเข้ามากดดันตลาดได้แก่ การแพร่ระบาดของไวรัส MERS และการประกาศขงแรงกดดันการการบินพลเรือนของไทยด้านความปลอดภัยของสายการบินจากประเทศไทยโดย ICAO ซึ่งกระทบกับอุตสาหกรรมการบินและการท่องเที่ยวของไทย นอกจากนี้ยังมีปัจจัยจากต่างประเทศเข้ามากระทบได้แก่ ปัญหาเรื่องความไม่สามารรถในการชำระหนี้ของประเทศกรีซ และตลาดหุ้นเอเชียโดยเฉพาะตลาดหุ้นจีน ที่เผชิญแรงขายทำกำไรอย่างหนัก

แนวโน้มตลาดหุ้นในครึ่งปีหลังคาดว่าจะปรับตัวผันผวนที่สลับกันจากปัจจัยทั้งด้านบวกและด้านลบ โดยมีปัจจัยบวกจากความคืบหน้าในการดำเนินแผนการลงทุนโครงสร้างพื้นฐานของประเทศ และการประมูลใบอนุญาตให้ใช้คลื่นความถี่ที่จะเป็นปัจจัยบวกต่อกลุ่มสื่อสารในไตรมาสที่ 4 อย่างไรก็ตามปัจจัยเสี่ยงที่จะกดดันตลาดได้แก่ ความกังวลเกี่ยวกับการปรับขึ้นอัตราดอกเบี้ยนโยบายของธนาคารกลางสหรัฐ (Fed) ปัญหาความสามารถในการชำระหนี้ของประเทศกรีซที่ยังไม่ได้ข้อสรุป ปัญหาภัยแล้งภายในประเทศซึ่งคาดว่าจะส่งผลกระทบต่อเศรษฐกิจภายในประเทศ ซึ่งอาจจะทำให้ต้องปรับลดประมาณการการเติบโตทางเศรษฐกิจ และ กำไรของบริษัทจดทะเบียนลงอีกกระลอกหนึ่ง

สุดท้ายนี้ บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด ขอขอบคุณผู้ถือหน่วยทุกท่าน ที่ให้การส่งเสริมและสนับสนุนด้วยดีมาโดยตลอด

ความเห็นของผู้ดูแลผลประโยชน์

เรียน ผู้ถือหน่วยลงทุน กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ เซ็ท อินดีกซ์ ฟันด์

ข้าพเจ้า บมจ. ธนาคารกสิกรไทย ในฐานะผู้ดูแลผลประโยชน์ ได้ดูแลการจัดการ กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ เซ็ท อินดีกซ์ ฟันด์ ซึ่งจัดการ โดยบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด สำหรับระยะเวลา ตั้งแต่วันที่ 1 กุมภาพันธ์ พ.ศ. 2558 ถึงวันที่ 31 กรกฎาคม พ.ศ. 2558 แล้ว

ข้าพเจ้าเห็นว่า บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด ได้ปฏิบัติหน้าที่ ในการจัดการ กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ เซ็ท อินดีกซ์ ฟันด์ เหมาะสมตามสมควรแห่งวัตถุประสงค์ ที่ได้กำหนดไว้ใน โครงการและภายใต้พระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535

ผู้ดูแลผลประโยชน์

บมจ. ธนาคารกสิกรไทย



(นายเอกพัฒน์ กมลวณิช)

ผู้ช่วยผู้อำนวยการ ฝ่ายบริการธุรกิจหลักทรัพย์



(นางสาวกิติ ปาละสมิทธิ์)

ผู้ช่วยผู้อำนวยการ ฝ่ายบริการธุรกิจหลักทรัพย์

วันที่ 11 สิงหาคม พ.ศ. 2558

ผลการดำเนินงาน
ข้อมูล ณ วันที่ 31 กรกฎาคม 2558

ผลตอบแทนจากการลงทุน	ย้อนหลัง 3 เดือน 30 เม.ย. 58 - 31 ก.ค. 58	ย้อนหลัง 6 เดือน 30 ม.ค. 58 - 31 ก.ค. 58	ย้อนหลัง 1 ปี 31 ก.ค. 57 - 31 ก.ค. 58	ย้อนหลัง 3 ปี 31 ก.ค. 55 - 31 ก.ค. 58	นับแต่จัดตั้ง กองทุน 20 ต.ค. 39 - 31 ก.ค. 58
กองทุน SCBSET	-5.77%	-8.05%	-3.85%	+8.56%	+3.63%
SET Index	-5.67%	-8.93%	-4.14%	+6.69%	+1.82%
SET TRI	-5.42%	-7.18%	-1.22%	+10.80%	n.a.

หมายเหตุ : เอกสารการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวมฉบับนี้ ได้จัดทำขึ้นตามมาตรฐานการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวมของสมาคมบริษัทจัดการลงทุน

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด
กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ เซ็ท อินเด็กซ์ ฟันด์
รายละเอียดหลักทรัพย์ และสัดส่วนการลงทุน
ณ. วันที่ 31 ก.ค. 2558

ชื่อหลักทรัพย์	ราคา ณ 31 ก.ค. 2558 (บาท)	จำนวนหุ้น (หุ้น)	มูลค่า ตามราคาตลาด (บาท)	ร้อยละของมูลค่า ทรัพย์สินสุทธิ (%)	ถ้าประกัน/รับรอง/รับอาวัล หรือสลักหลังโอน แบบมีสิทธิไต่เบี่ย
เงินฝากธนาคาร			323,422,725.40	5.14%	
ธนาคารกสิกรไทย จำกัด (มหาชน) (KBANK)			323,422,725.40	5.14%	
หุ้นจดทะเบียน			5,977,670,802.41	94.96%	
ธุรกิจการเกษตร			19,332,060.00	0.31%	
บมจ.จีเอฟพีที (GFPT)	9.85	921,800.00	9,079,730.00	0.14%	
บมจ.ศรีตรังแอโกรอินดัสทรี (STA)	12.10	847,300.00	10,252,330.00	0.16%	
ยานยนต์			36,560,256.00	0.58%	
บมจ.อีโนเว รับเบอร์ (ประเทศไทย) (IRC)	16.50	733,000.00	12,094,500.00	0.19%	
บมจ.สมบูรณ์ แอ็ควานซ์ เทคโนโลยี่ (SAT)	16.80	752,045.00	12,634,356.00	0.20%	
บมจ.ไทยสแตนเลย์-การไฟฟ้า (STANLY)	189.00	62,600.00	11,831,400.00	0.19%	
ธนาคาร			921,617,641.74	14.64%	
ธนาคารกรุงศรีอยุธยา จำกัด (มหาชน) (BAY)	31.75	3,470,500.00	110,188,375.00	1.75%	
ธนาคารกรุงเทพ จำกัด (มหาชน) (BBL)	166.00	852,000.00	141,432,000.00	2.25%	
ธนาคาร ซีไอเอ็มบี ไทย จำกัด (มหาชน) (CIMBT)	1.68	9,416,184.00	15,819,189.12	0.25%	
ธนาคารกสิกรไทย จำกัด (มหาชน) (KBANK)	178.00	1,106,400.00	196,939,200.00	3.13%	
ธนาคารเกียรตินาคิน จำกัด (มหาชน) (KKP)	30.50	365,300.00	11,141,650.00	0.18%	
ธนาคารกรุงไทย จำกัด (มหาชน) (KTB)	17.50	6,355,400.00	111,219,500.00	1.77%	
บริษัท แอล เอช ไฟแนนซ์เชียล กรุ๊ป จำกัด (มหาชน) (LHBANK)	1.74	7,899,645.00	13,745,382.30	0.22%	
ธนาคารไทยพาณิชย์ จำกัด (มหาชน) (SCB)	152.00	1,547,000.00	235,144,000.00	3.74%	
บมจ.ทุนธนาชาติ (TCAP)	31.25	582,000.00	18,187,500.00	0.29%	
บมจ.ทีสโก้ไฟแนนเชียลกรุ๊ป (TISCO)	42.50	388,700.00	16,519,750.00	0.26%	
ธนาคารทหารไทย จำกัด (มหาชน) (TMB)	2.34	21,914,998.00	51,281,095.32	0.81%	
พาณิชย์			516,748,434.00	8.21%	
บมจ.บี&ซี ซูเปอร์เซ็นเตอร์ (BIGC)	183.50	398,500.00	73,124,750.00	1.16%	
บมจ.เบอร์ลี่ ยุคเกอร์ (BJC)	33.25	916,600.00	30,476,950.00	0.48%	
บมจ. ซีพี ออลล์ จำกัด (CPALL)	48.00	4,120,100.00	197,764,800.00	3.14%	
บริษัท สยามโกลบอลเฮ้าส์ จำกัด (มหาชน) (GLOBAL)	8.10	3,138,960.00	25,425,576.00	0.40%	
บมจ.โฮม โปรดักส์ เซ็นเตอร์ (HMPRO)	6.25	7,139,822.00	44,623,887.50	0.71%	
บมจ.สยามแม็คโคร (MAKRO)	38.50	2,323,900.00	89,470,150.00	1.42%	
บมจ.ห้างสรรพสินค้าโรบินสัน (ROBINS)	42.50	720,900.00	30,638,250.00	0.49%	
บมจ.สหพัฒน์พิบูล (SPC)	41.75	306,966.00	12,815,830.50	0.20%	
บมจ.สหพัฒนาอินเตอร์โฮลดิ้ง (SPI)	24.60	504,400.00	12,408,240.00	0.20%	
เทคโนโลยีสารสนเทศและการสื่อสาร			758,492,681.75	12.05%	
บมจ. แอดวานซ์ อินโฟร์ เซอร์วิส (ADVANC)	250.00	1,358,500.00	339,625,000.00	5.40%	
บริษัท โทเทิล แอ็คเซ็ส คอมมูนิเคชั่น จำกัด (มหาชน) (DTAC)	70.25	1,081,495.00	75,975,023.75	1.21%	
บมจ.อินทัช โฮลดิ้งส์ (INTUCH)	81.75	1,491,000.00	121,889,250.00	1.94%	
บมจ.จัสมิน อินเทอร์เน็ตจันแนล (JAS)	5.00	5,688,700.00	28,443,500.00	0.45%	
บมจ.สามารคคอร์ปอเรชั่น (SAMART)	20.60	944,700.00	19,460,820.00	0.31%	

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด
กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ เซ็ท อินเด็กซ์ ฟันด์
รายละเอียดหลักทรัพย์ และสัดส่วนการลงทุน
ณ. วันที่ 31 ก.ค. 2558

ชื่อหลักทรัพย์	ราคา ณ 31 ก.ค. 2558 (บาท)	จำนวนหุ้น (หุ้น)	มูลค่า ตามราคาตลาด (บาท)	ร้อยละของมูลค่า ทรัพย์สินสุทธิ (%)	ค่าประกัน/รับรอง/รับอาวัล หรือสลักหลังโอน แบบมีสิทธิไต่เบี่ย
บมจ.สามารท ไอ-โมบาย (SIM)	1.74	4,284,200.00	7,454,508.00	0.12%	
บมจ.ไทยคม (THCOM)	36.25	868,800.00	31,494,000.00	0.50%	
บมจ.ทรู คอร์ปอเรชั่น (TRUE)	10.80	12,421,350.00	134,150,580.00	2.13%	
วัสดุก่อสร้าง			439,270,121.40	6.98%	
บมจ.ไดนาสดีเซรามิก (DCC)	3.72	3,841,920.00	14,291,942.40	0.23%	
บมจ.ปูนซิเมนต์ไทย (SCC)	526.00	546,900.00	287,669,400.00	4.57%	
บมจ.ปูนซิเมนต์นครหลวง (SCCC)	366.00	106,100.00	38,832,600.00	0.62%	
บริษัท ซูเปอร์บล็อท จำกัด (มหาชน) (SUPER)	1.41	19,930,800.00	28,102,428.00	0.45%	
บมจ.ทีปโก้แอสฟัลท์ (TASCO)	24.40	1,194,280.00	29,140,432.00	0.46%	
บมจ.ทีพีไอ โพลีน (TPIPL)	2.32	13,160,200.00	30,531,664.00	0.49%	
บมจ.สหโมเสกอุตสาหกรรม (UMI)	6.35	1,685,300.00	10,701,655.00	0.17%	
บริการรับเหมาก่อสร้าง			128,616,807.90	2.04%	
บมจ.ช.การช่าง (CK)	26.00	1,216,205.00	31,621,330.00	0.50%	
บมจ.อิตาเลียนไทย ดีเวล๊อปเมนต์ (ITD)	7.35	4,370,275.00	32,121,521.25	0.51%	
บมจ.ซีโน-ไทย เอ็นจิเนียริงแอนด์คอนสตรัคชั่น (STEC)	23.10	1,307,785.00	30,209,833.50	0.48%	
บมจ.เอสทีพี แอนด์ ไอ (STPI)	14.90	1,297,231.00	19,328,741.90	0.31%	
บริษัท โตโย-ไทย คอร์ปอเรชั่น จำกัด (มหาชน) (TTCL)	29.75	515,475.00	15,335,381.25	0.24%	
ชิ้นส่วนอิเล็กทรอนิกส์			97,464,043.58	1.55%	
บมจ.แกลด-คอมพ์ อิเล็กทรอนิกส์ (ประเทศไทย) (CCET)	3.26	3,321,633.00	10,828,523.58	0.17%	
บมจ.เดลต้า อิเล็กทรอนิกส์ (ประเทศไทย) (DELTA)	80.50	610,840.00	49,172,620.00	0.78%	
บมจ.ฮานา ไมโครอิเล็กทรอนิกส์ (HANA)	32.50	547,200.00	17,784,000.00	0.28%	
บมจ.เคซีอี อิเล็กทรอนิกส์ (KCE)	53.00	371,300.00	19,678,900.00	0.31%	
พลังงานและสาธารณูปโภค			986,639,391.40	15.67%	
บมจ.บ้านปู (BANPU)	25.00	1,251,300.00	31,282,500.00	0.50%	
บมจ.บางจากปิโตรเลียม (BCP)	34.25	931,400.00	31,900,450.00	0.51%	
บมจ.จัดการและพัฒนาทรัพยากรน้ำภาคตะวันออก (EASTW)	11.50	1,318,100.00	15,158,150.00	0.24%	
บริษัท ผลิตไฟฟ้า จำกัด (มหาชน) (EGCO)	153.50	211,800.00	32,511,300.00	0.52%	
บมจ.เอสโซ่ (ประเทศไทย) (ESSO)	5.30	2,557,500.00	13,554,750.00	0.22%	
บมจ.โกลว์ พลังงาน (GLOW)	89.25	661,100.00	59,003,175.00	0.94%	
บมจ. กันกุลเอ็นจิเนียริง (GUNKUL)	21.40	1,340,941.00	28,696,137.40	0.46%	
บมจ.ไออาร์พีซี (IRPC)	4.20	12,966,500.00	54,459,300.00	0.87%	
บมจ.ปตท. (PTT)	326.00	1,314,100.00	428,396,600.00	6.81%	
บมจ.ปตท.สำรวจและผลิตปิโตรเลียม (PTTEP)	93.50	1,710,824.00	159,962,044.00	2.54%	
บมจ.ผลิตไฟฟ้าราชบุรีโฮลดิ้ง (RATCH)	53.75	600,500.00	32,276,875.00	0.51%	
บมจ.เอสพีซีจี (SPCG)	24.40	928,400.00	22,652,960.00	0.36%	
บมจ.ไทยอยล์ (TOP)	48.25	1,138,600.00	54,937,450.00	0.87%	

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด
กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ เซ็ท อินเด็กซ์ ฟันด์
รายละเอียดหลักทรัพย์ และสัดส่วนการลงทุน
ณ. วันที่ 31 ก.ค. 2558

ชื่อหลักทรัพย์	ราคา ณ 31 ก.ค. 2558 (บาท)	จำนวนหุ้น (หุ้น)	มูลค่า ตามราคาตลาด (บาท)	ร้อยละของมูลค่า ทรัพย์สินสุทธิ (%)	ค่าประกัน/รับรอง/รับอาวัล หรือสลักหลังโอน แบบมีสิทธิไต่เบี่ย
บมจ.ทีทีดับบลิว (TTW)	11.50	1,899,800.00	21,847,700.00	0.35%	
แฟชั่น			7,286,400.00	0.12%	
บมจ.ซาบิน่า (SABINA)	23.00	316,800.00	7,286,400.00	0.12%	
เงินทุนและหลักทรัพย์			94,090,949.00	1.49%	
บมจ.อออน ธนสินทรัพย์ (ไทยแลนด์) (AEONTS)	88.00	219,700.00	19,333,600.00	0.31%	
บมจ.เงินทุนธนสยาม (DS)		19,800.00	0.00	0.00%	
บมจ.เงินทุนเอกชนกิจ (FIN1)		10,600.00	0.00	0.00%	
บมจ.หลักทรัพย์ เมย์แบงก์ กิมเอ็ง (ประเทศไทย) (MBKET)	23.30	749,900.00	17,472,670.00	0.28%	
บริษัท เมืองไทย ลิสซิ่ง จำกัด (มหาชน) (MTLS)	19.20	1,425,200.00	27,363,840.00	0.43%	
บมจ.ศรีสวัสดิ์ พาวเวอร์ 1979 (SAWAD)	37.25	803,244.00	29,920,839.00	0.48%	
บมจ.เงินทุนหลักทรัพย์ซิทกา (SITCA)		13,000.00	0.00	0.00%	
อาหารและเครื่องดื่ม			305,342,225.00	4.85%	
บริษัท คาราบาวกรุ๊ป จำกัด (มหาชน) (CBG)	37.00	703,500.00	26,029,500.00	0.41%	
บมจ.เจริญโภคภัณฑ์อาหาร (CPF)	20.90	3,289,100.00	68,742,190.00	1.09%	
บมจ.น้ำตาลขอนแก่น (KSL)	3.98	2,824,320.00	11,240,793.60	0.18%	
บมจ.เกษตรไทย อินเตอร์เนชั่นแนล ซุการ์ คอร์ปอเรชั่น (KTIS)	8.00	2,594,700.00	20,757,600.00	0.33%	
บมจ.เอ็มเค เรสโตรองต์ กรุ๊ป (M)	56.50	484,600.00	27,379,900.00	0.43%	
บมจ.ไมเนอร์ อินเตอร์เนชั่นแนล (MINT)	29.25	2,162,958.00	63,266,521.50	1.01%	
บมจ.โออิชิ กรุ๊ป (OISHI)	72.00	123,900.00	8,920,800.00	0.14%	
บมจ.ไทยเพริคเคินท์ฟูลด์ (TF)	156.00	116,100.00	18,111,600.00	0.29%	
บมจ.ไทยยูเนี่ยน โฟรเซ่น โปรดักส์ (TUF)	18.90	2,296,216.00	43,398,482.40	0.69%	
บมจ.น้ำมันพืชไทย (TVO)	24.50	714,075.00	17,494,837.50	0.28%	
การแพทย์			267,119,647.50	4.24%	
บมจ. บางกอก เชน ฮอสปิเทล (BCH)	6.85	2,472,450.00	16,936,282.50	0.27%	
บมจ.กรุงเทพดุสิตเวชการ (BDMS)	20.10	7,084,200.00	142,392,420.00	2.26%	
บมจ.โรงพยาบาลบำรุงราษฎร์ (BH)	204.00	395,700.00	80,722,800.00	1.28%	
บริษัท โรงพยาบาลจุฬารัตน์ จำกัด (มหาชน) (CHG)	1.95	13,881,100.00	27,068,145.00	0.43%	
ของใช้ในครัวเรือนและสำนักงาน			15,238,498.00	0.24%	
บมจ.ศรีไทยซูเปอร์แวร์ (SITHAI)	2.42	6,296,900.00	15,238,498.00	0.24%	
ประกันภัยและประกันชีวิต			95,508,418.40	1.52%	
บมจ.กรุงเทพประกันภัย (BKI)	366.00	74,449.00	27,248,334.00	0.43%	
บริษัท กรุงเทพประกันชีวิต จำกัด (มหาชน) (BLA)	49.00	1,035,180.00	50,723,820.00	0.81%	
บมจ.ไทยรับประกันภัยต่อ (THRE)	2.92	6,005,570.00	17,536,264.40	0.28%	
สื่อและสิ่งพิมพ์			92,368,820.60	1.47%	
บมจ.บีอีซี เวิลด์ (BEC)	36.00	1,061,100.00	38,199,600.00	0.61%	
บมจ.ไอทีวี (ITV)		585,200.00	0.00	0.00%	
บมจ.เมเจอร์ ซินีเพล็กซ์ กรุ๊ป (MAJOR)	32.75	741,700.00	24,290,675.00	0.39%	
บมจ.วีจี ไอ โกลบอล มีเดีย (VGI)	4.60	6,495,336.00	29,878,545.60	0.47%	

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด
 กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ เซ็ท อินดีกซ์ ฟันด์
 รายละเอียดหลักทรัพย์ และสัดส่วนการลงทุน
 ณ. วันที่ 31 ก.ค. 2558

ชื่อหลักทรัพย์	ราคา ณ 31 ก.ค. 2558 (บาท)	จำนวนหุ้น (หุ้น)	มูลค่า ตามราคาตลาด (บาท)	ร้อยละของมูลค่า ทรัพย์สินสุทธิ (%)	ค่าประกัน/รับรอง/รับอาวัล หรือสลักหลังโอน แบบมีสิทธิไต่เบี่ยง
เหมืองแร่			13,667,200.00	0.22%	
บมจ.ผาแดงอินดัสทรี (PDI)	16.00	854,200.00	13,667,200.00	0.22%	
บรรจภัณฑ์			8,576,640.00	0.14%	
บมจ. โพลีเพล็กซ์ (ประเทศไทย) (PTL)	9.60	893,400.00	8,576,640.00	0.14%	
ปิโตรเคมีและเคมีภัณฑ์			194,232,023.00	3.09%	
บมจ. อินโดรามา เวนเจอร์ส (IVL)	26.50	2,268,500.00	60,115,250.00	0.96%	
บมจ.พีทีที โกลบอล เคมีคอล (PTTGC)	61.75	2,029,836.00	125,342,373.00	1.99%	
บมจ.ไทยเซ็นทรัลเคมี (TCCC)	24.00	365,600.00	8,774,400.00	0.14%	
พัฒนาอสังหาริมทรัพย์			539,578,067.74	8.57%	
บมจ.อมตะ คอร์ปอเรชั่น (AMATA)	14.10	1,122,400.00	15,825,840.00	0.25%	
บมจ.เอพี (ไทยแลนด์) (AP)	5.90	3,076,156.00	18,149,320.40	0.29%	
บมจ.บางกอกแลนด์ (BLAND)	1.46	22,700,200.00	33,142,292.00	0.53%	
บมจ.เซ็นทรัลพัฒนา (CPN)	47.25	2,922,800.00	138,102,300.00	2.19%	
บมจ.แลนด์แอนด์เฮาส์ (LH)	7.95	6,134,920.00	48,772,614.00	0.77%	
บมจ.แอล.พี.เอ็น. ดีเวลลอปเม้นท์ (LPN)	17.70	1,283,100.00	22,710,870.00	0.36%	
บมจ.เอ็ม บี เค (MBK)	14.20	1,283,400.00	18,224,280.00	0.29%	
บมจ.พญาบุรุษ ธิยาสถา (PS)	24.10	1,372,100.00	33,067,610.00	0.53%	
บมจ.ควอลิตี้เฮาส์ (QH)	2.32	8,725,895.00	20,244,076.40	0.32%	
บมจ.สวนอุตสาหกรรมโรจนะ (ROJNA)	6.10	2,364,329.00	14,422,406.90	0.23%	
บริษัท สิงห์ เอสเตท จำกัด (มหาชน) (S)	5.90	5,289,100.00	31,205,690.00	0.50%	
บริษัท สิงห์ เอสเตท จำกัด (มหาชน) (S/R)	5.90	616,350.00	3,636,465.00	0.06%	
บมจ.เอสซี แอสเสท คอร์ปอเรชั่น (SC)	3.14	5,229,190.00	16,419,656.60	0.26%	
บมจ.แสนสิริ (SIRI)	1.72	12,696,377.00	21,837,768.44	0.35%	
บมจ.สุภาลัย (SPALI)	17.10	1,348,100.00	23,052,510.00	0.37%	
บมจ.ไทยพัฒนาโรงงานอุตสาหกรรม (TFD)	3.44	3,893,600.00	13,393,984.00	0.21%	
บมจ.ไทคอน อินดัสเทรียล คอนเน็คชั่น (TICON)	12.60	1,149,400.00	14,482,440.00	0.23%	
บมจ.ยูนิ เวนเจอร์ (UV)	6.35	2,767,000.00	17,570,450.00	0.28%	
บมจ. ดับบลิวเอชเอ คอร์ปอเรชั่น (WHA)	3.72	9,493,950.00	35,317,494.00	0.56%	
การท่องเที่ยวและสันทนาการ			61,086,910.00	0.97%	
บมจ. โรงแรมเซ็นทรัลพลาซา (CENTEL)	37.25	909,200.00	33,867,700.00	0.54%	
บมจ.ดิ เอราวัณ กรุ๊ป (ERW)	3.90	3,158,900.00	12,319,710.00	0.20%	
บมจ.โอเอชทีแอล (OHTL)	990.00	15,050.00	14,899,500.00	0.24%	
ขนส่งและโลจิสติกส์			377,675,448.60	6.00%	
บมจ. เอเชีย เอวิเอชั่น (AAV)	4.88	4,400,900.00	21,476,392.00	0.34%	
บมจ.ท่าอากาศยานไทย (AOT)	294.00	696,400.00	204,741,600.00	3.25%	
บมจ.ทางด่วนกรุงเทพ (BECL)	38.00	427,900.00	16,260,200.00	0.26%	
บมจ.รถไฟฟ้ากรุงเทพ (BMCL)	1.85	16,794,700.00	31,070,195.00	0.49%	
บริษัท บีทีเอส กรุ๊ป โฮลดิ้งส์ จำกัด (มหาชน) (BTS)	9.85	5,998,456.00	59,084,791.60	0.94%	
บมจ.พีริเชียส ชิฟฟ์ (PSL)	8.35	1,167,050.00	9,744,867.50	0.15%	
บมจ.อาร์ ซี แอล (RCL)	8.55	1,975,800.00	16,893,090.00	0.27%	

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด
 กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ เซ็ท อินเด็กซ์ ฟันด์
 รายละเอียดหลักทรัพย์ และสัดส่วนการลงทุน
 ณ. วันที่ 31 ก.ค. 2558

ชื่อหลักทรัพย์	ราคา ณ 31 ก.ค. 2558 (บาท)	จำนวนหุ้น (หุ้น)	มูลค่า ตามราคาตลาด (บาท)	ร้อยละของมูลค่า ทรัพย์สินสุทธิ (%)	ค้าประกัน/รับรอง/รับอาวัล หรือสลักหลัง โอน แบบมีสิทธิไต่เบี่ย
บมจ.การบินไทย (THAI)	12.50	1,472,345.00	18,404,312.50	0.29%	
ใบสำคัญแสดงสิทธิ			1,158,116.80	0.02%	
บมจ.ศรีสวัสดิ์ พาวเวอร์ 1979 (SAWAD-W1)	8.80	2,731.00	24,032.80	0.00%	
บริษัท สิงห์ เอสเตท จำกัด (มหาชน) (S-W1)	0.92	1,232,700.00	1,134,084.00	0.02%	
รวมหลักทรัพย์ประเภทหุ้น			5,977,670,802.41	94.96%	
เงินฝากธนาคาร			1,115,094.80	0.02%	
ธนาคาร ยูโอบี จำกัด (มหาชน) (UOBT)			1,115,094.80	0.02%	
สินทรัพย์อื่น ๆ			8,134,287.28	0.13%	
หนี้สิน			-15,588,648.02	-0.25%	
มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ			6,294,754,261.87	100.00%	
มูลค่าหน่วยลงทุน (บาท)				16.8789	

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด
 กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ เซ็ท อินดีกซ์ ฟันด์
 รายงานสรุปเงินลงทุน
 ณ วันที่ 31 กรกฎาคม 2558

กลุ่มของตราสาร	มูลค่าตามราคาตลาด	%NAV
(ก) ตราสารภาครัฐ ได้แก่ ตัวแลกเงิน พันธบัตรรัฐบาล พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย พันธบัตร หรือตราสารแห่งหนึ่งที่กองทุนเพื่อการฟื้นฟูและพัฒนาสถาบันการเงิน หรือกระทรวงการคลัง เป็นผู้ออก ผู้รับรอง ผู้รับอาวัล หรือผู้ค้ำประกัน	-	-
(ข) ตราสารที่ธนาคารที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้น ธนาคารพาณิชย์ หรือบริษัทเงินทุนเป็นผู้ออก ผู้รับรอง ผู้รับอาวัล ผู้สละหลัก หรือผู้ค้ำประกัน	324,742,965.70	5.16
(ค) ตราสารที่มีบริษัทที่ได้รับ rating ในระดับ investment grade เป็นผู้ออก ผู้รับรอง ผู้รับอาวัล ผู้สละหลัก หรือผู้ค้ำประกัน	-	-
(ง) ตราสารที่มีบริษัทที่ได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือในระดับที่ต่ำกว่า investment grade หรือไม่มี rating เป็นผู้ออก ผู้รับรอง ผู้รับอาวัล ผู้สละหลัก หรือผู้ค้ำประกัน	-	-

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

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนไทยพาณิชย์ จำกัด
 กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ เซ็ท อินดีกซ์ ฟันด์
 รายละเอียดตัวตราสารและอันดับความน่าเชื่อถือของตราสารทุกตัวใน Port
 ณ วันที่ 31 กรกฎาคม 2558

ประเภท	ผู้ออก	ผู้รับ/ผู้รับรอง/ผู้จัดหลักหนี้	วันครบกำหนด	อันดับความน่าเชื่อถือของผู้ออกตราสาร		มูลค่าหน้าตั๋ว	มูลค่าตามราคาตลาด
				TRIS Rating	FITCH Rating		
เงินฝากธนาคาร	ธนาคาร ยูโอบี จำกัด (มหาชน)				AAA(tha)	1,115,094.80	1,116,041.87

กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ เซ็ท อินเด็กซ์ ฟันด์

SCB SET INDEX OPEN-ENDED FUND

แบบค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม

FUND'S DIRECT EXPENSES REPORT

ตั้งแต่วันที่ 01 กุมภาพันธ์ 2558 ถึงวันที่ 31 กรกฎาคม 2558

Period from 01 February 2015 to 31 July 2015

ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม *	จำนวนเงิน หน่วย : พันบาท	ร้อยละต่อปีของ มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ
Fund's direct expenses		
ค่าธรรมเนียมการจัดการ (Management fee)	29,329	0.99
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ (Trustee fee)	948	0.03
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน (Registrar fee)	-	-
ค่าที่ปรึกษาการลงทุน (Advisory fee)	-	-
ค่าใช้จ่ายอื่น ๆ (Other expenses)	380	0.01
รวมค่าใช้จ่ายทั้งหมด (Total Expense) **	30,657	1.03

* ค่าใช้จ่ายดังกล่าวได้รวมภาษีมูลค่าเพิ่มแล้ว / Including VAT

** ไม่รวมค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ และค่าธรรมเนียมต่าง ๆ ที่เกิดขึ้นจากการซื้อขายหลักทรัพย์

Excluding brokerage fee and other transactions fees

กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ เซ็ท อินเด็กซ์ ฟันด์ (SCBSET)

งบดุล

ณ วันที่ 31 กรกฎาคม 2558

	"ยังไม่ได้ตรวจสอบ" "ยังไม่ได้สอบทาน"
	บาท
สินทรัพย์	
เงินลงทุนตามราคายุติธรรม	5,978,785,897.21
เงินสดและเงินฝากธนาคาร	323,422,725.40
ลูกหนี้จากเงินปันผลและดอกเบี้ย	3,906,588.30
ลูกหนี้จากการขายเงินลงทุน	4,068,853.49
ลูกหนี้อื่น	60,908.34
ค่าใช้จ่ายรอตัดบัญชี	97,937.15
รวมสินทรัพย์	6,310,342,909.89
หนี้สิน	
เจ้าหนี้จากการรับซื้อคืนส่วนได้เสีย	9,915,108.10
ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย	5,519,208.86
หนี้สินอื่น	154,331.06
รวมหนี้สิน	15,588,648.02
สินทรัพย์สุทธิ	6,294,754,261.87
สินทรัพย์สุทธิ :-	
ทุนที่ได้รับจากผู้ถือหน่วยลงทุน	3,729,356,928.89
กำไรสะสม	2,438,914,584.04
บัญชีปรับสมดุล	126,482,748.94
สินทรัพย์สุทธิ	6,294,754,261.87
จำนวนหน่วยลงทุนที่จำหน่ายแล้ว (หน่วย)	372,935,692.8892
สินทรัพย์สุทธิต่อหน่วยลงทุน	16.8789

กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ เซ็ท อินเด็กซ์ ฟันด์ (SCBSET)

งบกำไรขาดทุน

รอบระยะเวลาตั้งแต่วันที่ 1 กุมภาพันธ์ 2558 ถึงวันที่ 31 กรกฎาคม 2558

"ยังไม่ได้ตรวจสอบ"

"ยังไม่ได้สอบทาน"

บาท

รายได้จากการลงทุน	
รายได้เงินปันผล	103,405,101.96
รายได้ดอกเบี้ย	741,873.18
รายได้ทั้งสิ้น	104,146,975.14
ค่าใช้จ่าย	
ค่าธรรมเนียมจัดการ	29,328,923.39
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์	947,622.79
ค่าสอบบัญชี	153,230.98
ค่าใช้จ่ายอื่น	227,461.57
ค่าใช้จ่ายทั้งสิ้น	30,657,238.73
รายได้จากการลงทุนสุทธิ	73,489,736.41
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิจากเงินลงทุน	
รายการกำไรสุทธิที่เกิดขึ้นจริง	22,022,788.42
รายการขาดทุนสุทธิที่ยังไม่เกิดขึ้นจริง	(581,009,949.02)
รวมรายการขาดทุนจากการลงทุนที่เกิดขึ้นและที่ยังไม่เกิดขึ้น	(558,987,160.60)
การลดลงในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงาน	(485,497,424.19)

รายงานการซื้อขายหลักทรัพย์และค่าใช้จ่ายต่าง ๆ

VOLUME TRADE AND EXPENSES REPORT

ตั้งแต่วันที่ 1 กุมภาพันธ์ 2558 ถึง วันที่ 31 กรกฎาคม 2558

Period from 1 February 2015 to 31 July 2015

	(พันบาท) / (Thousand Baht)
มูลค่าทรัพย์สินสุทธิเฉลี่ย / Average Net Assets Value	5,952,763
การซื้อขายหลักทรัพย์รวม / Volume Trade	
มูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์รวม	1,761,945
Total Volume Trade	
ค่าธรรมเนียมหน้าในการซื้อขายหลักทรัพย์รวม	1,480
Total Brokerage Fee	
ค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายอื่น ๆ รวม / Fee and other Expenses	30,657
	(ร้อยละ) / (Percentage)
สัดส่วนค่าธรรมเนียมหน้าในการซื้อขายหลักทรัพย์รวมคิดเป็นร้อยละของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์รวม	0.08
Brokerage Fee as Percentage of Total Trading Volume	
สัดส่วนค่าธรรมเนียมหน้าในการซื้อขายหลักทรัพย์รวมคิดเป็นร้อยละของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิเฉลี่ย	0.05
Brokerage Fee as Percentage of Average Net Assets Value	
สัดส่วนค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายอื่น ๆ รวมคิดเป็นร้อยละของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิเฉลี่ย	1.03
Fee and other Expenses as Percentage of Average Net Assets Value	
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุนของกองทุนรวม (PTR)	0.05
Portfolio Turnover Ratio (PTR)	

รายงานรายชื่อบริษัทนายหน้า และค่าธรรมเนียม ซื้อ-ขาย หลักทรัพย์
ของกองทุนเปิดไทยพาณิชย์ เซ็ท อินเด็กซ์ ฟันด์
ระหว่างวันที่ 1 กุมภาพันธ์ 2558 ถึง 31 กรกฎาคม 2558

ลำดับที่	ชื่อบริษัทนายหน้า	ค่านายหน้า (พันบาท)	อัตราส่วนค่านายหน้าแต่ละราย ต่อค่านายหน้าทั้งหมด
1	บริษัทหลักทรัพย์ ไทยพาณิชย์ จำกัด	829.02	56.03%
2	บมจ.หลักทรัพย์ เคจีไอ (ประเทศไทย)	628.14	42.45%
3	บมจ.หลักทรัพย์ เอเชีย พลัส	22.45	1.52%
รวม		1,479.61	100.00%

การรับผลประโยชน์ตอบแทนเนื่องจากการที่กองทุนให้บริการบุคคลอื่น ประจำปีงบการเงินกุมภาพันธ์ 2558
BENEFIT FROM BROKERAGE SERVICES AS OF JULY 2015

บริษัทที่ให้บริการ	BROKERAGE HOUSES	ผลประโยชน์ที่ได้รับ					
		บทวิเคราะห์ Research Paper	ข้อมูลพื้นฐาน Fundamental Data	รายงานสรุปข่าว News Summary	สัมมนา Seminar	บรรยายกลยุทธ์การลงทุน Strategy Presentation	เยี่ยมชมบริษัท Company Visit
บริษัทหลักทรัพย์ เอเชีย พลัส จำกัด	ASIA PLUS SECURITIES COMPANY LIMITED	✓	✓	✓		✓	✓
บริษัทหลักทรัพย์ บัวหลวง จำกัด (มหาชน)	BUALUANG SECURITIES PUBLIC COMPANY LIMITED	✓	✓	✓		✓	
บริษัทหลักทรัพย์ ซี แอส เอช (ประเทศไทย) จำกัด	CSA SECURITIES (THAILAND) LIMITED	✓	✓	✓	✓	✓	
บริษัทหลักทรัพย์ โคมินิตี้ จำกัด (มหาชน)	CAPITAL NOMURA SECURITIES PUBLIC COMPANY LIMITED	✓	✓	✓		✓	✓
บริษัทหลักทรัพย์เครดิต แอส (ประเทศไทย) จำกัด	CREDIT SUISSE SECURITIES (THAILAND) LIMITED	✓	✓	✓		✓	
บริษัทหลักทรัพย์ เคเอ็มบีเคเอ็ม (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)	MAYBANK KIM ENG SECURITIES (THAILAND) PUBLIC COMPANY LIMITED	✓	✓	✓		✓	
บริษัทหลักทรัพย์ เคเอ็มเคเอ็ม จำกัด (มหาชน)	KASIKORN SECURITIES PUBLIC COMPANY LIMITED	✓	✓	✓	✓	✓	✓
บริษัทหลักทรัพย์ ฟิตเร จำกัด (มหาชน)	PHATRA SECURITIES PUBLIC COMPANY LIMITED	✓	✓	✓		✓	
บริษัทหลักทรัพย์ ไทยพาณิชย์ จำกัด	SCB SECURITIES COMPANY LIMITED	✓	✓	✓	✓	✓	✓
บริษัทหลักทรัพย์ธนชาต จำกัด (มหาชน)	THANACHART SECURITIES PUBLIC COMPANY LIMITED	✓	✓	✓	✓	✓	✓
บริษัทหลักทรัพย์ ทีเอสไอ จำกัด	TISCO SECURITIES COMPANY LIMITED	✓	✓	✓		✓	✓
บริษัทหลักทรัพย์ ซีไอเอ็มอี (ประเทศไทย) จำกัด	CMB SECURITIES (THAILAND) CO., LTD	✓	✓	✓		✓	
บริษัทหลักทรัพย์ ยูนิลีด (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 วิคเคอร์ส (ประเทศไทย) จำกัด	DBS VICKERS SECURITIES (THAILAND) COMPANY LIMITED	✓	✓	✓		✓	✓
บริษัทหลักทรัพย์ อีเอสเคเอ็ม (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)	ESB OSE SECURITIES (THAILAND) PUBLIC COMPANY LIMITED	✓	✓	✓		✓	
บริษัทหลักทรัพย์ ยูเคอี เคเอ็มบีเคเอ็ม (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)	UOB KAYHIAN SECURITIES (THAILAND) PUBLIC COMPANY LIMITED	✓	✓	✓		✓	

- “ผลประโยชน์ที่ได้รับ SERVICES
1. บทวิเคราะห์ (จากบริษัทหลักทรัพย์หลายราย, รายงาน, รายไตรมาส) Analysis Report (Market Summary and Companies' updated analysis on daily, monthly and quarterly basis)
 2. ข้อมูลพื้นฐาน (ข้อมูลตลาด, บทการเงิน, บอ, ข้อมูลเชิง) (Fundamental Data (Market and historical financial data of listed companies))
 3. รายงานสรุปข่าวรายวัน และคิดค่าผ่านผ่าน ผ่าน SMS (Daily news summary and report news via SMS)
 4. จัดสัมมนาหรือจัดประชุมเชิงสัมมนา (Arrangement of Seminar on Economics or Industries Issues)
 5. บรรยายกลยุทธ์การลงทุนรายไตรมาส (Strategy Presentation on quarterly basis)
 6. จัดเยี่ยมชมบริษัทที่ลงทุนในกองทุน (Company Visit arrangement to companies of interest)

ข้อมูลการดำเนินการจัดกิจกรรมอื่นที่ประจักษ์ชัดอยู่ในนามกองทุนรวมจะขอเป็นปฏิทินข้อมูล
สามารถตรวจสอบข้อมูลได้จาก Website : www.scbsm.com