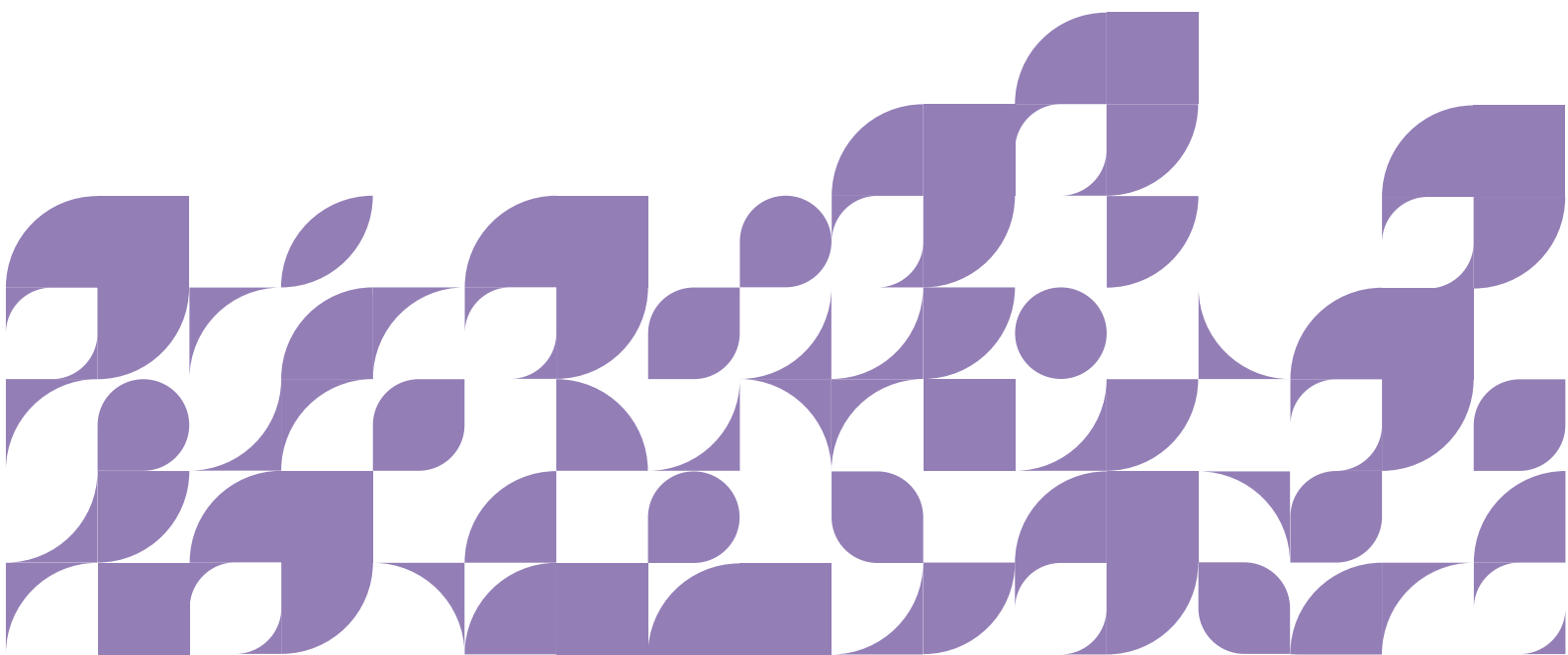




# กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ เซิท อินเวสท์ ฟันด์ (SCBSET)

ร าย ง า น ป ร ะ จ ำ 6 เดือน  
วันที่ 1 กุมภาพันธ์ 2555 ถึงวันที่ 31 กรกฎาคม 2555



## สารสนเทศจากบริษัทจัดการ

### เรียน ท่านผู้ถือหน่วยลงทุน

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด ในฐานะบริษัทจัดการกองทุนเปิดไทยพาณิชย์เซ็ทอินเด็กซ์ฟันด์ (SCBSET) ซึ่งกองทุนนี้เป็นกองทุนที่ลงทุนในหลักทรัพย์จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ ดังนั้นผลตอบแทนโดยรวมของกองทุนจะใกล้เคียงและผันผวนตามดัชนีตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย โดยในรอบบัญชี 6 เดือนตั้งแต่วันที่ 1 กุมภาพันธ์ ถึง 31 กรกฎาคม 2555 ดัชนีตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยปรับตัวขึ้นร้อยละ 10.64 มาปิดที่ 1199.30 จุด ในขณะที่กองทุนให้อัตราผลตอบแทนร้อยละ 11.71

ในช่วงไตรมาสแรกของปี 2555 ดัชนีตลาดหุ้นไทยปรับตัวขึ้นโดยมีปัจจัยสนับสนุนจากแรงซื้อของนักลงทุนต่างชาติ มูลค่าสุทธิรวม 82,770 ล้านบาท หลังจากที่คลายความกังวลเกี่ยวกับวิกฤติหนี้ยุโรป ซึ่งเป็นผลจากการที่ธนาคารกลางยุโรปออกมาตรการปล่อยสินเชื่อดอกเบี้ยต่ำอายุ 36 เดือนให้กับธนาคารพาณิชย์ในยุโรป เพื่อช่วยแก้ไขปัญหาการขาดสภาพคล่อง รวมถึงตัวเลขด้านแรงงานของสหรัฐฯที่แข็งแกร่งมากกว่าคาดการณ์ ส่วนปัจจัยบวกในประเทศ ได้แก่ เหตุการณ์น้ำท่วมคลี่คลายส่งผลให้นักลงทุนคาดการณ์ว่าเศรษฐกิจไทยจะสามารถฟื้นตัวขึ้นได้อย่างรวดเร็ว โดยมีนโยบายของรัฐบาลเป็นปัจจัยสนับสนุน

ในช่วงไตรมาสที่ 2 ของปี 2555 ดัชนีตลาดหุ้นไทยมีความผันผวนสูงโดยแรงขายส่วนใหญ่เกิดขึ้นจากนักลงทุนต่างชาติซึ่งมีมูลค่ารวมกัน 19,228 ล้านบาท ทั้งนี้ ตลาดสามารถปรับตัวเพิ่มขึ้นต่อเนื่องจากไตรมาสที่ 1/55 จนถึงต้นเดือนพฤษภาคม ซึ่งมีปัจจัยหนุนจากตัวเลขการจ้างงานของสหรัฐฯที่ดีเกินคาด อย่างไรก็ตาม ตลาดฯเริ่มผันผวนขึ้นหลังผลการประชุม การประชุมคณะกรรมการนโยบายการเงินของธนาคารกลางสหรัฐฯ (FOMC) ในเดือนเมษายนซึ่งยังคงไม่ออกมาตรการผ่อนคลายทางการเงินครั้งที่ 3 (Quantitative Easing 3: QE3) และจากปัญหาวิกฤติสถาบันการเงินในสเปน จนส่งผลให้รัฐบาลสเปนต้องขอรับเงินช่วยเหลือเพื่อนำมาเพิ่มทุนให้กับธนาคารในวงเงิน 1 แสนล้านยูโร รวมถึงความกังวลว่ากรีซอาจจะต้องออกจากการเป็นสมาชิกของยูโรโซน

สำหรับแนวโน้มตลาดหุ้นไทยครึ่งปีหลังของปี 2555 ปัจจัยสำคัญที่คาดว่าจะมีอิทธิพลอย่างมากต่อการเคลื่อนไหวของตลาดหุ้นไทยได้แก่ เศรษฐกิจจีนที่น่าจะกลับมาขยายตัวอีกครั้งจากมาตรการกระตุ้นเศรษฐกิจ ปัญหาเศรษฐกิจในยุโรปที่คาดว่าจะได้รับการแก้ไข ความคาดหวังเรื่อง QE3 ของสหรัฐฯในการประชุม FOMC อีก 3 ครั้งในปีนี้ และความเสี่ยงทางการเมืองภายในประเทศที่เริ่มลดลง

สุดท้ายนี้ บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด ขอขอบคุณผู้ถือหน่วยทุกท่าน ที่ให้การส่งเสริมและสนับสนุนด้วยดีมาโดยตลอด

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด

### รายงานผู้ดูแลผลประโยชน์

เสนอ ผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุนกองทุนเปิด ไทยพาณิชย์เซ็ท อินเด็กซ์ ฟันด์

ธนาคารซีทีแบงก์ เอ็น.เอ. สาขากรุงเทพฯ ในฐานะผู้ดูแลผลประโยชน์ กองทุนเปิดไทยพาณิชย์เซ็ท อินเด็กซ์ ฟันด์ อันมีบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด เป็นผู้จัดตั้งและจัดการกองทุน ได้ปฏิบัติหน้าที่ดูแลผลประโยชน์กองทุนรวมถึงกล่าว สำหรับรอบระยะเวลาตั้งแต่วันที่ 1 กุมภาพันธ์ 2555 ถึงวันที่ 31 กรกฎาคม 2555 แล้วนั้น

ธนาคารฯ ได้จัดทำรายงานฉบับนี้ขึ้นบนพื้นฐานของแหล่งข้อมูลที่ได้รับ ณ วันที่ในจดหมายนี้ โดยเชื่อว่าเชื่อถือได้ แต่ธนาคารไม่รับรองความถูกต้องหรือความสมบูรณ์ของข้อมูลดังกล่าว และขอสงวนสิทธิในความรับผิดชอบต่อความผิดพลาด ความละเอียด (รวมถึงไปถึงความรับผิดชอบต่อบุคคลที่สาม) อย่างชัดเจน ไม่มีการรับประกันว่าเหตุการณ์หรือผลลัพธ์ในอนาคตจะตรงกันกับรายงานดังกล่าว ธนาคารฯ กรรมการ พนักงาน หรือตัวแทนของธนาคาร ไม่รับประกันใดๆ ต่อการจ่ายเงินทุน การกระทำการ หรือการแจกจ่ายกองทุน และไม่รับผิดชอบต่อความเสียหายที่เป็นผลมาจากการกระทำ หรือการละเลยที่เกิดขึ้นอันเกี่ยวข้องกับรายงานฉบับนี้

ธนาคารฯ เห็นว่า บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด ได้ปฏิบัติหน้าที่ในการจัดการกองทุนเปิดไทยพาณิชย์เซ็ท อินเด็กซ์ ฟันด์ โดยถูกต้องตามที่ควรตามวัตถุประสงค์ที่ได้กำหนดไว้ในโครงการจัดการที่ได้รับอนุมัติจาก สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์และภายใต้พระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535

ธนาคารซีทีแบงก์ เอ็น.เอ. สาขากรุงเทพฯ



(วิชมน ขจิตสุวรรณ)

Vice President

ผู้ดูแลผลประโยชน์

ธนาคารซีทีแบงก์ เอ็น.เอ. สาขากรุงเทพฯ

24 สิงหาคม 2555

ผลการดำเนินงาน  
ข้อมูล ณ วันที่ 31 กรกฎาคม 2555

ผลตอบแทนจากการลงทุน	ย้อนหลัง 3 เดือน 30 เม.ย. 55 -31 ก.ค. 55	ย้อนหลัง 6 เดือน 31 ม.ค. 55 -31 ก.ค. 55	ย้อนหลัง 1 ปี 29 ก.ค. 54 -31 ก.ค. 55	ย้อนหลัง 3 ปี 31 ก.ค. 52 -31 ก.ค. 55	นับแต่จัดตั้ง กองทุน 20 ส.ค. 39 -31 ก.ค. 55
กองทุน SCBSET	-2.60%	+11.71%	+8.36%	+103.24%	+34.30%
SET Index	-2.38%	+10.64%	+5.80%	+92.20%	+11.94%

หมายเหตุ : เอกสารการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวมฉบับนี้ ได้จัดทำขึ้นตามมาตรฐานการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวมของสมาคมบริษัทจัดการลงทุน

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด  
กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ เซ็ท อินเด็กซ์ ฟันด์  
รายละเอียดหลักทรัพย์ และสัดส่วนการลงทุน  
ณ. วันที่ 31 ก.ค. 2555

ชื่อหลักทรัพย์	ราคา ณ 31 ก.ค. 2555 (บาท)	จำนวนหุ้น (หุ้น)	มูลค่า ตามราคาตลาด (บาท)	ร้อยละของมูลค่า ทรัพย์สินสุทธิ (%)	ค่าประกัน/รับรอง/รับอาวัล หรือสลักหลังโอน แบบมีสิทธิไต่เบี่ย
เงินฝากธนาคาร			12,091,099.31	0.50%	
ธนาคารซีทีแบงก์ (CITIBANK)			12,091,099.31	0.50%	
หุ้นจดทะเบียน			2,367,206,017.23	98.78%	
ธุรกิจการเกษตร			18,154,815.00	0.76%	
บมจ.จีเอฟพีที (GFPT)	8.35	767,900.00	6,411,965.00	0.27%	
บมจ.ศรีตรังแอโกรอินดัสทรี (STA)	14.50	459,800.00	6,667,100.00	0.28%	
บมจ.ยูนิวานชีน้ำมันปาล์ม (UVAN)	98.75	51,400.00	5,075,750.00	0.21%	
ยานยนต์			20,738,700.00	0.87%	
บมจ.อิโนเว รับเบอร์ (ประเทศไทย) (IRC)	13.10	433,200.00	5,674,920.00	0.24%	
บมจ.สมบูรณ์ แอ็ควานซ์ เทคโนโลยี (SAT)	30.00	240,616.00	7,218,480.00	0.30%	
บมจ.ไทยสแตนเลย์-การไฟฟ้า (STANLY)	207.00	37,900.00	7,845,300.00	0.33%	
ธนาคาร			471,165,618.08	19.66%	
บมจ.ธนาคารกรุงศรีอยุธยา (BAY)	32.50	1,470,800.00	47,801,000.00	1.99%	
บมจ.ธนาคารกรุงเทพ (BBL)	196.00	459,000.00	89,964,000.00	3.75%	
บมจ.ธนาคาร ซีไอเอ็มบี ไทย (CIMBT)	2.06	5,128,784.00	10,565,295.04	0.44%	
บมจ.ธนาคารกสิกรไทย (KBANK)	175.00	578,100.00	101,167,500.00	4.22%	
บมจ.ธนาคารเกียรตินาคิน (KK)	41.00	163,100.00	6,687,100.00	0.28%	
บมจ.ธนาคารกรุงไทย (KTB)	16.40	2,688,800.00	44,096,320.00	1.84%	
บริษัท แอล เอช ไฟแนนซ์เชียล กรุ๊ป จำกัด (มหาชน) (LHBANK)	1.32	3,913,466.00	5,165,775.12	0.22%	
บมจ.ธนาคารไทยพาณิชย์ (SCB)	160.50	821,500.00	131,850,750.00	5.50%	
บมจ.ทุนธนชาต (TCAP)	32.25	318,600.00	10,274,850.00	0.43%	
บมจ.ทีสโก้ไฟแนนเชียลกรุ๊ป (TISCO)	40.25	183,700.00	7,393,925.00	0.31%	
บมจ.ธนาคารทหารไทย (TMB)	1.54	10,518,898.00	16,199,102.92	0.68%	
พาณิชย์			203,753,495.50	8.50%	
บมจ.บีจีชี ซูเปอร์เซ็นเตอร์ (BIGC)	179.50	201,000.00	36,079,500.00	1.51%	
บมจ.เบอร์ลี่ ยุคเกอร์ (BJC)	39.75	417,800.00	16,607,550.00	0.69%	
บมจ. ซีพี ออลล์ จำกัด (CPALL)	34.00	2,189,800.00	74,453,200.00	3.11%	
บริษัท สยามโกลบอลเฮ้าส์ จำกัด (มหาชน) (GLOBAL)	12.00	716,420.00	8,597,040.00	0.36%	
บมจ.โฮม โปรดัคส์ เซ็นเตอร์ (HMPRO)	11.50	1,561,600.00	17,958,400.00	0.75%	
บมจ.สยามแม็คโคร (MAKRO)	330.00	61,900.00	20,427,000.00	0.85%	
บมจ.ห้างสรรพสินค้าโรบินสัน (ROBINS)	61.25	293,500.00	17,976,875.00	0.75%	
บมจ.สหพัฒนาปิบูล (SPC)	41.75	141,766.00	5,918,730.50	0.25%	
บมจ.สหพัฒนาอินเตอร์โฮลดิ้ง (SPI)	26.75	214,400.00	5,735,200.00	0.24%	

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด  
กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ เซ็ท อินเด็กซ์ ฟันด์  
รายละเอียดหลักทรัพย์ และสัดส่วนการลงทุน  
ณ. วันที่ 31 ก.ค. 2555

ชื่อหลักทรัพย์	ราคา ณ 31 ก.ค. 2555 (บาท)	จำนวนหุ้น (หุ้น)	มูลค่า ตามราคาตลาด (บาท)	ร้อยละของมูลค่า ทรัพย์สินสุทธิ (%)	ค่าประกัน/รับรอง/รับอาวัล หรือสลักหลังโอน แบบมีสิทธิไต่เบี่ย
<b>เทคโนโลยีสารสนเทศและการสื่อสาร</b>			<b>277,924,155.75</b>	<b>11.60%</b>	
บมจ. แอดวานซ์ อินโฟร์ เซอร์วิส (ADVANC)	200.00	725,500.00	145,100,000.00	6.05%	
บริษัท โทเทิล แอ็กเซส คอมมูนิเคชั่น จำกัด (มหาชน) (DTAC)	82.25	581,595.00	47,836,188.75	2.00%	
บมจ.ชิน คอร์ปอเรชั่น (INTUCH)	62.75	800,500.00	50,231,375.00	2.10%	
บมจ.จัสตินอินเตอร์เนชั่นแนล (JAS)	3.28	2,440,900.00	8,006,152.00	0.33%	
บมจ.สามารท ไอ-โมบาย (SIM)	2.08	2,884,400.00	5,999,552.00	0.25%	
บมจ.ไทยคม (THCOM)	15.00	422,300.00	6,334,500.00	0.26%	
บมจ.ทรู คอร์ปอเรชั่น (TRUE)	4.00	3,604,097.00	14,416,388.00	0.60%	
<b>วัสดุก่อสร้าง</b>			<b>133,168,311.50</b>	<b>5.56%</b>	
บมจ.ไดนาสตีเซรามิก (DCC)	51.75	169,200.00	8,756,100.00	0.37%	
บมจ.ปูนซิเมนต์ไทย (SCC)	328.00	285,300.00	93,578,400.00	3.90%	
บมจ.ปูนซิเมนต์นครหลวง (SCCC)	341.00	58,000.00	19,778,000.00	0.83%	
บมจ.ทีปโก้เอสพีลท์ (TASCO)	39.25	87,078.00	3,417,811.50	0.14%	
บมจ.ทีพีไอ โพลีน (TIPL)	12.00	636,500.00	7,638,000.00	0.32%	
<b>ชิ้นส่วนอิเล็กทรอนิกส์</b>			<b>19,515,828.00</b>	<b>0.81%</b>	
บมจ.แคลคอมพ์ อิเล็กทรอนิกส์ (ประเทศไทย) (CCET)	2.44	1,216,900.00	2,969,236.00	0.12%	
บมจ.เดลต้า อิเล็กทรอนิกส์ (ประเทศไทย) (DELTA)	23.80	336,840.00	8,016,792.00	0.33%	
บมจ.ฮานา ไมโครอิเล็กทรอนิกส์ (HANA)	20.00	274,600.00	5,492,000.00	0.23%	
บมจ.มูราโมโต้ อิเล็กทรอนิกส์ (METCO)	183.00	16,600.00	3,037,800.00	0.13%	
<b>พลังงานและสาธารณูปโภค</b>			<b>514,264,235.00</b>	<b>21.46%</b>	
บมจ.บ้านปู (BANPU)	400.00	64,700.00	25,880,000.00	1.08%	
บมจ.บางจากปิโตรเลียม (BCP)	22.20	403,300.00	8,953,260.00	0.37%	
บมจ.จัดการและพัฒนาทรัพยากรน้ำภาคตะวันออก (EASTW)	9.95	770,300.00	7,664,485.00	0.32%	
บริษัท ผลิตไฟฟ้า จำกัด (มหาชน) (EGCO)	109.50	131,600.00	14,410,200.00	0.60%	
บมจ.เอสโซ่ (ประเทศไทย) (ESSO)	10.30	968,600.00	9,976,580.00	0.42%	
บมจ.โกลว์ พลังงาน (GLOW)	60.75	376,200.00	22,854,150.00	0.95%	
บมจ.ไออาร์พีซี (IRPC)	3.62	5,571,000.00	20,167,020.00	0.84%	
บมจ.ปิคนิค คอร์ปอเรชั่น (PICNI)		643,009.00	0.00	0.00%	
บมจ.ปตท. (PTT)	326.00	678,500.00	221,191,000.00	9.23%	
บมจ.ปตท.สำรวจและผลิตปิโตรเลียม (PTTEP)	152.00	787,400.00	119,684,800.00	4.99%	
บมจ.ผลิตไฟฟ้าราชบุรี โฮลดิ้ง (RATCH)	47.75	373,200.00	17,820,300.00	0.74%	
บมจ.สยามแก๊ส แอนด์ ปิโตรเคมีคัลส์ (SGP)	14.50	495,500.00	7,184,750.00	0.30%	
บมจ.ไทยออยล์ (TOP)	59.00	472,600.00	27,883,400.00	1.16%	
บมจ.น้ำประปาไทย (TTW)	7.35	1,441,400.00	10,594,290.00	0.44%	

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด  
กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ เซ็ท อินเด็กซ์ ฟันด์  
รายละเอียดหลักทรัพย์ และสัดส่วนการลงทุน  
ณ. วันที่ 31 ก.ค. 2555

ชื่อหลักทรัพย์	ราคา ณ 31 ก.ค. 2555 (บาท)	จำนวนหุ้น (หุ้น)	มูลค่า ตามราคาตลาด (บาท)	ร้อยละของมูลค่า ทรัพย์สินสุทธิ (%)	ค่าประกัน/รับรอง/รับอาวัล หรือสลักหลังโอน แบบมีสิทธิไต่เบี่ย
<b>แฟชัน</b>			<b>16,405,200.00</b>	<b>0.68%</b>	
บมจ.ไอ.ซี.ซี.อินเตอร์เนชั่นแนล (ICC)	39.75	109,000.00	4,332,750.00	0.18%	
บมจ.ซาบีน่า (SABINA)	115.00	44,500.00	5,117,500.00	0.21%	
บมจ.สหยูเนี่ยน (SUC)	34.00	120,100.00	4,083,400.00	0.17%	
บมจ.ไทยเรยอน (TR)	56.75	50,600.00	2,871,550.00	0.12%	
<b>เงินทุนและหลักทรัพย์</b>			<b>10,031,610.00</b>	<b>0.42%</b>	
บมจ.อิกออน ธนสินทรัพย์ (ไทยแลนด์) (AEONTS)	34.50	156,900.00	5,413,050.00	0.23%	
บมจ.เงินทุนธนสยาม (DS)		19,800.00	0.00	0.00%	
บมจ.เงินทุนเอกธนกิจ (FIN1)		10,600.00	0.00	0.00%	
บมจ.หลักทรัพย์ เมย์แบงก์ กิมเอ็ง (ประเทศไทย) (MBKET)	13.60	339,600.00	4,618,560.00	0.19%	
บมจ.เงินทุนหลักทรัพย์ซิทกา (SITCA)		13,000.00	0.00	0.00%	
<b>อาหารและเครื่องดื่ม</b>			<b>135,922,765.95</b>	<b>5.67%</b>	
บมจ.เจริญโภคภัณฑ์อาหาร (CPF)	33.25	1,831,600.00	60,900,700.00	2.54%	
บมจ.น้ำตาลขอนแก่น (KSL)	12.00	633,700.00	7,604,400.00	0.32%	
บมจ.ไมเนอร์ อินเตอร์เนชั่นแนล (MINT)	15.70	1,020,126.00	16,015,978.20	0.67%	
บมจ.โออิชิ กรุ๊ป (OISHI)	158.00	66,300.00	10,475,400.00	0.44%	
บมจ.ไทยเพรซิเดนทึฟู้ดส์ (TF)	137.50	72,100.00	9,913,750.00	0.41%	
บมจ.ไทยยูเนี่ยน โฟรเซ่น โปรดักส์ (TUF)	73.50	316,104.00	23,233,644.00	0.97%	
บมจ.น้ำมันพืชไทย (TVO)	25.25	308,075.00	7,778,893.75	0.32%	
<b>การแพทย์</b>			<b>64,352,406.00</b>	<b>2.69%</b>	
บมจ.กรุงเทพดุสิตเวชการ (BGH)	99.25	399,800.00	39,680,150.00	1.66%	
บมจ.โรงพยาบาลบำรุงราษฎร์ (BH)	76.00	215,000.00	16,340,000.00	0.68%	
บมจ.บางกอก เชน ฮอสปิทอล (KH)	9.20	905,680.00	8,332,256.00	0.35%	
<b>ของใช้ในครัวเรือนและสำนักงาน</b>			<b>3,705,600.00</b>	<b>0.15%</b>	
บมจ.ศรีไทยซูเปอร์แวร์ (SITHAI)	16.00	231,600.00	3,705,600.00	0.15%	
<b>ประกันภัยและประกันชีวิต</b>			<b>40,330,954.00</b>	<b>1.68%</b>	
บมจ.กรุงเทพประกันภัย (BKI)	249.00	34,221.00	8,521,029.00	0.36%	
บริษัท กรุงเทพประกันชีวิต จำกัด (มหาชน) (BLA)	46.25	380,900.00	17,616,625.00	0.74%	
บริษัท ไทยพาณิชย์ประกันชีวิต จำกัด (มหาชน) (SCBLIF)	726.00	19,550.00	14,193,300.00	0.59%	
<b>สื่อและสิ่งพิมพ์</b>			<b>45,772,430.00</b>	<b>1.91%</b>	
บมจ.บีอีซี เวิลด์ (BEC)	56.25	549,200.00	30,892,500.00	1.29%	
บมจ.ไอทีวี (ITV)		585,200.00	0.00	0.00%	
บมจ.เมเจอร์ ซินีเพล็กซ์ กรุ๊ป (MAJOR)	18.90	356,200.00	6,732,180.00	0.28%	
บมจ.อสมท (MCOT)	28.75	283,400.00	8,147,750.00	0.34%	



บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด  
 กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ เซ็ท อินเด็กซ์ ฟันด์  
 รายละเอียดหลักทรัพย์ และสัดส่วนการลงทุน  
 ณ. วันที่ 31 ก.ค. 2555

ชื่อหลักทรัพย์	ราคา ณ 31 ก.ค. 2555 (บาท)	จำนวนหุ้น (หุ้น)	มูลค่า ตามราคาตลาด (บาท)	ร้อยละของมูลค่า ทรัพย์สินสุทธิ (%)	ค่าประกัน/รับรอง/รับอาวัล หรือสลักหลังโอน แบบมีสิทธิไต่เบี่ย
<b>เหมืองแร่</b>			<b>3,656,520.00</b>	<b>0.15%</b>	
บมจ.ผาแดงอินดัสทรี (PDI)	12.60	290,200.00	3,656,520.00	0.15%	
<b>บรรจุภัณฑ์</b>			<b>7,712,045.40</b>	<b>0.32%</b>	
บมจ.เอ.เจ.พลาสติก (AJ)	11.40	285,011.00	3,249,125.40	0.14%	
บมจ. โพลีเพล็กซ์ (ประเทศไทย) (PTL)	14.70	303,600.00	4,462,920.00	0.19%	
<b>ปิโตรเคมีและเคมีภัณฑ์</b>			<b>108,927,508.00</b>	<b>4.55%</b>	
บมจ. อินโดรามา เวนเจอร์ส (IVL)	29.75	1,161,200.00	34,545,700.00	1.44%	
บมจ.พีทีที โกลบอล เคมิคอล (PTTGC)	59.25	1,057,336.00	62,647,158.00	2.61%	
บมจ.ไทยเซ็นทรัลเคมี (TCCC)	16.60	297,900.00	4,945,140.00	0.21%	
บมจ.วินไทย (VNT)	18.20	373,050.00	6,789,510.00	0.28%	
<b>พัฒนาอสังหาริมทรัพย์</b>			<b>165,784,529.65</b>	<b>6.92%</b>	
บมจ.อมตะ คอร์ปอเรชั่น (AMATA)	17.20	395,600.00	6,804,320.00	0.28%	
บมจ.เอเชียนพร็อพเพอร์ตี้ ดีเวลลอปเม้นท์ (AP)	7.40	983,360.00	7,276,864.00	0.30%	
บมจ.บางกอกแลนด์ (BLAND)	0.84	8,020,900.00	6,737,556.00	0.28%	
บมจ.ช.การช่าง (CK)	7.10	744,542.00	5,286,248.20	0.22%	
บมจ.เซ็นทรัลพัฒนา (CPN)	49.00	573,200.00	28,086,800.00	1.17%	
บมจ.เหมราชพัฒนาที่ดิน (HEMRAJ)	2.98	3,413,200.00	10,171,336.00	0.42%	
บมจ.อิตาเลียนไทย ดีเวลลอปเม้นท์ (ITD)	3.20	1,969,500.00	6,302,400.00	0.26%	
บมจ.แลนด์แอนด์เฮ้าส์ (LH)	7.80	2,615,700.00	20,402,460.00	0.85%	
บมจ.แอล.พี.เอ็น. ดีเวลลอปเม้นท์ (LPN)	17.40	543,300.00	9,453,420.00	0.39%	
บมจ.เอ็ม บี เค (MBK)	93.50	79,400.00	7,423,900.00	0.31%	
บมจ.พฤษภา เรียลเอสเตท (PS)	17.70	670,200.00	11,862,540.00	0.49%	
บมจ.ควอลิตี้เฮ้าส์ (QH)	1.79	3,276,225.00	5,864,442.75	0.24%	
บมจ.สวนอุตสาหกรรมโรจนะ (ROJNA)	8.60	527,800.00	4,539,080.00	0.19%	
บมจ.แสนสิริ (SIRI)	2.40	2,974,708.00	7,139,299.20	0.30%	
บมจ.สุภาลัย (SPALI)	18.00	605,900.00	10,906,200.00	0.46%	
บมจ.ซิโน-ไทย เอ็นจิเนียริงแอนด์คอนสตรัคชั่น (STEC)	15.20	507,300.00	7,710,960.00	0.32%	
บมจ.เอสทีที แอนด์ ไอ (STPI)	27.75	167,314.00	4,642,963.50	0.19%	
บมจ.ไทคอน อินดัสเทรียล คอนเน็คชั่น (TICON)	13.40	386,100.00	5,173,740.00	0.22%	
<b>เหล็ก</b>			<b>13,261,148.90</b>	<b>0.55%</b>	
บมจ.จี เจ สตีล (GJS)	0.14	26,922,600.00	3,769,164.00	0.16%	
บมจ.จี สตีล (GSTEEL)	0.41	6,085,300.00	2,494,973.00	0.10%	
บมจ.สหวิริยาสตีลอินดัสทรี (SSI)	0.63	5,983,820.00	3,769,806.60	0.16%	
บมจ.ทาทา สตีล (ประเทศไทย) (TSTH)	0.79	4,085,070.00	3,227,205.30	0.13%	



บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด  
 กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ เซ็ท อินเด็กซ์ ฟันด์  
 รายละเอียดหลักทรัพย์ และสัดส่วนการลงทุน  
 ณ. วันที่ 31 ก.ค. 2555

ชื่อหลักทรัพย์	ราคา ณ 31 ก.ค. 2555 (บาท)	จำนวนหุ้น (หุ้น)	มูลค่า ตามราคาตลาด (บาท)	ร้อยละของมูลค่า ทรัพย์สินสุทธิ (%)	ค่าประกัน/รับรอง/รับอาวัล หรือสลักหลังโอน แบบมีสิทธิไต่เบี่ย
<b>การท่องเที่ยวและสันทนาการ</b>			<b>22,221,943.00</b>	<b>0.93%</b>	
บมจ. โรงแรมเซ็นทรัล พลาซา (CENTEL)	15.30	479,700.00	7,339,410.00	0.31%	
บมจ.ดิ เอราวัณ กรุ๊ป (ERW)	2.64	2,144,700.00	5,662,008.00	0.24%	
บมจ.ลากูน่า รีสอร์ท แอนด์ โฮเทล (LRH)	39.75	102,300.00	4,066,425.00	0.17%	
บมจ.โอเอชทีแอล (OHTL)	518.00	9,950.00	5,154,100.00	0.22%	
<b>ขนส่งและโลจิสติกส์</b>			<b>70,436,197.50</b>	<b>2.94%</b>	
บมจ. เอเชีย เอวิเอชั่น (AAV)	3.42	1,633,100.00	5,585,202.00	0.23%	
บมจ.ท่าอากาศยานไทย (AOT)	68.50	359,400.00	24,618,900.00	1.03%	
บมจ.ทางด่วนกรุงเทพ (BECL)	28.50	265,700.00	7,572,450.00	0.32%	
บริษัท บีทีเอส กรุ๊ป โฮลดิ้งส์ จำกัด (มหาชน) (BTS)	0.80	16,131,600.00	12,905,280.00	0.54%	
บมจ.พีริเซียส ชิปปิ้ง (PSL)	14.60	352,100.00	5,140,660.00	0.21%	
บมจ.อาร์ ซี แอล (RCL)	6.50	515,600.00	3,351,400.00	0.14%	
บมจ.การบินไทย (THAI)	19.90	565,945.00	11,262,305.50	0.47%	
<b>รวมหลักทรัพย์ประเภทหุ้น</b>			<b>2,367,206,017.23</b>	<b>98.78%</b>	
<b>เงินฝากธนาคาร</b>			<b>30,648,598.97</b>	<b>1.28%</b>	
บมจ.ธนาคาร ยูโอบี (UOBT)			30,648,598.97	1.28%	
			<b>1,353.21</b>	<b>0.00%</b>	
เงินฝากออมทรัพย์ธนาคารซีทีแบงก์ ธุรกิจกรม SBL (INCISBLSCBSset)			1,353.21	0.00%	
<b>สินทรัพย์อื่น ๆ</b>			<b>755,196.58</b>	<b>0.03%</b>	
<b>หนี้สิน</b>			<b>-14,185,301.56</b>	<b>-0.59%</b>	
<b>มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ</b>			<b>2,396,516,963.74</b>	<b>100.00%</b>	
<b>มูลค่าหน่วยลงทุน (บาท)</b>			<b>13.4304</b>		

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด

กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ เซ็ท อินเด็กซ์ ฟันด์

รายงานสรุปเงินลงทุน

ณ วันที่ 31 กรกฎาคม 2555

กลุ่มของตราสาร	มูลค่าตามราคาตลาด	%NAV
(ก) ตราสารภาครัฐ ได้แก่ ตัวแลกเงิน พันธบัตรรัฐบาล พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย พันธบัตร หรือตราสารแห่งหนึ่งที่กองทุนเพื่อการฟื้นฟูและพัฒนาสถาบันการเงิน หรือกระทรวงการคลัง เป็นผู้ออก ผู้รับรอง ผู้รับอาวัล หรือผู้ค้ำประกัน	-	-
(ข) ตราสารที่ธนาคารที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้น ธนาคารพาณิชย์ หรือบริษัทเงินทุนเป็นผู้ออก ผู้รับรอง ผู้รับอาวัล ผู้สละหลัก หรือผู้ค้ำประกัน	42,777,843.47	1.79
(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

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด  
กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ เซ็ท อินเด็กซ์ ฟันด์  
รายละเอียดตัวตราสารและอันดับความน่าเชื่อถือของตราสารทุกตัวใน Port  
ณ วันที่ 31 กรกฎาคม 2555

ประเภท	ผู้ออก	ผู้ค้ำ/ผู้รับรอง/ผู้หลักประกัน	วันครบกำหนด	อันดับความน่าเชื่อถือของผู้ออกตราสาร		มูลค่าหน้าตัว	มูลค่าตามราคาตลาด
				TRIS Rating	FITCH Rating		
พันธบัตร							-
ตั๋วสัญญาใช้เงิน (ธนาคาร)							-
ตั๋วสัญญาใช้เงิน							-
ตั๋วแลกเงิน (บริษัท)							-
ตั๋วแลกเงิน							-
หุ้นกู้							-
อื่น ๆ	ธนาคารซีทีแบงก์		31/12/2030			1,353.21	1,353.21
	บมจ.ธนาคาร ยูโอบี		31/12/2050		AAA(thai)	30,648,598.97	30,684,055.90

กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ เซ็ท อินเด็กซ์ ฟันด์

SCB SET INDEX OPEN-ENDED FUND

แบบค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม

FUND'S DIRECT EXPENSES REPORT

ตั้งแต่วันที่ 1 กุมภาพันธ์ 2555 ถึงวันที่ 31 กรกฎาคม 2555

Period from 1 February 2012 to 31 July 2012

ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม *	จำนวนเงิน หน่วย : พันบาท	ร้อยละต่อปีของ มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ
Fund's direct expenses		
ค่าธรรมเนียมการจัดการ (Management fee)	11,156	0.96
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ (Trustee fee)	496	0.04
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน (Registrar fee)	-	-
ค่าที่ปรึกษาการลงทุน (Advisory fee)	-	-
ค่าสอบบัญชี (Auditing fee)	141	0.01
ค่าใช้จ่ายงานทะเบียนกองทุน (Registration Expense)	825	0.07
ค่าธรรมเนียมธนาคาร (Bank fee)	203	0.02
ค่าใช้จ่ายอื่น ๆ (Other expenses)	157	0.01
รวมค่าใช้จ่ายทั้งหมด (Total Expense) **	12,978	1.11

\* ค่าใช้จ่ายดังกล่าวได้รวมภาษีมูลค่าเพิ่มแล้ว / Including VAT

\*\* ไม่รวมค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ และค่าธรรมเนียมต่าง ๆ ที่เกิดขึ้นจากการซื้อขายหลักทรัพย์

Excluding brokerage fee and other transactions fees

กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ เซ็ท อินเด็กซ์ ฟันด์ (SCBSET)

งบดุล

ณ วันที่ 31 กรกฎาคม 2555

"ยังไม่ได้ตรวจสอบ"

"ยังไม่ได้สอบทาน"

บาท

สินทรัพย์

เงินลงทุนตามราคายุติธรรม

2,397,855,969.41

เงินสดและเงินฝากธนาคาร

12,091,099.31

ลูกหนี้จากเงินปันผลและดอกเบี้ย

657,284.23

ค่าใช้จ่ายรอตัดบัญชี

97,912.35

รวมสินทรัพย์

2,410,702,265.30

หนี้สิน

เจ้าหนี้จากการรับซื้อคืนส่วนได้เสีย

11,943,447.76

เจ้าหนี้อื่น

1,560.00

ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย

2,152,681.14

หนี้สินอื่น

87,612.66

รวมหนี้สิน

14,185,301.56

สินทรัพย์สุทธิ

2,396,516,963.74

สินทรัพย์สุทธิ :-

ทุนที่ได้รับจากผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุน

1,784,388,541.90

กำไรสะสม

1,831,717,530.10

บัญชีปรับสมดุล

(1,219,589,108.26)

สินทรัพย์สุทธิ

2,396,516,963.74

จำนวนหน่วยลงทุนที่จำหน่ายแล้ว (หน่วย)

178,438,854.19

สินทรัพย์สุทธิต่อหน่วยลงทุน

13.4304

## กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ เซท อินเด็กซ์ ฟันด์ (SCBSET)

## งบกำไรขาดทุน

รอบระยะเวลาตั้งแต่วันที่ 1 กุมภาพันธ์ 2555 ถึงวันที่ 31 กรกฎาคม 2555

"ยังไม่ได้ตรวจสอบ"

"ยังไม่ได้สอบทาน"

บาท

รายได้จากการลงทุน	
รายได้เงินปันผล	43,404,637.56
รายได้ดอกเบี้ย	270,352.72
รายได้อื่น	0.30
รายได้ทั้งสิ้น	<b>43,674,990.58</b>
ค่าใช้จ่าย	
ค่าธรรมเนียมจัดการ	11,156,387.02
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์	495,839.40
ค่าสอบบัญชี	140,726.04
ค่าใช้จ่ายอื่น	1,184,878.41
ค่าใช้จ่ายทั้งสิ้น	<b>12,977,830.87</b>
รายได้จากการลงทุนสุทธิ	<b>30,697,159.71</b>
รายการกำไรสุทธิจากเงินลงทุน	
รายการกำไรสุทธิที่เกิดขึ้นจริง	154,474,618.73
รายการกำไรสุทธิที่ยังไม่เกิดขึ้นจริง	86,616,762.92
รวมรายการกำไรจากการลงทุนที่เกิดขึ้นและที่ยังไม่เกิดขึ้น	<b>241,091,381.65</b>
การเพิ่มขึ้นในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงาน	<b>271,788,541.36</b>

รายงานการซื้อขายหลักทรัพย์และค่าใช้จ่ายต่าง ๆ

**VOLUME TRADE AND EXPENSES REPORT**

ตั้งแต่วันที่ 1 กุมภาพันธ์ 2555 ถึง วันที่ 31 กรกฎาคม 2555

Period from 1 February 2012 to 31 July 2012

	(พันบาท) / (Thousand Baht)
มูลค่าทรัพย์สินสุทธิเฉลี่ย / Average Net Assets Value	2,329,606
การซื้อขายหลักทรัพย์รวม / Volume Trade	
มูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์รวม	2,186,744
Total Volume Trade	
ค่าธรรมเนียมหน้าในการซื้อขายหลักทรัพย์รวม	2,310
Total Brokerage Fee	
ค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายอื่น ๆ รวม / Fee and other Expenses	12,978
	(ร้อยละ) / (Percentage)
<ul style="list-style-type: none"> <li>สัดส่วนค่าธรรมเนียมหน้าในการซื้อขายหลักทรัพย์รวมคิดเป็นร้อยละของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์รวม</li> </ul>	0.11
Brokerage Fee as Percentage of Total Trading Volume	
<ul style="list-style-type: none"> <li>สัดส่วนค่าธรรมเนียมหน้าในการซื้อขายหลักทรัพย์รวมคิดเป็นร้อยละของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิเฉลี่ย</li> </ul>	0.20
Brokerage Fee as Percentage of Average Net Assets Value	
<ul style="list-style-type: none"> <li>สัดส่วนค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายอื่น ๆ รวมคิดเป็นร้อยละของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิเฉลี่ย</li> </ul>	1.11
Fee and other Expenses as Percentage of Average Net Assets Value	



รายงานรายชื่อบริษัทนายหน้า และค่าธรรมเนียม ซื้อ-ขาย หลักทรัพย์  
ของกองทุนเปิดไทยพาณิชย์ เซ็ท อินเด็กซ์ ฟันด์  
ระหว่างวันที่ 1 กุมภาพันธ์ 2555 ถึง 31 กรกฎาคม 2555

ลำดับที่	ชื่อบริษัทนายหน้า	ค่านายหน้า (พันบาท)	อัตราส่วนค่านายหน้าแต่ละราย ต่อค่านายหน้าทั้งหมด
1	บมจ.หลักทรัพย์ เมย์แบงก์ กิมเอ็ง (ประเทศไทย)	1,750.73	58.74%
2	บมจ.หลักทรัพย์ โนมูระ พัฒนสิน	1,211.93	40.66%
3	บมจ.หลักทรัพย์ ภัทร	17.96	0.60%
รวม		2,980.62	100.00%

การรับผลประโยชน์ตอบแทนเนื่องจากการที่กองทุนใช้บริการบุคคลอื่น

บริษัทที่ให้ผลประโยชน์	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>
บริษัทหลักทรัพย์ เอเซีย พลัส จำกัด (มหาชน)	✓	✓	✓		✓	
บริษัทหลักทรัพย์ บัวหลวง จำกัด (มหาชน)	✓	✓	✓		✓	✓
บริษัทหลักทรัพย์ ซี แอล เอส เอ (ประเทศไทย) จำกัด	✓	✓	✓		✓	
บริษัทหลักทรัพย์ โนมูระ พัฒนสิน จำกัด (มหาชน)	✓	✓	✓		✓	
บริษัทหลักทรัพย์เครดิต สวิส (ประเทศไทย) จำกัด	✓	✓	✓		✓	✓
บริษัทหลักทรัพย์ เมย์แบงก์ กิมเอ็ง (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)	✓	✓	✓		✓	
บริษัทหลักทรัพย์ แมคควอรี (ประเทศไทย) จำกัด	✓	✓	✓		✓	
บริษัทหลักทรัพย์ ภัทร จำกัด (มหาชน)	✓	✓	✓	✓	✓	✓
บริษัทหลักทรัพย์ ไทยพาณิชย์ จำกัด	✓	✓	✓	✓	✓	✓
บริษัทหลักทรัพย์ ธนชาด จำกัด (มหาชน)	✓	✓	✓		✓	
บริษัทหลักทรัพย์ ทีเอสไอ จำกัด	✓	✓	✓	✓	✓	✓
บริษัทหลักทรัพย์ ซีไอเอ็มบี (ประเทศไทย) จำกัด	✓	✓	✓	✓	✓	
บริษัทหลักทรัพย์ ยูบีเอส (ประเทศไทย) จำกัด	✓	✓	✓	✓	✓	
บริษัทหลักทรัพย์ เจพีมอร์แกน (ประเทศไทย) จำกัด	✓	✓	✓	✓	✓	
บริษัทหลักทรัพย์ เคที ซีมิโก้ จำกัด	✓	✓	✓		✓	
บริษัทหลักทรัพย์ ดีบีเอส วิคเคอร์ส (ประเทศไทย) จำกัด	✓	✓	✓		✓	

\*ผลประโยชน์ที่ได้รับ

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