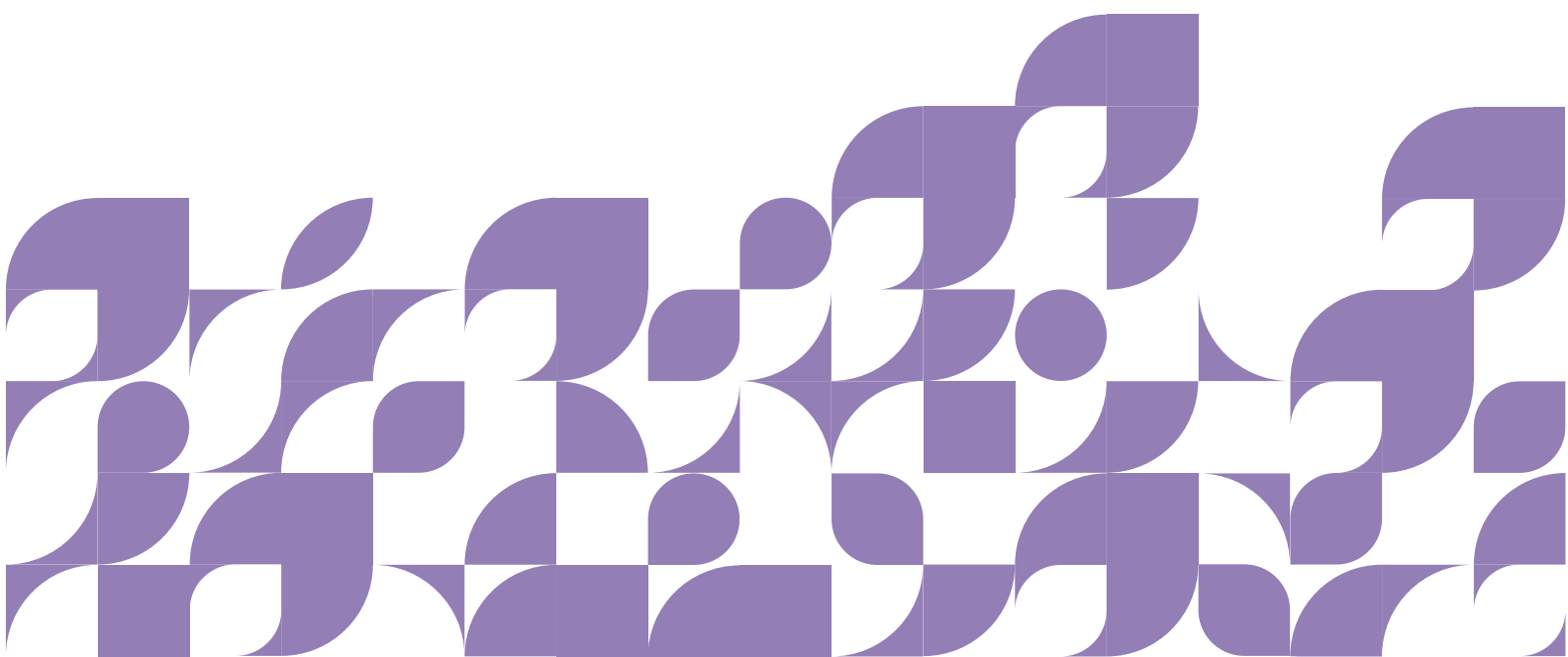




กองทุนเปิดไทยพาณิชย์
เซิร์ก อินเวสติกส์ ฟันด์ (SCBSET)

ร าย ง า น ป ร ะ จ ำ 6 เดือน
วันที่ 1 กุมภาพันธ์ 2557 ถึงวันที่ 31 กรกฎาคม 2557



สารสนเทศจากบริษัทจัดการ

เรียน ท่านผู้ถือหน่วยลงทุน

กองทุนเปิดไทยพาณิชย์เซ็ทอินเด็กซ์ฟันด์ (SCBSET) ซึ่งกองทุนนี้เป็นกองทุนที่ลงทุนในหลักทรัพย์จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ ดังนั้นผลตอบแทนของกองทุนจะผันผวนตามดัชนีตลาดหลักทรัพย์ (SET Index) โดยในช่วงวันที่ 1 กุมภาพันธ์ 2557 ถึง 31 กรกฎาคม 2557 ดัชนีตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยปรับตัวลงร้อยละ 13.36 มาปิดที่ 1502.39 จุด

ในช่วงต้นไตรมาสที่ 1 ของปี 2557 ดัชนีปรับตัวลดลงอย่างรุนแรงในวันทำการแรกของปีจากความกังวลทางการเมือง หลังจากนั้นดัชนีเริ่มปรับตัวขึ้นจากความคาดหวังว่าจะมีความคลี่คลายทางการเมืองเมื่อมีการกำหนด การเลือกตั้งในวันที่ 2 กุมภาพันธ์ 2557 รวมถึงการประกาศยกเลิก Shutdown กรุงเทพฯ และกลับไปชุมนุมในสวนลุมฯ ส่วนเศรษฐกิจในประเทศยังคงซบเซาเช่นเดียวกันกับในช่วงก่อนหน้าจากกำลังซื้อในประเทศที่ชะลอตัวหนัก รวมถึงการลงทุนจากทั้งภาครัฐและเอกชนที่ชะลอตัวลงด้วย อย่างไรก็ตาม มีสัญญาณการฟื้นตัวของส่งออกที่เริ่มกลับมาตามการฟื้นตัวของประเทศสหรัฐอเมริกา สำหรับปัจจัยภายนอก หลังจากที่มีการเปลี่ยนประธานธนาคารกลางสหรัฐฯ (Fed) คนใหม่แล้ว มีการส่งสัญญาณชัดเจนเกี่ยวกับการลดขนาดของ QE ซึ่งเป็นไปตามที่ตลาดได้คาดการณ์ไว้และยังส่งสัญญาณที่จะไม่เร่งขึ้นดอกเบี้ยอีกด้วย

ภาวะการลงทุนในไตรมาสที่ 2 ของปี 2557 ยังคงปรับตัวผันผวนในช่วงแรกเนื่องจากยังคงวนเวียนอยู่กับปัญหาทางการเมืองที่ทวีความรุนแรงขึ้นและส่งผลกระทบต่อเสถียรภาพของรัฐบาลอย่างมีนัยสำคัญ ตลาดเงินมีการประกาศใช้กฎอัยการศึกและรัฐประหารในวันที่ 20-22 พ.ค. ซึ่งนักลงทุนต่างประเทศมีมุมมองเชิงลบเป็นอย่างมากต่อการทำรัฐประหารจึงเทขายหุ้นไทยอย่างหนัก แต่นักลงทุนในประเทศกลับมองเป็นในเชิงบวกเนื่องจากการเป็นกลางทางการเมืองและมีความคาดหวังว่าเศรษฐกิจจะกลับมาเดินหน้าได้อีกครั้ง ประกอบกับการเริ่มประกาศนโยบายฟื้นฟูเศรษฐกิจต่างๆ พร้อมทั้งการทยอยยกเลิกเคอร์ฟิวจนจบสิ้นในช่วงสัปดาห์ที่ 2 ของเดือนพฤษภาคม โดยปัจจัยสำคัญที่ทำให้หุ้นไทยกลับมาปรับตัวเพิ่มขึ้นอย่างรวดเร็วในสองสัปดาห์สุดท้ายของไตรมาสคือ สัญญาณความคืบหน้าของโครงการลงทุนโครงสร้างพื้นฐาน การดั่งบอร์ด BOI และการจ่ายเงินจำนำข้าวอย่างต่อเนื่อง

สำหรับแนวโน้มตลาดหุ้นในช่วงครึ่งปีหลังของปี 2557 คาดว่าจะปรับตัวขึ้นต่อเนื่องจากความหวังว่าจะมีการจัดตั้งรัฐบาลชั่วคราวซึ่งจะส่งผลดีต่อการดำเนินนโยบายเศรษฐกิจ ประกอบกับแนวโน้มผลประกอบการของบริษัทจดทะเบียนที่น่าจะกลับมาฟื้นตัวและเติบโตได้ดีกว่าช่วงครึ่งปีแรก นอกจากนี้ หากมีการยกเลิกกฎอัยการศึกจะทำให้ให้นักลงทุนต่างประเทศมีความเชื่อมั่นที่จะกลับมาลงทุนในประเทศไทยอีกด้วย ในขณะเดียวกัน เศรษฐกิจโลกก็มีแนวโน้มที่จะฟื้นตัวต่อเนื่องซึ่งส่งผลดีต่อความเชื่อมั่นในการลงทุน อย่างไรก็ตาม ปัจจัยเสี่ยงที่ต้องยังติดตามคือ การทยอยลดขนาดวงเงิน QE ของสหรัฐฯ ความขัดแย้งทางการเมืองในต่างประเทศ และการปรับขึ้นอัตราดอกเบี้ยของสหรัฐฯ ที่เร็วและแรงกว่าคาด

สุดท้ายนี้ บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนไทยพาณิชย์ จำกัด ขอขอบคุณผู้ถือหน่วยทุกท่าน ที่ให้การส่งเสริมและสนับสนุนด้วยดีมาโดยตลอด

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด

ความเห็นของผู้ดูแลผลประโยชน์

เรียน ผู้ถือหน่วยลงทุน กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ เซ็ท อินดีกซ์ ฟันด์

ข้าพเจ้า บมจ. ธนาคารกสิกรไทย ในฐานะผู้ดูแลผลประโยชน์ ได้ดูแลการจัดการกองทุนเปิดไทยพาณิชย์ เซ็ท อินดีกซ์ ฟันด์ ซึ่งจัดการโดยบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนไทยพาณิชย์ จำกัด สำหรับระยะเวลา ตั้งแต่วันที่ 1 กุมภาพันธ์ พ.ศ. 2557 ถึงวันที่ 31 กรกฎาคม พ.ศ. 2557 แล้ว

ข้าพเจ้าเห็นว่า บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด ได้ปฏิบัติหน้าที่ในการจัดการ กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ เซ็ท อินดีกซ์ ฟันด์ เหมาะสมตามสมควรแห่งวัตถุประสงค์ที่ได้กำหนดไว้ในโครงการและภายใต้พระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535

ผู้ดูแลผลประโยชน์

บมจ. ธนาคารกสิกรไทย


(นายเอกพัฒน์ กมลสุติพงศ์)

ผู้ช่วยผู้อำนวยการ ฝ่ายบริการธุรกิจหลักทรัพย์



(นางสาวอริยดี ปาละสมิทธิ์)

หัวหน้าส่วน ฝ่ายบริการธุรกิจหลักทรัพย์

วันที่ 8 สิงหาคม พ.ศ. 2557

ผลการดำเนินงาน
ข้อมูล ณ วันที่ 31 กรกฎาคม 2557

ผลตอบแทนจากการลงทุน	ย้อนหลัง 3 เดือน 30 เม.ย. 57 - 31 ก.ค.57	ย้อนหลัง 6 เดือน 31 ม.ค. 57 - 31 ก.ค.57	ย้อนหลัง 1 ปี 31 ก.ค. 56 - 31 ก.ค.57	ย้อนหลัง 3 ปี 29 ก.ค. 54 - 31 ก.ค.57	นับแต่จัดตั้ง กองทุน 20 ต.ค. 39 - 31 ก.ค.57
กองทุน SCBSET	+5.72%	+19.41%	+8.48%	+41.65%	+75.55%
SET Index	+6.18%	+17.90%	+5.57%	+32.54%	+40.23%

หมายเหตุ : เอกสารการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวมฉบับนี้ ได้จัดทำขึ้นตามมาตรฐานการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวมของสมาคมบริษัทจัดการลงทุน

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด
กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ เซ็ท อินเด็กซ์ ฟันด์
รายละเอียดหลักทรัพย์ และสัดส่วนการลงทุน
ณ. วันที่ 31 ก.ค. 2557

ชื่อหลักทรัพย์	ราคา ณ 31 ก.ค. 2557 (บาท)	จำนวนหุ้น (หุ้น)	มูลค่า ตามราคาตลาด (บาท)	ร้อยละของมูลค่า ทรัพย์สินสุทธิ (%)	ค่าประกัน/รับรอง/รับอาวัล หรือสลักหลังโอน แบบมีสิทธิไล่เบี้ย
เงินฝากธนาคาร			259,086,262.93	5.36%	
ธนาคารกรุงไทย จำกัด (มหาชน) (KBANK)			259,086,262.93	5.36%	
หุ้นจดทะเบียน			4,664,754,692.58	96.48%	
ธุรกิจการเกษตร			23,343,500.00	0.48%	
บมจ.จีเอฟพีที (GEPT)	15.20	886,600.00	13,476,320.00	0.28%	
บมจ.ศรีตรังแอโกรินดัสทรี (STA)	14.10	699,800.00	9,867,180.00	0.20%	
ยานยนต์			28,021,966.50	0.58%	
บมจ.อีโนว รับเบอร์ (ประเทศไทย) (IRC)	15.80	432,900.00	6,839,820.00	0.14%	
บมจ.สมุทรแอ็ดวานซ์ เทคโนโลยี (SAT)	17.70	549,545.00	9,726,946.50	0.20%	
บมจ.ไทยสแตนเลย์-การไฟฟ้า (STANLY)	222.00	51,600.00	11,455,200.00	0.24%	
ธนาคาร			848,474,043.70	17.55%	
ธนาคารกรุงศรีอยุธยา จำกัด (มหาชน) (BAY)	51.25	2,246,700.00	115,143,375.00	2.38%	
ธนาคารกรุงเทพ จำกัด (มหาชน) (BBL)	195.00	650,000.00	126,750,000.00	2.62%	
ธนาคาร ซีไอเอ็มบี ไทย จำกัด (มหาชน) (CIMBT)	2.12	8,508,184.00	18,037,350.08	0.37%	
ธนาคารกรุงไทย จำกัด (มหาชน) (KBANK)	209.00	826,100.00	172,654,900.00	3.57%	
ธนาคารเกียรตินาคิน จำกัด (มหาชน) (KKP)	40.25	352,200.00	14,176,050.00	0.29%	
ธนาคารกรุงไทย จำกัด (มหาชน) (KTb)	21.50	4,855,000.00	104,382,500.00	2.16%	
บริษัท แอล เอช ไฟแนนซ์เชียล กรุ๊ป จำกัด (มหาชน) (LHBANK)	1.62	5,111,415.00	8,280,492.30	0.17%	
ธนาคารไทยพาณิชย์ จำกัด (มหาชน) (SCB)	178.00	1,186,400.00	211,179,200.00	4.37%	
บมจ.ทุนขนาด (TCAP)	35.50	512,200.00	18,183,100.00	0.38%	
บมจ.ทิสโก้ไฟแนนเชียลกรุ๊ป (TISCO)	41.50	337,500.00	14,006,250.00	0.29%	
ธนาคารทหารไทย จำกัด (มหาชน) (TMB)	2.84	16,084,798.00	45,680,826.32	0.94%	
พาณิชย์			453,739,214.40	9.38%	
บมจ.บีจีชี ซูเปอร์เซ็นเตอร์ (BIGC)	231.00	321,700.00	74,312,700.00	1.54%	
บมจ.เบอร์ลี่ ยุคเกอร์ (BJC)	56.25	651,400.00	36,641,250.00	0.76%	
บมจ. ซีพี ออลล์ จำกัด (CPALL)	46.25	3,218,600.00	148,860,250.00	3.08%	
บริษัท สยามโกลบอลเฮ้าส์ จำกัด (มหาชน) (GLOBAL)	12.80	1,943,490.00	24,876,672.00	0.51%	
บมจ.โฮม โปรดักส์ เซ็นเตอร์ (HMPRO)	10.30	4,723,908.00	48,656,252.40	1.01%	
บมจ.สยามแม็คโคร (MAKRO)	40.75	1,890,200.00	77,025,650.00	1.59%	
บมจ.ห้างสรรพสินค้าโรบินสัน (ROBINS)	59.00	522,200.00	30,809,800.00	0.64%	
บมจ.สหพัฒน์พิบูล (SPC)	40.00	153,666.00	6,146,640.00	0.13%	
บมจ.สหพัฒนาอินเตอร์โฮลดิ้ง (SPI)	25.00	256,400.00	6,410,000.00	0.13%	
เทคโนโลยีสารสนเทศและการสื่อสาร			536,519,227.50	11.10%	
บมจ. แอดวานซ์ อินโฟร์ เซอร์วิส (ADVANC)	208.00	1,079,200.00	224,473,600.00	4.64%	
บริษัท โทเทิล แอ็คเซ็ส คอมมูนิเคชั่น จำกัด (มหาชน) (DTAC)	103.50	894,395.00	92,569,882.50	1.91%	
บมจ.อินทัช โฮลดิ้งส์ (INTUCH)	68.50	1,177,900.00	80,686,150.00	1.67%	
บมจ.จัสมิน อินเตอร์เนชั่นแนล (JAS)	7.50	3,309,100.00	24,818,250.00	0.51%	
บมจ.สามารดคอร์ปอเรชั่น (SAMART)	22.70	657,500.00	14,925,250.00	0.31%	
บมจ.สามารด โอ-โมบาย (SIM)	3.40	2,757,300.00	9,374,820.00	0.19%	
บมจ.ไทยคม (THCOM)	35.50	599,900.00	21,296,450.00	0.44%	
บมจ.ทรู คอร์ปอเรชั่น (TRUE)	9.50	5,182,697.00	49,235,621.50	1.02%	
บมจ.ทรู คอร์ปอเรชั่น (TRUE/R)	9.50	2,014,653.00	19,139,203.50	0.40%	

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด
กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ เชื้อ อินเด็กซ์ ฟันด์
รายละเอียดหลักทรัพย์ และสัดส่วนการลงทุน
ณ. วันที่ 31 ก.ค. 2557

ชื่อหลักทรัพย์	ราคา ณ 31 ก.ค. 2557 (บาท)	จำนวนหุ้น (หุ้น)	มูลค่า ตามราคาตลาด (บาท)	ร้อยละของมูลค่า ทรัพย์สินสุทธิ (%)	ค่าประกัน/รับรอง/รับอาวัล หรือสลากหลังโอน แบบมีสิทธิไล่เบี่ย
วัตถุดิบ			279,836,969.00	5.79%	
บมจ. ไดนาสตีเซรามิก (DCC)	61.00	231,500.00	14,121,500.00	0.29%	
บมจ.ปูนซิเมนต์ไทย (SCC)	434.00	423,900.00	183,972,600.00	3.80%	
บมจ.ปูนซิเมนต์นครหลวง (SCCC)	442.00	88,200.00	38,984,400.00	0.81%	
บมจ.ทีพีไอ แก๊สเฟส (TASCO)	60.50	223,778.00	13,538,569.00	0.28%	
บมจ.ทีพีไอ โพลีน (TPIPL)	14.50	1,315,700.00	19,077,650.00	0.39%	
บมจ.สหโมเสกอุตสาหกรรม (UMI)	7.50	1,352,300.00	10,142,250.00	0.21%	
ชิ้นส่วนอิเล็กทรอนิกส์			55,784,229.92	1.15%	
บมจ.แกล-คอมพ์ อิเล็กทรอนิกส์ (ประเทศไทย) (CCET)	3.06	2,559,232.00	7,831,249.92	0.16%	
บมจ.เดลต้า อิเล็กทรอนิกส์ (ประเทศไทย) (DELTA)	62.00	532,040.00	32,986,480.00	0.68%	
บมจ.ฮานา ไมโครอิเล็กทรอนิกส์ (HANA)	37.00	404,500.00	14,966,500.00	0.31%	
พลังงานและสาธารณูปโภค			842,675,918.80	17.43%	
บมจ.บ้านปู (BANPU)	31.00	815,500.00	25,280,500.00	0.52%	
บมจ.บางจากปิโตรเลียม (BCP)	28.75	616,000.00	17,710,000.00	0.37%	
บมจ.จัดการและพัฒนาทรัพยากรน้ำภาคตะวันออก (EASTW)	11.00	942,300.00	10,365,300.00	0.21%	
บริษัท ผลิตไฟฟ้า จำกัด (มหาชน) (EGCO)	146.00	172,600.00	25,199,600.00	0.52%	
บมจ.เอสโซ่ (ประเทศไทย) (ESSO)	5.95	1,973,800.00	11,744,110.00	0.24%	
บมจ.โกลว์ พลังงาน (GLOW)	85.00	522,200.00	44,387,000.00	0.92%	
บมจ. กันกุลเอ็นจิเนียริง (GUNKUL)	15.60	1,322,133.00	20,625,274.80	0.43%	
บมจ.ไออาร์พีซี (IRPC)	3.38	8,399,800.00	28,391,324.00	0.59%	
บมจ.ปตท. (PTT)	319.00	1,008,900.00	321,839,100.00	6.66%	
บมจ.ปตท.สำรวจและผลิตปิโตรเลียม (PTTEP)	162.50	1,423,124.00	231,257,650.00	4.78%	
บมจ.ผลิตไฟฟ้าราชบุรีโฮลดิ้ง (RATCH)	54.25	450,400.00	24,434,200.00	0.51%	
บมจ.สยามแก๊ส แอนด์ ปิโตรเคมีคัลส์ (SGP)	15.80	582,600.00	9,205,080.00	0.19%	
บมจ.เอสพีซีจี (SPCG)	24.80	507,100.00	12,576,080.00	0.26%	
บมจ.ไทยออยล์ (TOP)	51.75	789,200.00	40,841,100.00	0.84%	
บมจ.ทีทีดับบลิว (TTW)	12.00	1,568,300.00	18,819,600.00	0.39%	
แพ่ง			7,219,700.00	0.15%	
บมจ.ซาบิโน (SABINA)	23.00	313,900.00	7,219,700.00	0.15%	
เงินทุนและหลักทรัพย์			28,025,760.00	0.58%	
บมจ.อิชออน ธนสินทรัพย์ (ไทยแลนด์) (AEONTS)	104.00	156,100.00	16,234,400.00	0.34%	
บมจ.เงินทุนธนสยาม (DS)		19,800.00	0.00	0.00%	
บมจ.เงินทุนเอกรักษ์ (FINI)		10,600.00	0.00	0.00%	
บมจ.หลักทรัพย์ เมย์แบงก์ กิมเอ็ง (ประเทศไทย) (MBKET)	22.40	526,400.00	11,791,360.00	0.24%	
บมจ.เงินทุนหลักทรัพย์ซีทีบี (SITCA)		13,000.00	0.00	0.00%	
อาหารและเครื่องดื่ม			241,311,470.50	4.99%	
บมจ.เจริญโภคภัณฑ์อาหาร (CPF)	26.75	2,787,300.00	74,560,275.00	1.54%	
บมจ.น้ำตาลขอนแก่น (KSL)	13.30	1,176,800.00	15,651,440.00	0.32%	
บมจ.เอ็มเค เรสโตรองด์ กรุ๊ป (M)	64.25	348,000.00	22,359,000.00	0.46%	
บมจ.ไมเนอร์ อินเตอร์เนชั่นแนล (MINT)	32.25	1,739,326.00	56,093,263.50	1.16%	
บมจ.โออิชิ กรุ๊ป (OISHI)	96.50	107,300.00	10,354,450.00	0.21%	

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด
กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ เซ็ท อินเด็กซ์ ฟันด์
รายละเอียดหลักทรัพย์ และสัดส่วนการลงทุน
ณ. วันที่ 31 ก.ค. 2557

ชื่อหลักทรัพย์	ราคา ณ 31 ก.ค. 2557 (บาท)	จำนวนหุ้น (หุ้น)	มูลค่า ตามราคาตลาด (บาท)	ร้อยละของมูลค่า ทรัพย์สินสุทธิ (%)	กำไร/ขาดทุน/รับรอง/รับอาวัล หรือสลับหลังโอน แบบมีสิทธิไต่เบี่ย
บมจ.ไทยเพอร์ซิเคนท์ฟูดส์ (TF)	166.00	83,900.00	13,927,400.00	0.29%	
บมจ.ไทยยูเนี่ยน โฟรเซ่น โปรดักส์ (TUF)	65.50	494,204.00	32,370,362.00	0.67%	
บมจ.น้ำมันพืชไทย (TVO)	22.40	714,075.00	15,995,280.00	0.33%	
การแพทย์			168,511,042.50	3.49%	
บมจ. บางกอก เชน ฮอस्पิตอล (BCH)	9.15	1,676,950.00	15,344,092.50	0.32%	
บมจ.กรุงเทพดุสิตเวชการ (BGH)	17.00	6,558,000.00	111,486,000.00	2.31%	
บมจ. โรงพยาบาลบำรุงราษฎร์ (BH)	120.50	345,900.00	41,680,950.00	0.86%	
ของใช้ในครัวเรือนและสำนักงาน			7,963,200.00	0.16%	
บมจ.ศรีไทยซูเปอร์แวร์ (SITHAI)	2.40	3,318,000.00	7,963,200.00	0.16%	
ประกันภัยและประกันชีวิต			111,075,798.00	2.30%	
บมจ.กรุงเทพประกันภัย (BKJ)	352.00	57,849.00	20,362,848.00	0.42%	
บริษัท กรุงเทพประกันชีวิต จำกัด (มหาชน) (BLA)	93.00	529,700.00	49,262,100.00	1.02%	
บริษัท ไทยพาณิชย์ประกันชีวิต จำกัด (มหาชน) (SCBLIF)	1,134.00	29,350.00	33,282,900.00	0.69%	
บมจ.ไทยรับประกันภัยต่อ (THRE)	3.50	2,333,700.00	8,167,950.00	0.17%	
สื่อและสิ่งพิมพ์			87,650,367.20	1.81%	
บมจ.บีอีซี เวิลด์ (BEC)	50.00	852,800.00	42,640,000.00	0.88%	
บมจ.ไอทีวี (ITV)		585,200.00	0.00	0.00%	
บมจ.เมเจอร์ ซินีเพล็กซ์ กรุ๊ป (MAJOR)	19.80	503,400.00	9,967,320.00	0.21%	
บมจ.อสมท (MCOT)	25.75	374,800.00	9,651,100.00	0.20%	
บมจ.วี จี ไอ โกลบอล มีเดีย (VGI)	12.90	1,968,368.00	25,391,947.20	0.53%	
เหมืองแร่			12,867,740.00	0.27%	
บมจ.ผาแดงอินดัสทรี (PDI)	17.30	743,800.00	12,867,740.00	0.27%	
บรรจุภัณฑ์			5,832,090.00	0.12%	
บมจ. โพลีเพล็กซ์ (ประเทศไทย) (PTL)	9.90	589,100.00	5,832,090.00	0.12%	
ปิโตรเคมีและเคมีภัณฑ์			162,708,947.00	3.37%	
บมจ. อินโดรามา เวนเจอร์ส (IVL)	26.25	1,683,800.00	44,199,750.00	0.91%	
บมจ.พีทีที โกลบอล เคมิคอล (PTTGC)	65.75	1,546,136.00	101,658,442.00	2.10%	
บมจ.ไทยเชนทรัลเคมี (TCCC)	29.50	344,100.00	10,150,950.00	0.21%	
บมจ.วินิไทย (VNT)	10.70	626,150.00	6,699,805.00	0.14%	
พัฒนาอสังหาริมทรัพย์			482,435,240.26	9.98%	
บมจ.อมตะ คอร์ปอเรชั่น (AMATA)	16.90	809,500.00	13,680,550.00	0.28%	
บมจ.เอพี (ไทยแลนด์) (AP)	6.80	1,848,960.00	12,572,928.00	0.26%	
บมจ.บางกอกแลนด์ (BLAND)	2.08	13,184,400.00	27,423,552.00	0.57%	
บมจ.ช.การช่าง (CK)	25.00	698,105.00	17,452,625.00	0.36%	
บมจ.เซ็นทรัลพัฒนา (CPN)	47.75	1,760,600.00	84,068,650.00	1.74%	
บมจ.เหมราชพัฒนาที่ดิน (HEMRAJ)	3.68	5,424,900.00	19,963,632.00	0.41%	
บมจ.อิตาเลียนไทย ดีเวลล็อปเมนต์ (ITD)	5.20	3,290,775.00	17,112,030.00	0.35%	
บมจ.แลนด์แอนด์เฮาส์ (LH)	9.45	4,856,720.00	45,896,004.00	0.95%	
บมจ.แอล.พี.เอ็น. ดีเวลลอปเมนท์ (LPN)	22.00	868,700.00	19,111,400.00	0.40%	
บมจ.เอ็ม บี เค (MBK)	16.00	816,000.00	13,056,000.00	0.27%	
บมจ.พญา เรียลเอสเตท (PS)	33.50	1,031,300.00	34,548,550.00	0.71%	
บมจ.ควอลิตี้เฮาส์ (QH)	3.94	4,607,625.00	18,154,042.50	0.38%	
บมจ.สวนอุตสาหกรรมโรจนะ (ROJNA)	7.70	1,019,000.00	7,846,300.00	0.16%	
บมจ.เอสซี เอสเตท คอร์ปอเรชั่น (SC)	3.80	3,135,125.00	11,913,475.00	0.25%	

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด
 กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ เซ็ท อินเด็กซ์ ฟันด์
 รายละเอียดหลักทรัพย์ และสัดส่วนการลงทุน
 ณ วันที่ 31 ก.ค. 2557

ชื่อหลักทรัพย์	ราคา ณ 31 ก.ค. 2557 (บาท)	จำนวนหุ้น (หุ้น)	มูลค่า ตามราคาตลาด (บาท)	ร้อยละของมูลค่า ทรัพย์สินสุทธิ (%)	ค่าประกัน/รับรอง/รับอาวัล หรือสลักหลังโอน แบบมีสิทธิไต่เบี่ย
บมจ.แสนสิริ (SIRI)	2.02	6,323,308.00	12,773,082.16	0.26%	
บมจ.สุภาลัย (SPALI)	24.00	930,300.00	22,327,200.00	0.46%	
บมจ.ซิโน-ไทย เอ็นจีเนียริงแอนด์คอนสตรัคชั่น (STEC)	23.80	842,785.00	20,058,283.00	0.41%	
บมจ.เอสทีพี แอนด์ ไอ (STPI)	19.60	871,656.00	17,084,457.60	0.35%	
บมจ.ไทยพัฒนาโรงงานอุตสาหกรรม (TFD)	6.10	1,470,600.00	8,970,660.00	0.19%	
บมจ.ไทคอน อินดัสเทรียล คอนเน็คชั่น (TICON)	17.50	601,900.00	10,533,250.00	0.22%	
บริษัท โตโฮ-ไทย คอร์ปอเรชั่น จำกัด (มหาชน) (TTCL)	33.50	368,975.00	12,360,662.50	0.26%	
บมจ.ยูนิ เวเนเจอร์ (UV)	9.10	1,629,300.00	14,826,630.00	0.31%	
บมจ. ดับบลิวเอชเอ คอร์ปอเรชั่น (WHA)	34.50	600,037.00	20,701,276.50	0.43%	
การท่องเที่ยวและสันทนาการ			54,771,503.00	1.13%	
บมจ. โรงแรมเซ็นทรัลพลาซา (CENTEL)	38.25	638,700.00	24,430,275.00	0.51%	
บมจ.ดิ เอราวัณ กรุ๊ป (ERW)	4.64	2,957,700.00	13,723,728.00	0.28%	
บมจ.ลาгуน่า รีสอร์ท แอนด์ โฮเทล (LRH)	32.50	164,000.00	5,330,000.00	0.11%	
บมจ.โอเอชทีแอล (OHTL)	750.00	15,050.00	11,287,500.00	0.23%	
ขนส่งและโลจิสติกส์			225,986,764.30	4.67%	
บมจ. เอเชีย เอวิเอชั่น (AAV)	4.44	3,521,100.00	15,633,684.00	0.32%	
บมจ.ท่าอากาศยานไทย (AOT)	214.00	524,500.00	112,243,000.00	2.32%	
บมจ.ทางด่วนกรุงเทพ (BECL)	37.25	366,200.00	13,640,950.00	0.28%	
บริษัท บีทีเอส กรุ๊ป โฮลดิ้งส์ จำกัด (มหาชน) (BTS)	8.55	5,216,756.00	44,603,263.80	0.92%	
บมจ.พีริเซียส ชิปปิ้ง (PSL)	23.90	506,100.00	12,095,790.00	0.25%	
บมจ.อาร์ ซี แอล (RCL)	7.65	1,864,400.00	14,262,660.00	0.29%	
บมจ.การบินไทย (THAI)	15.70	860,345.00	13,507,416.50	0.28%	
รวมหลักทรัพย์ประเภทหุ้น			4,664,754,692.58	96.48%	
เงินฝากธนาคาร			1,098,264.44	0.02%	
ธนาคาร ยูโอบี จำกัด (มหาชน) (UOBT)			1,098,264.44	0.02%	
หุ้นไม่จดทะเบียน			0.00	0.00%	
ใบสำคัญแสดงสิทธิ				%	
บมจ.วีจี ไอ โกลบอล มีเดีย (VGI-WI/U)		492,092.00	0.00	0.00%	
สินทรัพย์อื่น ๆ			3,318,504.58	0.07%	
หนี้สิน			-93,095,120.60	-1.93%	
มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ			4,835,162,603.93	100.00%	
มูลค่าหน่วยลงทุน (บาท)			17.5554		

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด
กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ เซ็ท อินเด็กซ์ ฟันด์
รายงานสรุปเงินลงทุน
ณ วันที่ 31 กรกฎาคม 2557

กลุ่มของตราสาร	มูลค่าตามราคาตลาด	%NAV
(ก) ตราสารภาครัฐ ได้แก่ ตัวแลกเงิน พันธบัตรรัฐบาล พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย พันธบัตร หรือตราสารแห่งหนึ่งที่กองทุนเพื่อการฟื้นฟูและพัฒนา ระบบสถาบันการเงิน หรือกระทรวงการคลัง เป็นผู้ออก ผู้รับรอง ผู้รับอาวัล หรือผู้ค้ำประกัน	-	-
(ข) ตราสารที่ธนาคารที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้น ธนาคารพาณิชย์ หรือบริษัทเงินทุนเป็นผู้ออก ผู้รับรอง ผู้รับอาวัล ผู้สลักหลัง หรือผู้ค้ำประกัน	260,303,306.00	5.38
(ค) ตราสารที่มีบริษัทที่ได้รับ rating ในระดับ investment grade เป็นผู้ออก ผู้รับรอง ผู้รับอาวัล ผู้สลักหลัง หรือผู้ค้ำประกัน	-	-
(ง) ตราสารที่มีบริษัทที่ได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือในระดับที่ต่ำกว่า investment grade หรือไม่มี rating เป็นผู้ออก ผู้รับรอง ผู้รับอาวัล ผู้สลักหลัง หรือผู้ค้ำประกัน	-	-

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

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด
 กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ เซ็ท อินเด็กซ์ ฟันด์
 รายละเอียดตัวตราสารและอันดับความน่าเชื่อถือของตราสารทุกตัวใน Port
 ณ วันที่ 31 กรกฎาคม 2557

ประเภท	ผู้ออก	ผู้ค้ำ/ผู้รับรอง/ผู้หลักประกัน	วันครบกำหนด	อันดับความน่าเชื่อถือของผู้ออกตราสาร		มูลค่าหน้าตั๋ว	มูลค่าตามราคาตลาด
				TRIS Rating	FITCH Rating		
พันธบัตร							-
ตั๋วสัญญาใช้เงิน (ธนาคาร)							-
ตั๋วสัญญาใช้เงิน							-
ตั๋วแลกเงิน (บริษัท)							-
ตั๋วแลกเงิน							-
หุ้นกู้							-
อื่น ๆ	ธนาคาร ยู โอ บี จำกัด (มหาชน)		31/12/2050		AAA	1,098,264.44	1,099,850.15

กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ เซ็ท อินเด็กซ์ ฟันด์

SCB SET INDEX OPEN-ENDED FUND

แบบค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม

FUND'S DIRECT EXPENSES REPORT

ตั้งแต่วันที่ 01 กุมภาพันธ์ 2557 ถึงวันที่ 31 กรกฎาคม 2557

Period from 01 February 2014 to 31 July 2014

ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม *	จำนวนเงิน หน่วย : พันบาท	ร้อยละต่อปีของ มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ
Fund's direct expenses		
ค่าธรรมเนียมการจัดการ (Management fee)	22,421	0.99
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ (Trustee fee)	724	0.03
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน (Registrar fee)	-	-
ค่าที่ปรึกษาการลงทุน (Advisory fee)	-	-
ค่าใช้จ่ายอื่น ๆ (Other expenses)	258	0.01
รวมค่าใช้จ่ายทั้งหมด (Total Expense) **	23,403	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 2557

"ยังไม่ได้ตรวจสอบ"

"ยังไม่ได้สอบทาน"

บาท

สินทรัพย์

เงินลงทุนตามราคายุติธรรม

4,665,852,957.02

เงินสดและเงินฝากธนาคาร

259,086,262.93

ลูกหนี้จากเงินปันผลและดอกเบี้ย

3,166,241.49

ลูกหนี้อื่น

5,204.12

ค่าใช้จ่ายรอตัดบัญชี

147,058.97

รวมสินทรัพย์

4,928,257,724.53

หนี้สิน

เจ้าหนี้จากการซื้อเงินลงทุน

27,917,838.30

เจ้าหนี้จากการรับซื้อคืนส่วนได้เสีย

60,709,797.20

ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย

4,354,855.25

หนี้สินอื่น

112,629.85

รวมหนี้สิน

93,095,120.60

สินทรัพย์สุทธิ

4,835,162,603.93

สินทรัพย์สุทธิ :-

ทุนที่ได้รับจากผู้ถือหน่วยลงทุน

2,754,217,367.42

กำไรสะสม

2,672,983,958.98

บัญชีปรับสมดุล

-592,038,722.47

สินทรัพย์สุทธิ

4,835,162,603.93

จำนวนหน่วยลงทุนที่จำหน่ายแล้ว (หน่วย)

275,421,736.75

สินทรัพย์สุทธิต่อหน่วยลงทุน

17.5554

กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ เซ็ท อินเด็กซ์ ฟันด์ (SCBSET)

งบกำไรขาดทุน

รอบระยะเวลาตั้งแต่วันที่ 1 กุมภาพันธ์ 2557 ถึงวันที่ 31 กรกฎาคม 2557

"ยังไม่ได้ตรวจสอบ"

"ยังไม่ได้สอบทาน"

บาท

รายได้จากการลงทุน

รายได้เงินปันผล

90,577,921.19

รายได้ดอกเบี้ย

487,107.07

รายได้ทั้งสิ้น

91,065,028.26

ค่าใช้จ่าย

ค่าธรรมเนียมจัดการ

22,420,853.55

ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์

724,421.74

ค่าสอบบัญชี

148,767.52

ค่าใช้จ่ายอื่น

109,491.83

ค่าใช้จ่ายทั้งสิ้น

23,403,534.64

รายได้จากการลงทุนสุทธิ

67,661,493.62

รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิจากเงินลงทุน

รายการขาดทุนสุทธิที่เกิดขึ้นจริง

-4,269,298.54

รายการกำไรสุทธิที่ยังไม่เกิดขึ้นจริง

739,199,725.81

รวมรายการกำไร(ขาดทุน)จากการลงทุนที่เกิดขึ้นและที่ยังไม่เกิดขึ้น

734,930,427.27

การเพิ่มขึ้นในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงาน

802,591,920.89

รายงานการซื้อขายหลักทรัพย์และค่าใช้จ่ายต่าง ๆ

VOLUME TRADE AND EXPENSES REPORT

ตั้งแต่วันที่ 3 กุมภาพันธ์ 2557 ถึง วันที่ 31 กรกฎาคม 2557

Period from 3 February 2014 to 31 July 2014

	(พันบาท) / (Thousand Baht)
มูลค่าทรัพย์สินสุทธิเฉลี่ย / Average Net Assets Value	4,550,670
การซื้อขายหลักทรัพย์รวม / Volume Trade	
มูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์รวม	649,498
Total Volume Trade	
ค่าธรรมเนียมหน้าในการซื้อขายหลักทรัพย์รวม	385
Total Brokerage Fee	
ค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายอื่น ๆ รวม / Fee and other Expenses	23,403
	(ร้อยละ) / (Percentage)
<ul style="list-style-type: none"> สัดส่วนค่าธรรมเนียมหน้าในการซื้อขายหลักทรัพย์รวมคิดเป็นร้อยละของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์รวม 	0.06
Brokerage Fee as	
Percentage of Total Trading Volume	
<ul style="list-style-type: none"> สัดส่วนค่าธรรมเนียมหน้าในการซื้อขายหลักทรัพย์รวมคิดเป็นร้อยละของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิเฉลี่ย 	0.02
Brokerage Fee as	
Percentage of Average Net Assets Value	
<ul style="list-style-type: none"> สัดส่วนค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายอื่น ๆ รวมคิดเป็นร้อยละของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิเฉลี่ย 	1.03
Fee and other Expenses as	
Percentage of Average Net Assets Value	

รายงานรายชื่อบริษัทนายหน้า และค่าธรรมเนียม ซื้อ-ขาย หลักทรัพย์
ของกองทุนเปิดไทยพาณิชย์ เซ็ท อินเด็กซ์ ฟันด์
ระหว่างวันที่ 3 กุมภาพันธ์ 2557 ถึง 31 กรกฎาคม 2557

ลำดับที่	ชื่อบริษัทนายหน้า	ค่านายหน้า (พันบาท)	อัตราส่วนค่านายหน้าแต่ละราย ต่อค่านายหน้าทั้งหมด
1	บมจ.หลักทรัพย์ เคจีไอ (ประเทศไทย)	203.21	52.81%
2	บริษัทหลักทรัพย์ ไทยพาณิชย์ จำกัด	179.78	46.72%
3	บมจ.หลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส	1.72	0.45%
4	บมจ.หลักทรัพย์ ยูโอบี เคย์เฮียน (ประเทศไทย)	0.07	0.02%
รวม		384.78	100.00%

การรับผลประโยชน์ตอบแทนเนื่องจากการที่กองทุนให้บริการบุคคลอื่น ประจำปีงบการเงิน 2557

BENEFIT FROM BROKERAGE SERVICES AS OF JULY 2014

บริษัทที่ให้บริการ	BROKERAGE HOUSES	ผลประโยชน์ที่ได้รับ					
		บทวิเคราะห์ ¹ Research Paper	ข้อมูลพื้นฐาน ² Fundamental Data	รายงานสรุปข่าว ³ News Summary	สัมมนา ⁴ Seminar	บรรยายกลยุทธ์การลงทุน ⁵ Strategy Presentation	จัดเยี่ยมชมบริษัท ⁶ Company Visit
บริษัทหลักทรัพย์ เอเชีย พลัส จำกัด (มหาชน)	ASIA PLUS SECURITIES PUBLIC COMPANY LIMITED	✓	✓	✓		✓	
บริษัทหลักทรัพย์ บัวหลวง จำกัด (มหาชน)	BUALUANG SECURITIES PUBLIC COMPANY LIMITED	✓	✓	✓	✓	✓	✓
บริษัทหลักทรัพย์ ซี แอส เอช (ประเทศไทย) จำกัด	CLS SECURITIES (THAILAND) LIMITED	✓	✓	✓	✓	✓	✓
บริษัทหลักทรัพย์ นิบูระ ฟินนัง จำกัด (มหาชน)	CAPITAL NISUBURA SECURITIES PUBLIC COMPANY LIMITED	✓	✓	✓		✓	✓
บริษัทหลักทรัพย์เครดิต สวิส (ประเทศไทย) จำกัด	CREDIT SUISSE SECURITIES (THAILAND) LIMITED	✓	✓	✓		✓	
บริษัทหลักทรัพย์ เมย์แบงก์ คิมเอ็ง (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)	MAYBANK KIM ENG SECURITIES (THAILAND) PUBLIC COMPANY LIMITED	✓	✓	✓		✓	✓
บริษัทหลักทรัพย์ คัสโตรไทย จำกัด (มหาชน)	KASIKORN SECURITIES PUBLIC COMPANY LIMITED	✓	✓	✓		✓	✓
บริษัทหลักทรัพย์ ฟิรา จำกัด (มหาชน)	PHATRA SECURITIES PUBLIC COMPANY LIMITED	✓	✓	✓		✓	✓
บริษัทหลักทรัพย์ ไทยพาณิชย์ จำกัด	SCB SECURITIES COMPANY LIMITED	✓	✓	✓		✓	✓
บริษัทหลักทรัพย์ธนชาต จำกัด (มหาชน)	THANACHART SECURITIES PUBLIC COMPANY LIMITED	✓	✓	✓	✓	✓	
บริษัทหลักทรัพย์ ทีเอสซี จำกัด	TISCO SECURITIES COMPANY LIMITED	✓	✓	✓		✓	✓
บริษัทหลักทรัพย์ ซีไอเอ็มบี (ประเทศไทย) จำกัด	CIB SECURITIES (THAILAND) CO., LTD	✓	✓	✓	✓	✓	✓
บริษัทหลักทรัพย์ ยูบีเอส (ประเทศไทย) จำกัด	UBS SECURITIES (THAILAND) LIMITED	✓	✓	✓		✓	
บริษัทหลักทรัพย์ เจพีมอร์แกน (ประเทศไทย) จำกัด	JPMORGAN SECURITIES (THAILAND) LIMITED	✓	✓	✓		✓	
บริษัทหลักทรัพย์ เอจีไอ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)	IGI SECURITIES (THAILAND) PUBLIC COMPANY LIMITED	✓	✓	✓		✓	
บริษัทหลักทรัพย์ ดีบีเอส วิคเคอร์ส (ประเทศไทย) จำกัด	DBS VICKERS SECURITIES (THAILAND) COMPANY LIMITED	✓	✓	✓		✓	
บริษัทหลักทรัพย์ อาร์เอสบี โอลด์ส (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)	RBS ORSKIN SECURITIES (THAILAND) PUBLIC COMPANY LIMITED	✓	✓	✓		✓	✓
บริษัทหลักทรัพย์ ยูบีเค เคียทัน (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)	UBK KAYTHAN SECURITIES (THAILAND) PUBLIC COMPANY LIMITED	✓	✓	✓		✓	

ผลประโยชน์ที่ได้รับ SERVICES

1. บทวิเคราะห์ (รายงานวิเคราะห์สภาพตลาดรายวัน, รายเดือน, รายไตรมาส) Analysis Reports (Market Summary and Companies updated analysis on daily, monthly and quarterly basis)
2. ข้อมูลพื้นฐาน (ข้อมูลตลาดฯ, รายการเงิน บง. ย่อยลง) (Fundamental Data (Market and historical financial data of listed companies))
3. รายงานสรุปข่าวรายวัน และติดตามข่าวผ่าน ผ่าน SMS (Daily news summary and urgent news via SMS)
4. จัดสัมมนาทางวิชาการหรือกิจกรรมอื่นๆ (Arrangement of Seminars on Economics or Industries Issues)
5. บรรยายสรุปกลยุทธ์การลงทุนรายไตรมาส (Strategy Presentation on quarterly basis)
6. จัดเยี่ยมชมบริษัทที่กองทุนสนใจลงทุน (Company Visit arrangement to companies of interest)

ข้อมูลการดำเนินการ ใช้สิทธิออกเสียงในที่ประชุมผู้ถือหุ้นในนามกองทุนรวมของรอบปีปฏิทินล่าสุด
สามารถตรวจสอบข้อมูลได้จาก Website : www.scbmm.com