



# Mutual Funds Report

กองทุนเปิดไทยพาณิชย์  
เชิร์ท อินเด็กซ์ ฟันด์

รายงานประจำ 6 เดือน

ตั้งแต่วันที่ 1 กุมภาพันธ์ 2560 ถึงวันที่ 31 กรกฎาคม 2560

## สารจากบริษัทจัดการ

### เรียน ท่านผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุน

กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ เซ็ท อินเด็กซ์ ฟันด์ (SCBSET) เป็นกองทุนที่ลงทุนในหลักทรัพย์จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ ดังนั้นผลตอบแทนของกองทุนจะผันผวนตามดัชนีตลาดหลักทรัพย์ (SET Index) โดยในรอบปีบัญชีตั้งแต่วันที่ 1 กุมภาพันธ์ 2560 ถึง 31 กรกฎาคม 2560 ดัชนีตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยปรับตัวลดลงเล็กน้อยคิดเป็นร้อยละ 0.1 มาปิดที่ 1576.08 จุด

ในช่วงต้นไตรมาสที่ 1 ของปี 2560 โดยรวมตลาดหุ้นไทยไม่มีปัจจัยหนุนทิศทางการเคลื่อนไหวของตลาดที่ชัดเจนมากนัก ระหว่างไตรมาสมีปัจจัยลบภายในประเทศเข้ามากดดันความเชื่อมั่นในการลงทุน ได้แก่ ข่าวการเก็บภาษีเชื้อเพลิงเครื่องบิน ไปจนถึง คำตัดสินของศาลกรณีโรงไฟฟ้าพลังงานลมจัดตั้งบนพื้นที่ ส.ป.ก. และการเลื่อนประมูลโครงการรถไฟรางคู่ของภาครัฐ อย่างไรก็ตาม ยังมีปัจจัยบวกจากเศรษฐกิจประเทศกลุ่มพัฒนาแล้วที่สามารถฟื้นตัวแข็งแกร่งต่อเนื่อง เข้ามาผลักดันให้ดัชนี SET index ปรับตัวขึ้นไปทดสอบจุดสูงสุดของช่วงเวลาที่ระดับใกล้ 1600 จุด โดยเฉพาะปัจจัยหนุนจากการเข้ารับตำแหน่งของ ปธน. ทรมป์ ของสหรัฐฯ การเลือกตั้งในฝรั่งเศส ที่จะเกิดขึ้นในเดือน เม.ย. โดยเริ่มมีกระแสว่าฝ่ายที่สนับสนุนนโยบายต่อต้านสหภาพยุโรปอาจชนะการเลือกตั้งรอบแรก นอกจากนี้การปรับขึ้นอัตราดอกเบี้ยนโยบายของเฟด ก็ออกมาตามคาดการณ์ของตลาด และตามภาวะการฟื้นตัวของเศรษฐกิจอเมริกา

ภาพรวมการลงทุนในตลาดหลักทรัพย์ไทยไตรมาส 2 ปี 2560 ดัชนีตลาดหุ้นไทยแกว่งตัวในรอบ 1530-1590 จุด ปัจจัยที่ส่งผลกระทบต่อตลาดหุ้นได้แก่ ราคาน้ำมันปรับตัวลงจากระดับ \$53/bbl สู่ \$45/bbl ในช่วงเดือนเมษายน และ ผลประกอบการของกลุ่มธนาคารไทยไตรมาส 1/60 ที่แสดงถึงสัญญาณความอ่อนแอทั้งจากคุณภาพสินทรัพย์ และการขยายตัวของสินเชื่อ โดยเฉพาะความกังวลในกลุ่มสินเชื่อผู้ประกอบการรายย่อย (SME) ทำให้ธนาคารปรับลดอัตราดอกเบี้ยเงินกู้ MLR-MRR อันจะกระทบกำไรของธุรกิจ อย่างไรก็ตามตลาดหุ้นไทยยังมีปัจจัยบวกที่ผลักดันตลาดให้มาปิดที่ระดับ 1574.74 ณ สิ้นไตรมาส จากการที่ราคาน้ำมันได้ฟื้นตัวสู่ \$52/bbl อันมีผลจากการประชุมกลุ่ม OPEC ที่สามารถบรรลุข้อตกลงในการต่ออายุมาตรการปรับลดกำลังการผลิตออกไป นอกจากนี้ยังมีความคืบหน้าการลงทุนโครงสร้างพื้นฐาน ทำให้สภาวะการลงทุนในตลาดหุ้นไทยกลับมาน่าสนใจมากขึ้น เมื่อเทียบกับดัชนีตลาดหุ้นอื่นในภูมิภาค

ภาพรวมการลงทุนในตลาดหุ้นไทยในช่วงครึ่งปีหลังของปี 2560 มีแนวโน้มที่จะเคลื่อนไหวในระดับที่สูงกว่าในช่วงครึ่งปีแรกของปีที่เหนือระดับ 1600 จุด เนื่องจากได้รับแรงสนับสนุนทั้งปัจจัยพื้นฐานด้านเศรษฐกิจ ตั้งแต่การผลักดันโครงการลงทุนโครงสร้างพื้นฐานภาครัฐได้แก่ โครงการรถไฟรางคู่มูลค่าหลายแสนลบ. และรถไฟความเร็วสูง ไทย-จีน ที่คาดว่าจะเริ่มการก่อสร้างได้ภายในปีนี้ รวมถึงการส่งเสริมการลงทุนภาครัฐในเขตเศรษฐกิจพิเศษอีอีซีที่เริ่มได้รับความสนใจจากนักลงทุนต่างชาติ อย่างไรก็ตาม ยังมีปัจจัยเสี่ยงภายนอกจากภาวะเศรษฐกิจในต่างประเทศที่ยังต้องติดตามที่สำคัญได้แก่ การต่ออายุเพดานหนี้สหรัฐ การปรับลดขนาดสินทรัพย์ของเฟด และ การเลือกตั้งในเยอรมนี และอิตาลี

สุดท้ายนี้ บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด ขอขอบคุณผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุนทุกท่าน ที่ได้มอบความไว้วางใจลงทุนในกองทุนรวมของบลจ. ด้วยดีเสมอมา

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด

## ความเห็นของผู้ดูแลผลประโยชน์

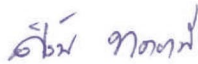
เรียน ผู้ถือหน่วยลงทุน กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ เซ็ท อินเด็กซ์ ฟันด์

ข้าพเจ้า บมจ. ธนาคารกสิกรไทย ในฐานะผู้ดูแลผลประโยชน์ ได้ดูแลการจัดการ กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ เซ็ท อินเด็กซ์ ฟันด์ ซึ่งจัดการโดยบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด สำหรับระยะเวลา ตั้งแต่วันที่ 1 กุมภาพันธ์ พ.ศ. 2560 ถึงวันที่ 31 กรกฎาคม พ.ศ. 2560 แล้ว

ข้าพเจ้าเห็นว่า บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด ได้ปฏิบัติหน้าที่ ในการจัดการ กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ เซ็ท อินเด็กซ์ ฟันด์ เหมาะสมตามสมควรแห่งวัตถุประสงค์ ที่ได้กำหนดไว้ในโครงการและภายใต้พระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535

ผู้ดูแลผลประโยชน์

บมจ. ธนาคารกสิกรไทย



(นางศิริพร ทองธานี)

รองผู้อำนวยการ ฝ่ายบริการธุรกิจหลักทรัพย์



(นางสาวภมรศิริ วัฒนวงศ์พิทักษ์)

หัวหน้าส่วน ฝ่ายบริการธุรกิจหลักทรัพย์

วันที่ 11 สิงหาคม พ.ศ. 2560

ผลการดำเนินงาน  
ข้อมูล ณ วันที่ 31 กรกฎาคม 2560

| ผลตอบแทนจากการลงทุน         | ย้อนหลัง<br>YTD<br>30 ธ.ค. 59 - 31 ก.ค. 60 | ย้อนหลัง<br>3 เดือน<br>28 เม.ย. 60 - 31 ก.ค. 60 | ย้อนหลัง<br>6 เดือน<br>31 มี.ค. 60 - 31 ก.ค. 60 | ย้อนหลัง<br>1 ปี<br>29 ก.ค. 59 - 31 ก.ค. 60 | ย้อนหลัง<br>3 ปี<br>31 ก.ค. 57 - 31 ก.ค. 60 | ย้อนหลัง<br>5 ปี<br>31 ก.ค. 55 - 31 ก.ค. 60 | ย้อนหลัง<br>10 ปี<br>31 ก.ค. 50 - 31 ก.ค. 60 | นับแต่จัดตั้ง<br>กองทุน<br>20 ส.ค. 39 - 31 ก.ค. 60 |
|-----------------------------|--------------------------------------------|-------------------------------------------------|-------------------------------------------------|---------------------------------------------|---------------------------------------------|---------------------------------------------|----------------------------------------------|----------------------------------------------------|
| SCBSET                      | 3.62%                                      | 0.74%                                           | 1.52%                                           | 5.88%                                       | 3.09%                                       | 7.44%                                       | 8.56%                                        | n.a                                                |
| เกณฑ์มาตรฐาน                | 4.21%                                      | 1.08%                                           | 1.93%                                           | 5.50%                                       | 2.29%                                       | 6.04%                                       | 6.46%                                        | n.a                                                |
| ความผันผวนของผลการดำเนินงาน | 4.37%                                      | 2.23%                                           | 3.73%                                           | 10.68%                                      | 12.60%                                      | 14.63%                                      | 20.15%                                       | n.a.                                               |
| ความผันผวนของเกณฑ์มาตรฐาน   | 4.23%                                      | 2.19%                                           | 3.61%                                           | 10.76%                                      | 12.47%                                      | 14.48%                                      | 20.01%                                       | n.a.                                               |

เกณฑ์มาตรฐาน : ดัชนีผลตอบแทนรวมตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET Total Return Index : SET TRI)

หมายเหตุ : เอกสารการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนฉบับนี้ ได้จัดทำขึ้นตามมาตรฐานการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวมของสมาคมบริษัทจัดการลงทุน

ผลการดำเนินงาน  
ข้อมูล ณ วันที่ 31 กรกฎาคม 2560

| ผลตอบแทนจากการลงทุน         | ย้อนหลัง<br>YTD<br>30 ธ.ค. 59 - 31 ก.ค. 60 | ย้อนหลัง<br>3 เดือน<br>28 เม.ย. 60 - 31 ก.ค. 60 | ย้อนหลัง<br>6 เดือน<br>31 ม.ค. 60 - 31 ก.ค. 60 | ย้อนหลัง<br>1 ปี<br>29 ก.ค. 59 - 31 ก.ค. 60 | ย้อนหลัง<br>3 ปี<br>31 ก.ค. 57 - 31 ก.ค. 60 | ย้อนหลัง<br>5 ปี<br>31 ก.ค. 55 - 31 ก.ค. 60 | ย้อนหลัง<br>10 ปี<br>31 ก.ค. 50 - 31 ก.ค. 60 | นับแต่จัดตั้ง<br>กองทุน<br>20 ต.ค. 39 - 31 ก.ค. 60 |
|-----------------------------|--------------------------------------------|-------------------------------------------------|------------------------------------------------|---------------------------------------------|---------------------------------------------|---------------------------------------------|----------------------------------------------|----------------------------------------------------|
| SCBSET                      | 3.62%                                      | 0.74%                                           | 1.52%                                          | 5.88%                                       | 3.09%                                       | 7.44%                                       | 8.56%                                        | n.a                                                |
| เกณฑ์มาตรฐาน                | 4.21%                                      | 1.08%                                           | 1.93%                                          | 5.50%                                       | 2.29%                                       | 6.04%                                       | 6.46%                                        | n.a                                                |
| ความผันผวนของผลการดำเนินงาน | 4.37%                                      | 2.23%                                           | 3.73%                                          | 10.68%                                      | 12.60%                                      | 14.63%                                      | 20.15%                                       | n.a.                                               |
| ความผันผวนของเกณฑ์มาตรฐาน   | 4.23%                                      | 2.19%                                           | 3.61%                                          | 10.76%                                      | 12.47%                                      | 14.48%                                      | 20.01%                                       | n.a.                                               |

เกณฑ์มาตรฐาน : ดัชนีผลตอบแทนรวมตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET Total Return Index : SET TRI)

หมายเหตุ : เอกสารการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนฉบับนี้ ได้จัดทำขึ้นตามมาตรฐานการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวมของสมาคมบริษัทจัดการลงทุน

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด

กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ เซ็ท อินเด็กซ์ ฟันด์

รายละเอียดหลักทรัพย์ และสัดส่วนการลงทุน

ณ วันที่ 31 กรกฎาคม 2560

| ชื่อหลักทรัพย์                              | ราคา ณ<br>31 ก.ค. 2560<br>(บาท) | จำนวนหุ้น<br>(หุ้น) | มูลค่า<br>ตามราคาตลาด<br>(บาท) | ร้อยละของมูลค่า<br>ทรัพย์สินสุทธิ<br>(%) | ค่าประกัน/รับรอง/รับอาวัล<br>หรือสลักหลังโอน<br>แบบมีสิทธิไต่เบี่ย |
|---------------------------------------------|---------------------------------|---------------------|--------------------------------|------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------|
| <b>เงินฝากธนาคาร</b>                        |                                 |                     | <b>245,778,189.84</b>          | <b>3.36%</b>                             |                                                                    |
| ธนาคารกรุงไทย จำกัด (มหาชน) (KBANK)         |                                 |                     | 245,778,189.84                 | 3.36%                                    |                                                                    |
| <b>หุ้นจดทะเบียน</b>                        |                                 |                     | <b>7,121,810,963.32</b>        | <b>97.37%</b>                            |                                                                    |
| <b>ธุรกิจการเกษตร</b>                       |                                 |                     | <b>36,397,210.00</b>           | <b>0.50%</b>                             |                                                                    |
| บมจ.จีเอฟพีที (GFPT)                        | 19.30                           | 1,060,300.00        | 20,463,790.00                  | 0.28%                                    |                                                                    |
| บมจ.ศรีตรังแอโกรอินดัสทรี (STA)             | 12.30                           | 1,295,400.00        | 15,933,420.00                  | 0.22%                                    |                                                                    |
| <b>ธนาคาร</b>                               |                                 |                     | <b>1,058,110,542.92</b>        | <b>14.47%</b>                            |                                                                    |
| ธนาคารกรุงศรีอยุธยา จำกัด (มหาชน) (BAY)     | 36.50                           | 3,921,600.00        | 143,138,400.00                 | 1.96%                                    |                                                                    |
| ธนาคารกรุงเทพ จำกัด (มหาชน) (BBL)           | 179.50                          | 922,000.00          | 165,499,000.00                 | 2.26%                                    |                                                                    |
| ธนาคาร ซีไอเอ็มบี ไทย จำกัด (มหาชน) (CIMBT) | 1.07                            | 20,182,452.00       | 21,595,223.64                  | 0.30%                                    |                                                                    |
| ธนาคารกรุงไทย จำกัด (มหาชน) (KBANK)         | 192.50                          | 1,157,900.00        | 222,895,750.00                 | 3.05%                                    |                                                                    |
| ธนาคารเกียรตินาคิน จำกัด (มหาชน) (KKP)      | 66.75                           | 340,100.00          | 22,701,675.00                  | 0.31%                                    |                                                                    |
| ธนาคารกรุงไทย จำกัด (มหาชน) (KTB)           | 18.10                           | 7,007,900.00        | 126,842,990.00                 | 1.73%                                    |                                                                    |
| ธนาคารไทยพาณิชย์ จำกัด (มหาชน) (SCB)        | 147.00                          | 1,687,500.00        | 248,062,500.00                 | 3.39%                                    |                                                                    |
| บมจ.ทุนธนชาติ (TCAP)                        | 47.75                           | 642,500.00          | 30,679,375.00                  | 0.42%                                    |                                                                    |
| บมจ.ทีเอสไอไฟแนนเชียลกรุ๊ป (TISCO)          | 73.75                           | 346,600.00          | 25,561,750.00                  | 0.35%                                    |                                                                    |
| ธนาคารทหารไทย จำกัด (มหาชน) (TMB)           | 2.36                            | 21,666,898.00       | 51,133,879.28                  | 0.70%                                    |                                                                    |
| <b>พาณิชย์</b>                              |                                 |                     | <b>721,624,241.40</b>          | <b>9.87%</b>                             |                                                                    |
| บมจ.บีวีดี คอมมูนิตี้ (BEAUTY)              | 11.90                           | 2,309,100.00        | 27,478,290.00                  | 0.38%                                    |                                                                    |
| บมจ.บิ๊กซี ซูเปอร์เซ็นเตอร์ (BIGC)          | 223.00                          | 350,800.00          | 78,228,400.00                  | 1.07%                                    |                                                                    |
| บมจ.เบอร์ลี่ ยุคเกอร์ (BJC)                 | 46.25                           | 2,324,400.00        | 107,503,500.00                 | 1.47%                                    |                                                                    |
| บมจ.ซีพี ออลล์ (CPALL)                      | 60.75                           | 4,328,400.00        | 262,950,300.00                 | 3.60%                                    |                                                                    |
| บมจ.สยามโกลบอลเฮ้าส์ (GLOBAL)               | 13.70                           | 3,036,228.00        | 41,596,323.60                  | 0.57%                                    |                                                                    |
| บมจ.โฮม โปรดักส์ เซ็นเตอร์ (HMPRO)          | 9.90                            | 7,153,922.00        | 70,823,827.80                  | 0.97%                                    |                                                                    |
| บมจ.สยามแม็คโคร (MAKRO)                     | 34.75                           | 2,374,500.00        | 82,513,875.00                  | 1.13%                                    |                                                                    |
| บมจ.โรบินสัน (ROBINS)                       | 58.25                           | 721,300.00          | 42,015,725.00                  | 0.57%                                    |                                                                    |
| บมจ.สหพัฒน์พิบูล (SPC)                      | 43.00                           | 198,000.00          | 8,514,000.00                   | 0.12%                                    |                                                                    |
| <b>เทคโนโลยีสารสนเทศและการสื่อสาร</b>       |                                 |                     | <b>630,794,062.95</b>          | <b>8.62%</b>                             |                                                                    |
| บมจ.แอดวานซ์ อินโฟร์ เซอร์วิส (ADVANC)      | 185.50                          | 1,498,900.00        | 278,045,950.00                 | 3.80%                                    |                                                                    |
| บมจ.โทเทิ่ล แอ็คเซ็ส คอมมูนิเคชั่น (DTAC)   | 54.25                           | 1,264,895.00        | 68,620,553.75                  | 0.94%                                    |                                                                    |
| บมจ.อินทัช โฮลดิ้งส์ (INTUCH)               | 59.75                           | 1,692,600.00        | 101,132,850.00                 | 1.38%                                    |                                                                    |
| บมจ.เจสมิน อินเตอร์เนชั่นแนล (JAS)          | 7.50                            | 4,043,700.00        | 30,327,750.00                  | 0.41%                                    |                                                                    |
| บมจ.สามารคคอร์ปอเรชั่น (SAMART)             | 14.30                           | 1,847,100.00        | 26,413,530.00                  | 0.36%                                    |                                                                    |
| บมจ.ไทยคม (THCOM)                           | 15.60                           | 1,570,400.00        | 24,498,240.00                  | 0.33%                                    |                                                                    |
| บมจ.ทรู คอร์ปอเรชั่น (TRUE)                 | 5.65                            | 18,009,768.00       | 101,755,189.20                 | 1.39%                                    |                                                                    |
| <b>วัสดุก่อสร้าง</b>                        |                                 |                     | <b>510,407,035.80</b>          | <b>6.98%</b>                             |                                                                    |
| บมจ.ไดนาสตีเซรามิก (DCC)                    | 4.04                            | 5,627,420.00        | 22,734,776.80                  | 0.31%                                    |                                                                    |

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด

กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ เซ็ท อินเด็กซ์ ฟันด์

รายละเอียดหลักทรัพย์ และสัดส่วนการลงทุน

ณ วันที่ 31 กรกฎาคม 2560

| ชื่อหลักทรัพย์                                      | ราคา ณ<br>31 ก.ค. 2560<br>(บาท) | จำนวนหุ้น<br>(หุ้น) | มูลค่า<br>ตามราคาตลาด<br>(บาท) | ร้อยละของมูลค่า<br>ทรัพย์สินสุทธิ<br>(%) | ค่าประกัน/รับรอง/รับอาวัล<br>หรือสลักหลังโอน<br>แบบมีสิทธิไต่เบี่ย |
|-----------------------------------------------------|---------------------------------|---------------------|--------------------------------|------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------|
| บมจ.อีสเทิร์น โพลีเมอร์ กรุป (EPG)                  | 10.80                           | 2,099,800.00        | 22,677,840.00                  | 0.31%                                    |                                                                    |
| บมจ.ปูนซีเมนต์ไทย (SCC)                             | 506.00                          | 597,300.00          | 302,233,800.00                 | 4.13%                                    |                                                                    |
| บมจ.ปูนซีเมนต์นครหลวง (SCCC)                        | 311.00                          | 184,371.00          | 57,339,381.00                  | 0.78%                                    |                                                                    |
| บมจ.ทีปโก้แอสฟัลท์ (TASCO)                          | 22.60                           | 1,638,380.00        | 37,027,388.00                  | 0.51%                                    |                                                                    |
| บมจ.ทีพีโอ โพลีน (TPIPL)                            | 2.26                            | 18,714,500.00       | 42,294,770.00                  | 0.58%                                    |                                                                    |
| บมจ.วนชัย กรุป (VNG)                                | 11.90                           | 2,193,200.00        | 26,099,080.00                  | 0.36%                                    |                                                                    |
| <b>บริการรับเหมาก่อสร้าง</b>                        |                                 |                     | <b>101,503,593.35</b>          | <b>1.39%</b>                             |                                                                    |
| บมจ.ช.การช่าง (CK)                                  | 28.50                           | 762,905.00          | 21,742,792.50                  | 0.30%                                    |                                                                    |
| บมจ.ซีพีจี (SEAFCO)                                 | 15.30                           | 1,117,100.00        | 17,091,630.00                  | 0.23%                                    |                                                                    |
| บมจ.ซีโน-ไทย เอ็นจิเนียริงแอนด์คอนสตรัคชั่น (STEC)  | 25.75                           | 1,310,785.00        | 33,752,713.75                  | 0.46%                                    |                                                                    |
| บมจ.เอสทีพี แอนด์ ไอ (STPI)                         | 6.60                            | 3,061,631.00        | 20,206,764.60                  | 0.28%                                    |                                                                    |
| บมจ.ทีทีซีแอล (TTCL)                                | 17.90                           | 486,575.00          | 8,709,692.50                   | 0.12%                                    |                                                                    |
| <b>ชิ้นส่วนอิเล็กทรอนิกส์</b>                       |                                 |                     | <b>105,359,300.00</b>          | <b>1.44%</b>                             |                                                                    |
| บมจ.เดลต้า อิเล็กทรอนิกส์ (ประเทศไทย) (DELTA)       | 88.75                           | 621,440.00          | 55,152,800.00                  | 0.75%                                    |                                                                    |
| บมจ.ฮานา ไมโครอิเล็กทรอนิกส์ (HANA)                 | 40.25                           | 547,200.00          | 22,024,800.00                  | 0.30%                                    |                                                                    |
| บมจ.เคซีอี อิเล็กทรอนิกส์ (KCE)                     | 86.50                           | 325,800.00          | 28,181,700.00                  | 0.39%                                    |                                                                    |
| <b>พลังงานและสาธารณูปโภค</b>                        |                                 |                     | <b>1,415,147,155.05</b>        | <b>19.35%</b>                            |                                                                    |
| บมจ.บ้านปู (BANPU)                                  | 16.30                           | 2,702,850.00        | 44,056,455.00                  | 0.60%                                    |                                                                    |
| บมจ.บางจาก คอร์ปอเรชั่น (BCP)                       | 34.75                           | 1,249,500.00        | 43,420,125.00                  | 0.59%                                    |                                                                    |
| บมจ.บ้านปู เพาเวอร์ (BPP)                           | 26.75                           | 1,432,500.00        | 38,319,375.00                  | 0.52%                                    |                                                                    |
| บมจ.พลังงานบริสุทธิ์ (EA)                           | 37.00                           | 1,744,100.00        | 64,531,700.00                  | 0.88%                                    |                                                                    |
| บมจ.จัดการและพัฒนาทรัพยากรน้ำภาคตะวันออก<br>(EASTW) | 12.80                           | 1,318,100.00        | 16,871,680.00                  | 0.23%                                    |                                                                    |
| บมจ.ผลิตไฟฟ้า (EGCO)                                | 218.00                          | 233,800.00          | 50,968,400.00                  | 0.70%                                    |                                                                    |
| บมจ.เอสโซ่ (ประเทศไทย) (ESSO)                       | 9.85                            | 2,549,100.00        | 25,108,635.00                  | 0.34%                                    |                                                                    |
| บมจ.โกลว์ พลังงาน (GLOW)                            | 81.00                           | 688,700.00          | 55,784,700.00                  | 0.76%                                    |                                                                    |
| บมจ.โกลบอล เพาเวอร์ ซินเนอร์ยี (GPSC)               | 38.50                           | 891,300.00          | 34,315,050.00                  | 0.47%                                    |                                                                    |
| บมจ.ไออาร์พีซี (IRPC)                               | 5.50                            | 11,947,900.00       | 65,713,450.00                  | 0.90%                                    |                                                                    |
| บมจ. พีทีจี เอ็นเนอยี (PTG)                         | 18.40                           | 1,380,400.00        | 25,399,360.00                  | 0.35%                                    |                                                                    |
| บมจ.ปตท. (PTT)                                      | 388.00                          | 1,381,000.00        | 535,828,000.00                 | 7.33%                                    |                                                                    |
| บมจ.ปตท. สารวจและผลิตปิโตรเลียม (PTTEP)             | 88.00                           | 1,986,324.00        | 174,796,512.00                 | 2.39%                                    |                                                                    |
| บมจ.ผลิตไฟฟ้าราชบุรีโฮลดิ้ง (RATCH)                 | 54.00                           | 745,400.00          | 40,251,600.00                  | 0.55%                                    |                                                                    |
| บมจ.เอสพีซีจี (SPCG)                                | 20.20                           | 1,148,500.00        | 23,199,700.00                  | 0.32%                                    |                                                                    |
| บมจ.สตาร์ ปิโตรเลียม รีไฟน์นิ่ง (SPRC)              | 15.40                           | 2,915,200.00        | 44,894,080.00                  | 0.61%                                    |                                                                    |

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด

กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ เซ็ท อินเด็กซ์ ฟันด์

รายละเอียดหลักทรัพย์ และสัดส่วนการลงทุน

ณ วันที่ 31 กรกฎาคม 2560

| ชื่อหลักทรัพย์                                               | ราคา ณ<br>31 ก.ค. 2560<br>(บาท) | จำนวนหุ้น<br>(หุ้น) | มูลค่า<br>ตามราคาตลาด<br>(บาท) | ร้อยละของมูลค่า<br>ทรัพย์สินสุทธิ<br>(%) | ค่าประกัน/รับรอง/รับอาวัล<br>หรือสลิปหลังโอน<br>แบบมีสิทธิไต่เบี่ย |
|--------------------------------------------------------------|---------------------------------|---------------------|--------------------------------|------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------|
| บมจ.ซูเปอร์มาร์เก็ต (SUPER)                                  | 1.29                            | 14,022,700.00       | 18,089,283.00                  | 0.25%                                    |                                                                    |
| บมจ.ไทยออยล์ (TOP)                                           | 85.75                           | 1,079,300.00        | 92,549,975.00                  | 1.27%                                    |                                                                    |
| บมจ.ทีพีโอ โพลีน เทวาเวอร์ (TPIPP)                           | 7.40                            | 87.00               | 643.80                         | 0.00%                                    |                                                                    |
| บมจ.ทีทีดับบลิว (TTW)                                        | 10.90                           | 1,931,000.00        | 21,047,900.00                  | 0.29%                                    |                                                                    |
| บมจ.ดับบลิวเอชเอ ยูทิลิตี้ส์ แอนด์ พาวเวอร์ (WHAUP)          | 6.25                            | 85.00               | 531.25                         | 0.00%                                    |                                                                    |
| <b>เงินทุนและหลักทรัพย์</b>                                  |                                 |                     | <b>144,639,577.00</b>          | <b>1.98%</b>                             |                                                                    |
| บมจ.เงินทุนธนสยาม (DS)                                       |                                 | 19,800.00           | 0.00                           | 0.00%                                    |                                                                    |
| บมจ.เงินทุนเอกธนกิจ (FIN1)                                   |                                 | 10,600.00           | 0.00                           | 0.00%                                    |                                                                    |
| บมจ.บัตรเครดิต ไทย (KTC)                                     | 99.75                           | 224,100.00          | 22,353,975.00                  | 0.31%                                    |                                                                    |
| บมจ.หลักทรัพย์ เมย์แบงก์ กิมเอ็ง (ประเทศไทย)<br>(MBKET)      | 22.10                           | 749,900.00          | 16,572,790.00                  | 0.23%                                    |                                                                    |
| บมจ.เมืองไทย ลิสซิ่ง (MTLS)                                  | 35.75                           | 1,312,200.00        | 46,911,150.00                  | 0.64%                                    |                                                                    |
| บมจ.ศรีสวัสดิ์ คอร์ปอเรชั่น (SAWAD)                          | 52.75                           | 744,168.00          | 39,254,862.00                  | 0.54%                                    |                                                                    |
| บมจ.เงินทุนหลักทรัพย์ซีทีเค (SITCA)                          |                                 | 13,000.00           | 0.00                           | 0.00%                                    |                                                                    |
| บมจ.ราชธานีลิสซิ่ง (THANI)                                   | 5.60                            | 3,490,500.00        | 19,546,800.00                  | 0.27%                                    |                                                                    |
| <b>อาหารและเครื่องดื่ม</b>                                   |                                 |                     | <b>424,350,417.89</b>          | <b>5.80%</b>                             |                                                                    |
| บมจ.คาราบาวกรุ๊ป (CBG)                                       | 69.50                           | 737,500.00          | 51,256,250.00                  | 0.70%                                    |                                                                    |
| บมจ.เจริญโภคภัณฑ์อาหาร (CPF)                                 | 24.60                           | 3,639,000.00        | 89,519,400.00                  | 1.22%                                    |                                                                    |
| บมจ.น้ำตาลขอนแก่น (KSL)                                      | 4.42                            | 4,695,752.00        | 20,755,223.84                  | 0.28%                                    |                                                                    |
| บมจ.เกษตรไทย อินเตอร์เนชั่นแนล ซุการ์ คอร์ปอเรชั่น<br>(KTIS) | 6.70                            | 1,566,700.00        | 10,496,890.00                  | 0.14%                                    |                                                                    |
| บมจ.เอ็มเค เรสโตรองด์ กรุ๊ป (M)                              | 61.00                           | 557,500.00          | 34,007,500.00                  | 0.46%                                    |                                                                    |
| บมจ.มาลีกรุ๊ป (MALEE)                                        | 33.25                           | 448,100.00          | 14,899,325.00                  | 0.20%                                    |                                                                    |
| บมจ.ไมเนอร์ อินเตอร์เนชั่นแนล (MINT)                         | 42.25                           | 2,299,558.00        | 97,156,325.50                  | 1.33%                                    |                                                                    |
| บมจ.เด็กล้านนา ฟู้ดแอนด์มาร์เก็ตติ้ง (TKN)                   | 20.10                           | 1,698,600.00        | 34,141,860.00                  | 0.47%                                    |                                                                    |
| บมจ.ไทยยูเนี่ยน กรุ๊ป (TU)                                   | 20.30                           | 2,488,516.00        | 50,516,874.80                  | 0.69%                                    |                                                                    |
| บมจ.น้ำมันพืชไทย (TVO)                                       | 30.25                           | 714,075.00          | 21,600,768.75                  | 0.30%                                    |                                                                    |
| <b>การแพทย์</b>                                              |                                 |                     | <b>297,403,546.00</b>          | <b>4.07%</b>                             |                                                                    |
| บมจ. บางกอก เชน ฮอस्पิตอล (BCH)                              | 14.00                           | 2,282,850.00        | 31,959,900.00                  | 0.44%                                    |                                                                    |
| บมจ.กรุงเทพดุสิตเวชการ (BDMS)                                | 19.10                           | 8,210,000.00        | 156,811,000.00                 | 2.14%                                    |                                                                    |
| บมจ. โรงพยาบาลบำรุงราษฎร์ (BH)                               | 175.00                          | 405,900.00          | 71,032,500.00                  | 0.97%                                    |                                                                    |
| บมจ. โรงพยาบาลจุฬารัตน์ (CHG)                                | 2.58                            | 14,573,700.00       | 37,600,146.00                  | 0.51%                                    |                                                                    |
| <b>ประกันภัยและประกันชีวิต</b>                               |                                 |                     | <b>50,209,090.00</b>           | <b>0.69%</b>                             |                                                                    |
| บมจ.กรุงเทพประกันภัย (BKI)                                   | 347.00                          | 15,200.00           | 5,274,400.00                   | 0.07%                                    |                                                                    |
| บมจ.กรุงเทพประกันชีวิต (BLA)                                 | 41.75                           | 1,076,280.00        | 44,934,690.00                  | 0.61%                                    |                                                                    |

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด

กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ เซ็ท อินเด็กซ์ ฟันด์

รายละเอียดหลักทรัพย์ และสัดส่วนการลงทุน

ณ วันที่ 31 กรกฎาคม 2560

| ชื่อหลักทรัพย์                             | ราคา ณ<br>31 ก.ค. 2560<br>(บาท) | จำนวนหุ้น<br>(หุ้น) | มูลค่า<br>ตามราคาตลาด<br>(บาท) | ร้อยละของมูลค่า<br>ทรัพย์สินสุทธิ<br>(%) | ค่าประกัน/รับรอง/รับอาวัล<br>หรือสลักหลังโอน<br>แบบมีสิทธิไต่เบี่ย |
|--------------------------------------------|---------------------------------|---------------------|--------------------------------|------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------|
| <b>สื่อและสิ่งพิมพ์</b>                    |                                 |                     | <b>124,971,137.20</b>          | <b>1.71%</b>                             |                                                                    |
| บมจ.บีอีซี เวิลด์ (BEC)                    | 18.50                           | 1,277,200.00        | 23,628,200.00                  | 0.32%                                    |                                                                    |
| บมจ.ไอทีวี (ITV)                           |                                 | 585,200.00          | 0.00                           | 0.00%                                    |                                                                    |
| บมจ.เมเจอร์ ซินีเพล็กซ์ กรุ๊ป (MAJOR)      | 30.75                           | 793,700.00          | 24,406,275.00                  | 0.33%                                    |                                                                    |
| บมจ.แพลน บี มีเดีย (PLANB)                 | 5.60                            | 3,701,300.00        | 20,727,280.00                  | 0.28%                                    |                                                                    |
| บมจ.วี จี ไอ โกลบอล มีเดีย (VGI)           | 5.20                            | 6,029,636.00        | 31,354,107.20                  | 0.43%                                    |                                                                    |
| บมจ.เวิร์คพอยท์ เอ็นเทอร์เทนเมนท์ (WORK)   | 62.75                           | 396,100.00          | 24,855,275.00                  | 0.34%                                    |                                                                    |
| <b>ปิโตรเคมีและเคมีภัณฑ์</b>               |                                 |                     | <b>277,915,398.00</b>          | <b>3.80%</b>                             |                                                                    |
| บมจ. อินโดรามา เวนเจอร์ส (IVL)             | 37.25                           | 2,004,900.00        | 74,682,525.00                  | 1.02%                                    |                                                                    |
| บมจ.พีทีที โกลบอล เคมิคอล (PTTGC)          | 71.75                           | 2,148,436.00        | 154,150,283.00                 | 2.11%                                    |                                                                    |
| บมจ.ไทยเซ็นทรัลเคมี (TCCC)                 | 73.25                           | 365,600.00          | 26,780,200.00                  | 0.37%                                    |                                                                    |
| บมจ.วินไทย (VNT)                           | 20.90                           | 1,067,100.00        | 22,302,390.00                  | 0.30%                                    |                                                                    |
| <b>พัฒนาอสังหาริมทรัพย์</b>                |                                 |                     | <b>605,744,617.16</b>          | <b>8.28%</b>                             |                                                                    |
| บมจ.อมตะ คอร์ปอเรชัน (AMATA)               | 15.70                           | 1,293,700.00        | 20,311,090.00                  | 0.28%                                    |                                                                    |
| บมจ.อมตะ เวียน (AMATAV)                    | 7.70                            | 2,586,672.00        | 19,917,374.40                  | 0.27%                                    |                                                                    |
| บมจ. อนันดา ดีเวลลอปเม้นท์ (ANAN)          | 4.98                            | 4,785,300.00        | 23,830,794.00                  | 0.33%                                    |                                                                    |
| บมจ.เอพี (ไทยแลนด์) (AP)                   | 7.70                            | 3,601,156.00        | 27,728,901.20                  | 0.38%                                    |                                                                    |
| บมจ.บางกอกแลนด์ (BLAND)                    | 1.81                            | 23,175,800.00       | 41,948,198.00                  | 0.57%                                    |                                                                    |
| บมจ.เซ็นทรัลพัฒนา (CPN)                    | 69.50                           | 2,337,700.00        | 162,470,150.00                 | 2.22%                                    |                                                                    |
| บมจ.แลนด์แอนด์เฮาส์ (LH)                   | 10.00                           | 6,173,720.00        | 61,737,200.00                  | 0.84%                                    |                                                                    |
| บมจ.แอล.พี.เอ็น. ดีเวลลอปเม้นท์ (LPN)      | 11.60                           | 1,796,800.00        | 20,842,880.00                  | 0.28%                                    |                                                                    |
| บมจ.เอ็ม บี เค (MBK)                       | 15.00                           | 1,448,200.00        | 21,723,000.00                  | 0.30%                                    |                                                                    |
| บมจ.ออริจิ้น พร็อพเพอร์ตี้ (ORI)           | 15.10                           | 874,940.00          | 13,211,594.00                  | 0.18%                                    |                                                                    |
| บมจ.พญา โฮลคิง (PSH)                       | 22.90                           | 797,300.00          | 18,258,170.00                  | 0.25%                                    |                                                                    |
| บมจ.ควอลิตี้เฮาส์ (QH)                     | 2.44                            | 12,001,895.00       | 29,284,623.80                  | 0.40%                                    |                                                                    |
| บมจ.สิงห์ เอสเตท (S)                       | 4.02                            | 7,473,500.00        | 30,043,470.00                  | 0.41%                                    |                                                                    |
| บมจ.เอสซี แอสเสท คอร์ปอเรชัน (SC)          | 3.24                            | 7,646,290.00        | 24,773,979.60                  | 0.34%                                    |                                                                    |
| บมจ.แสนสิริ (SIRI)                         | 2.08                            | 8,475,577.00        | 17,629,200.16                  | 0.24%                                    |                                                                    |
| บมจ.สุภาลัย (SPALI)                        | 23.80                           | 1,212,200.00        | 28,850,360.00                  | 0.39%                                    |                                                                    |
| บมจ.ไทคอน อินดัสเทรียล คอนเน็คชั่น (TICON) | 14.00                           | 1,279,100.00        | 17,907,400.00                  | 0.24%                                    |                                                                    |
| บมจ. ดับบลิวเอชเอ คอร์ปอเรชัน (WHA)        | 3.04                            | 8,314,550.00        | 25,276,232.00                  | 0.35%                                    |                                                                    |
| <b>การท่องเที่ยวและสันทนาการ</b>           |                                 |                     | <b>55,970,505.00</b>           | <b>0.77%</b>                             |                                                                    |
| บมจ.โรงแรมเซ็นทรัลพลาซา (CENTEL)           | 40.75                           | 849,300.00          | 34,608,975.00                  | 0.47%                                    |                                                                    |
| บมจ.ดิ เอราวัณ กรุ๊ป (ERW)                 | 5.35                            | 3,487,800.00        | 18,659,730.00                  | 0.26%                                    |                                                                    |
| บมจ.โอเอชทีแอล (OHTL)                      | 948.00                          | 2,850.00            | 2,701,800.00                   | 0.04%                                    |                                                                    |

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด

กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ เซ็ท อินเด็กซ์ ฟันด์

รายละเอียดหลักทรัพย์ และสัดส่วนการลงทุน

ณ วันที่ 31 กรกฎาคม 2560

| ชื่อหลักทรัพย์                     | ราคา ณ<br>31 ก.ค. 2560<br>(บาท) | จำนวนหุ้น<br>(หุ้น) | มูลค่า<br>ตามราคาตลาด<br>(บาท) | ร้อยละของมูลค่า<br>ทรัพย์สินสุทธิ<br>(%) | ค่าประกัน/รับรอง/รับอาวัล<br>หรือสลักหลังโอน<br>แบบมีสิทธิไต่เบี่ย |
|------------------------------------|---------------------------------|---------------------|--------------------------------|------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------|
| <b>ขนส่งและโลจิสติกส์</b>          |                                 |                     | <b>561,263,533.60</b>          | <b>7.67%</b>                             |                                                                    |
| บมจ. เอเชีย เอวิเอชั่น (AAV)       | 6.35                            | 4,164,200.00        | 26,442,670.00                  | 0.36%                                    |                                                                    |
| บมจ.ท่าอากาศยานไทย (AOT)           | 51.50                           | 7,075,600.00        | 364,393,400.00                 | 4.98%                                    |                                                                    |
| บมจ.ทางด่วนและรถไฟฟ้ากรุงเทพ (BEM) | 7.50                            | 7,505,296.00        | 56,289,720.00                  | 0.77%                                    |                                                                    |
| บมจ.บีทีเอส กรุ๊ป โฮลดิ้งส์ (BTS)  | 8.60                            | 6,232,756.00        | 53,601,701.60                  | 0.73%                                    |                                                                    |
| บมจ.พีริแอส ซิปปิง (PSL)           | 9.30                            | 2,034,850.00        | 18,924,105.00                  | 0.26%                                    |                                                                    |
| บมจ.การบินไทย (THAI)               | 18.60                           | 814,045.00          | 15,141,237.00                  | 0.21%                                    |                                                                    |
| บมจ.โทรีเซนไทย เอเยนต์ชีส์ (TTA)   | 8.50                            | 3,114,200.00        | 26,470,700.00                  | 0.36%                                    |                                                                    |
| <b>รวมหลักทรัพย์ประเภทหุ้น</b>     |                                 |                     | <b>7,121,810,963.32</b>        | <b>97.37%</b>                            |                                                                    |
| <b>เงินฝากธนาคาร</b>               |                                 |                     | <b>1,136,883.86</b>            | <b>0.02%</b>                             |                                                                    |
| ธนาคารซิตี้แบงก์ (CITIBANK)        |                                 |                     | 0.00                           | 0.00%                                    |                                                                    |
| ธนาคาร ยูโอบี จำกัด (มหาชน) (UOBT) |                                 |                     | 1,136,883.86                   | 0.02%                                    |                                                                    |
| <b>สินทรัพย์อื่น ๆ</b>             |                                 |                     | <b>9,225,938.66</b>            | <b>0.13%</b>                             |                                                                    |
| <b>หนี้สิน</b>                     |                                 |                     | <b>(63,870,702.28)</b>         | <b>(0.87%)</b>                           |                                                                    |
| <b>มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ</b>        |                                 |                     | <b>7,314,081,273.40</b>        | <b>100.00%</b>                           |                                                                    |
| <b>มูลค่าหน่วยลงทุน (บาท)</b>      |                                 |                     | <b>19.2326</b>                 |                                          |                                                                    |

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด

กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ เซ็ท อินเด็กซ์ ฟันด์

รายงานสรุปเงินลงทุน

ณ วันที่ 31 กรกฎาคม 2560

| กลุ่มของตราสาร                                                                                                                                                                                                              | มูลค่าตามราคาตลาด | %NAV |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------|------|
| (ก) ตราสารภาครัฐ ได้แก่ ตัวแลกเงิน พันธบัตรรัฐบาล พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย พันธบัตร หรือตราสารแห่งหนึ่งที่กองทุนเพื่อการฟื้นฟูและพัฒนาสถาบันการเงิน หรือกระทรวงการคลัง เป็นผู้ออก ผู้รับรอง ผู้รับอาวัล หรือผู้ค้ำประกัน | -                 | -    |
| (ข) ตราสารที่ธนาคารที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้น ธนาคารพาณิชย์ หรือบริษัทเงินทุนเป็นผู้ออก ผู้รับรอง ผู้รับอาวัล ผู้สืบทอด หรือผู้ค้ำประกัน                                                                                   | 247,120,888.90    | 3.38 |
| (ค) ตราสารที่มีบริษัทที่ได้รับ rating ในระดับ investment grade เป็นผู้ออก ผู้รับรอง ผู้รับอาวัล ผู้สืบทอด หรือผู้ค้ำประกัน                                                                                                  | -                 | -    |
| (ง) ตราสารที่มีบริษัทที่ได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือในระดับที่ต่ำกว่า investment grade หรือไม่มี rating เป็นผู้ออก ผู้รับรอง ผู้รับอาวัล ผู้สืบทอด หรือผู้ค้ำประกัน                                                    | -                 | -    |

สัดส่วนสูงสุด (Upper Limit) ที่บริษัทจัดการคาดว่าจะลงทุนในกลุ่ม (ง)

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด  
 กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ เซ็ท อินดีกซ์ ฟันด์  
 รายละเอียดตัวตราสารและอันดับความน่าเชื่อถือของตราสารทุกตัวใน Port  
 ณ วันที่ 31 กรกฎาคม 2560

| ประเภท        | ผู้ออก                      | ผู้รับ/ผู้รับรอง/ผู้หลักหลัง | วันครบกำหนด | อันดับความน่าเชื่อถือของผู้ออกตราสาร |              | มูลค่าหน้าตัว | มูลค่าตามราคาตลาด |
|---------------|-----------------------------|------------------------------|-------------|--------------------------------------|--------------|---------------|-------------------|
|               |                             |                              |             | TRIS Rating                          | FITCH Rating |               |                   |
| เงินฝากธนาคาร | ธนาคาร ยูโอบี จำกัด (มหาชน) |                              |             |                                      | AAA(tha)     | 1,136,883.86  | 1,137,752.88      |

กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ เซ็ท อินเด็กซ์ ฟันด์

SCB SET INDEX FUND

แบบค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม

FUND'S DIRECT EXPENSES REPORT

ตั้งแต่วันที่ 01 กุมภาพันธ์ 2560 ถึงวันที่ 31 กรกฎาคม 2560

Period from 01 February 2017 to 31 July 2017

| ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม *        | จำนวนเงิน      | ร้อยละต่อปีของ       |
|---------------------------------------------|----------------|----------------------|
| Fund's direct expenses                      | หน่วย : พันบาท | มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ |
| ค่าธรรมเนียมการจัดการ (Management fee)      | 34,590         | 0.99                 |
| ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ (Trustee fee) | 1,118          | 0.03                 |
| ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน (Registrar fee)      | -              | -                    |
| ค่าที่ปรึกษาการลงทุน (Advisory fee)         | -              | -                    |
| ค่าใช้จ่ายอื่น ๆ (Other expenses)           | 248            | 0.01                 |
| รวมค่าใช้จ่ายทั้งหมด (Total Expense) **     | 35,956         | 1.03                 |

\* ค่าใช้จ่ายดังกล่าวได้รวมภาษีมูลค่าเพิ่มแล้ว / Including VAT

\*\* ไม่รวมค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ และค่าธรรมเนียมต่าง ๆ ที่เกิดขึ้นจากการซื้อขายหลักทรัพย์

Excluding brokerage fee and other transactions fees

กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ เซ็ท อินเด็กซ์ ฟันด์ (SCBSETFUND)

งบดุล

ณ วันที่ 31 กรกฎาคม 2560

"ยังไม่ได้ตรวจสอบ"

"ยังไม่ได้สอบทาน"

บาท

สินทรัพย์

|                                            |                         |
|--------------------------------------------|-------------------------|
| เงินลงทุนตามราคายุติธรรม                   | 7,122,947,847.18        |
| เงินฝากธนาคาร                              | 245,778,189.84          |
| หลักประกันสำหรับการให้ยืมหลักทรัพย์        | 0.00                    |
| ลูกหนี้จากเงินปันผลและดอกเบี้ย             | 1,799,463.20            |
| ลูกหนี้จากการขายเงินลงทุน                  | 7,196,298.02            |
| ลูกหนี้จากการขายหน่วยลงทุน                 | 130,628.69              |
| เงินวางประกันตามสัญญาซื้อขายตราสารอนุพันธ์ | 0.00                    |
| ค่าใช้จ่ายรอตัดบัญชี                       | 99,548.75               |
| <b>รวมสินทรัพย์</b>                        | <b>7,377,951,975.68</b> |

หนี้สิน

|                                                      |                      |
|------------------------------------------------------|----------------------|
| เจ้าหนี้จากการซื้อเงินลงทุน                          | 0.00                 |
| เจ้าหนี้จากการรับซื้อคืนหน่วยลงทุน                   | 57,127,359.24        |
| ภาระผูกพันที่ต้องคืนหลักประกันจากการให้ยืมหลักทรัพย์ | 0.00                 |
| เจ้าหนี้จากตราสารอนุพันธ์                            | 0.00                 |
| ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย                                   | 6,556,307.75         |
| หนี้สินอื่น                                          | 187,035.29           |
| <b>รวมหนี้สิน</b>                                    | <b>63,870,702.28</b> |

สินทรัพย์สุทธิ

**7,314,081,273.40**

สินทรัพย์สุทธิ :-

|                                 |                         |
|---------------------------------|-------------------------|
| ทุนที่ได้รับจากผู้ถือหน่วยลงทุน | 3,802,954,718.98        |
| บัญชีปรับสมดุล                  | 164,497,953.42          |
| กำไร(ขาดทุน)สะสมจากการดำเนินงาน | 3,346,628,601.00        |
| <b>สินทรัพย์สุทธิ</b>           | <b>7,314,081,273.40</b> |

จำนวนหน่วยลงทุนที่จำหน่ายแล้ว (หน่วย)

380,295,471.8976

สินทรัพย์สุทธิต่อหน่วยลงทุน

19.2326

กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ เซท อินเด็กซ์ ฟันด์ (SCBSETFUND)

งบกำไรขาดทุน

รอบระยะเวลาตั้งแต่วันที่ 1 กุมภาพันธ์ 2560 ถึงวันที่ 31 กรกฎาคม 2560

|                                                                 |                    |
|-----------------------------------------------------------------|--------------------|
|                                                                 | "ยังไม่ได้ตรวจสอบ" |
|                                                                 | "ยังไม่ได้สอบทาน"  |
|                                                                 | บาท                |
| รายได้จากการลงทุน                                               |                    |
| รายได้เงินปันผล                                                 | 127,327,752.63     |
| รายได้ดอกเบี้ย                                                  | 938,015.85         |
| รายได้อื่น                                                      | 0.00               |
| รายได้ทั้งสิ้น                                                  | 128,265,768.48     |
| ค่าใช้จ่าย                                                      |                    |
| ค่าธรรมเนียมจัดการ                                              | 34,589,679.03      |
| ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์                                   | 1,117,598.69       |
| ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน                                          | 0.00               |
| ค่าธรรมเนียมดำเนินงานกองทุน                                     | 0.00               |
| ค่าสอบบัญชี                                                     | 164,139.85         |
| ค่าใช้จ่ายในการขายและรับซื้อคืนหน่วยลงทุน                       | 0.00               |
| ค่าใช้จ่ายอื่น                                                  | 83,653.74          |
| ค่าใช้จ่ายทั้งสิ้น                                              | 35,955,071.31      |
| รายได้จากการลงทุนสุทธิ                                          | 92,310,697.17      |
| รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิจากเงินลงทุน                             |                    |
| รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิที่เกิดขึ้นจริง                          | 10,076,056.28      |
| รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิที่ยังไม่เกิดขึ้นจริง                    | 15,186,824.97      |
| รวมรายการกำไร(ขาดทุน)จากการลงทุนที่เกิดขึ้นและที่ยังไม่เกิดขึ้น | 25,262,881.25      |
| การเพิ่มขึ้น(ลดลง)ในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงาน               | 117,573,578.42     |

## รายงานการซื้อขายหลักทรัพย์และค่าใช้จ่ายต่าง ๆ

### VOLUME TRADE AND EXPENSES REPORT

ตั้งแต่วันที่ 1 กุมภาพันธ์ 2560 ถึง วันที่ 31 กรกฎาคม 2560

Period from 1 กุมภาพันธ์ 2017 to 31 กรกฎาคม 2017

|                                                                                                                                                    | (พันบาท) / (Thousand Baht) |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------|
| มูลค่าทรัพย์สินสุทธิเฉลี่ย / Average Net Assets Value                                                                                              | 7,020,534                  |
| การซื้อขายหลักทรัพย์รวม / Volume Trade                                                                                                             |                            |
| มูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์รวม                                                                                                                      | 2,464,810                  |
| Total Volume Trade                                                                                                                                 |                            |
| ค่าธรรมเนียมรายหน้าในการซื้อขายหลักทรัพย์รวม                                                                                                       | 1,572                      |
| Total Brokerage Fee                                                                                                                                |                            |
| ค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายอื่น ๆ รวม / Fee and other Expenses                                                                                       | 35,956                     |
|                                                                                                                                                    | (ร้อยละ) / (Percentage)    |
| <ul style="list-style-type: none"> <li>สัดส่วนค่าธรรมเนียมรายหน้าในการซื้อขายหลักทรัพย์รวมคิดเป็นร้อยละของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์รวม</li> </ul> | 0.06                       |
| Brokerage Fee as<br>Percentage of Total Trading Volume                                                                                             |                            |
| <ul style="list-style-type: none"> <li>สัดส่วนค่าธรรมเนียมรายหน้าในการซื้อขายหลักทรัพย์รวมคิดเป็นร้อยละของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิเฉลี่ย</li> </ul>    | 0.00                       |
| Brokerage Fee as<br>Percentage of Average Net Assets Value                                                                                         |                            |
| <ul style="list-style-type: none"> <li>สัดส่วนค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายอื่น ๆ รวมคิดเป็นร้อยละของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิเฉลี่ย</li> </ul>             | 1.03                       |
| Fee and other Expenses as<br>Percentage of Average Net Assets Value                                                                                |                            |
| <ul style="list-style-type: none"> <li>อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุนของกองทุนรวม (PTR)</li> </ul>                                                     | 0.12                       |
| Portfolio Turnover Ratio (PTR)                                                                                                                     |                            |

รายงานรายชื่อบริษัทนายหน้า และค่าธรรมเนียม ซื้อ-ขาย หลักทรัพย์  
ของกองทุนเปิดไทยพาณิชย์ เซ็ท อินเด็กซ์ ฟันด์  
ระหว่างวันที่ 1 กุมภาพันธ์ 2560 ถึงวันที่ 31 กรกฎาคม 2560

| ลำดับที่ | ชื่อบริษัทนายหน้า                                 | ค่านายหน้า<br>(พันบาท) | อัตราส่วนค่านายหน้าแต่ละราย<br>ต่อค่านายหน้าทั้งหมด |
|----------|---------------------------------------------------|------------------------|-----------------------------------------------------|
| 1        | บริษัทหลักทรัพย์ ไทยพาณิชย์ จำกัด                 | 1,003.24               | 63.82%                                              |
| 2        | บริษัทหลักทรัพย์ เคจีไอ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) | 568.66                 | 36.18%                                              |
| รวม      |                                                   | 1,571.90               | 100.00%                                             |

การรับผลประโยชน์ตอบแทนเนื่องจากการที่กองทุนให้บริการบุคคลอื่น ประจำเดือน กรกฎาคม 2560  
BENEFIT FROM BROKERAGE SERVICES AS OF JULY 2017

| บริษัทที่ได้รับประโยชน์                                       | BROKERAGE HOUSES                                             | ผลประโยชน์ที่ได้รับ* |                  |                |         |                       |                   |
|---------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|----------------------|------------------|----------------|---------|-----------------------|-------------------|
|                                                               |                                                              | บทวิเคราะห์          | ข้อมูลพื้นฐาน    | รายงานสรุปข่าว | สัมมนา  | บรรยายกลยุทธ์การลงทุน | จัดเยี่ยมชมบริษัท |
|                                                               |                                                              | Research Paper       | Fundamental Data | News Summary   | Seminar | Strategy Presentation | Company Visit     |
| บริษัทหลักทรัพย์ เอเชีย พลัส จำกัด                            | ASIA PLUS SECURITIES COMPANY LIMITED                         | ✓                    | ✓                | ✓              |         | ✓                     | ✓                 |
| บริษัทหลักทรัพย์ บัวหลวง จำกัด (มหาชน)                        | BUALUANG SECURITIES PUBLIC COMPANY LIMITED                   | ✓                    | ✓                | ✓              |         | ✓                     | ✓                 |
| บริษัทหลักทรัพย์ ซี แอล เอส อ (ประเทศไทย) จำกัด               | CLSA SECURITIES (THAILAND) LIMITED                           | ✓                    | ✓                | ✓              |         | ✓                     |                   |
| บริษัทหลักทรัพย์ โนมุระ พัฒนสิน จำกัด (มหาชน)                 | CAPITAL NOMURA SECURITIES PUBLIC COMPANY LIMITED             | ✓                    | ✓                | ✓              |         | ✓                     |                   |
| บริษัทหลักทรัพย์เครดิต สวิส (ประเทศไทย) จำกัด                 | CREDIT SUISSE SECURITIES (THAILAND) LIMITED                  | ✓                    | ✓                | ✓              |         | ✓                     |                   |
| บริษัทหลักทรัพย์ แมย์แบงก์ คิม เอ็ง (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) | MAYBANK KIM ENG SECURITIES (THAILAND) PUBLIC COMPANY LIMITED | ✓                    | ✓                | ✓              |         | ✓                     | ✓                 |
| บริษัทหลักทรัพย์ กสิกรไทย จำกัด (มหาชน)                       | KASIKORN SECURITIES PUBLIC COMPANY LIMITED                   | ✓                    | ✓                | ✓              |         | ✓                     |                   |
| บริษัทหลักทรัพย์ กรุงศรี จำกัด (มหาชน)                        | KRUNGSRI SECURITIES PUBLIC COMPANY LIMITED                   | ✓                    | ✓                | ✓              |         | ✓                     |                   |
| บริษัทหลักทรัพย์ ภัทร 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 ซีไอเอ็มบี (ประเทศไทย) จำกัด                 | CIMB SECURITIES (THAILAND) CO., LTD                          | ✓                    | ✓                | ✓              |         | ✓                     | ✓                 |
| บริษัทหลักทรัพย์ ยูบีเอส (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 วิกเคอร์ส (ประเทศไทย) จำกัด          | DBS VICKERS SECURITIES (THAILAND) COMPANY LIMITED            | ✓                    | ✓                | ✓              |         | ✓                     |                   |
| บริษัทหลักทรัพย์ อาร์เอชบี (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)          | RHB SECURITIES (THAILAND) PUBLIC COMPANY LIMITED             | ✓                    | ✓                | ✓              |         | ✓                     |                   |
| บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)                | FINANSIA SYRUS SECURITIES PUBLIC COMPANY LIMITED             | ✓                    | ✓                | ✓              |         | ✓                     |                   |
| บริษัทหลักทรัพย์ เคทีบี (ประเทศไทย) จำกัด                     | KTBI SECURITIES (THAILAND) COMPANY LIMITED                   | ✓                    | ✓                | ✓              |         | ✓                     | ✓                 |
| บริษัทหลักทรัพย์ ยูโอบี เคย์เฮียน (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)   | UOB KAYHIAN SECURITIES (THAILAND) PUBLIC COMPANY LIMITED     | ✓                    | ✓                | ✓              |         | ✓                     |                   |

\*ผลประโยชน์ที่ได้รับ SERVICES

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

ข้อมูลการดำเนินการใช้สิทธิออกเสียงในที่ประชุมผู้ถือหุ้นในนามกองทุนรวมของรอบปีปฏิทินล่าสุด  
สามารถตรวจสอบข้อมูลได้จาก Website : [www.scbm.com](http://www.scbm.com)



บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด

ไทยพาณิชย์ ปาร์ค พลาซ่า อาคาร 1 ชั้น 7-8 เลขที่ 18 ถนนรัชดาภิเษก แขวงจตุจักร เขตจตุจักร กรุงเทพฯ 10900

SCBAM Call Center 0 2777 7777 กด 0 กด 6 หรือ [WWW.SCBAM.COM](http://WWW.SCBAM.COM)