

Mutual Funds Report

กองทุนเปิดไทยพาณิชย์

Machine Learning China All Share
(SCBMLCA)

รายงานประจำปี

ตั้งแต่วันที่ 1 ธันวาคม 2566 ถึงวันที่ 30 พฤศจิกายน 2567

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนไทยพาณิชย์

สถานที่ตั้ง

อาคารไทยพาณิชย์ ปาร์ค พลาซ่า ชั้น 7-8 อาคาร 1
 เลขที่ 18 ถนนรัชดาภิเษก แขวงจตุจักร กรุงเทพฯ 10900
 Website: <https://www.scbam.com/>

รายละเอียดเกี่ยวกับบริษัท

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด จัดตั้งขึ้นเมื่อวันที่ 18 มีนาคม พ.ศ. 2535 เป็นบริษัทในเครือธนาคาร ไทยพาณิชย์ ที่ได้รับใบอนุญาตจากกระทรวงการคลังให้ประกอบธุรกิจหลักทรัพย์ประเภทธุรกิจการจัดการกองทุนรวม กองทุนสำรองเลี้ยงชีพ และกองทุนส่วนบุคคล จากความพร้อม ความเชี่ยวชาญในการเสนอผลิตภัณฑ์ ประกอบกับผลงานการบริหาร กองทุนที่มั่นคงและอยู่ในเกณฑ์อย่างต่อเนื่อง โดยยึดมั่นในหลักจรรยาบรรณและคำนึงถึงประโยชน์สูงสุดต่อผู้ลงทุน

รายนามผู้ถือหุ้น

รายนามผู้ถือหุ้น	ร้อยละ
1. ธนาคารไทยพาณิชย์ จำกัด (มหาชน)	99.99
2. ผู้ถือหุ้นรายย่อย	0.01

รายนามคณะกรรมการ

1. นางกิตติยา	โตรณะเกษม	กรรมการ
2. นายขรรชง	ไทยเจริญ	กรรมการ
3. นางสาวลินี	วังตาล	กรรมการ
4. นายชลิตติ	เนื่องจ้านงค์	กรรมการ
5. นายณรงค์ศักดิ์	ปลอดมีชัย	กรรมการ
6. นายปฏิภาณ	เลิศประเสริฐศิริ	กรรมการ
7. นายวิฑูรย์	พรสกุลวานิช	กรรมการ

การลงทุนมีความเสี่ยง ผู้ลงทุนควรศึกษาข้อมูลก่อนการตัดสินใจลงทุน
 และสามารถตรวจสอบการทำธุรกรรมกับข้อมูลที่เกี่ยวข้องกับกองทุนรวมได้ที่
 บริษัทจัดการ โดยตรงหรือที่ Website: <https://www.scbam.com> ของบริษัทจัดการและสำนักงาน ก.ล.ต.

กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Machine Learning China All Share (SCBMLCA)

ชื่อโครงการ

:

ชนิดหน่วยลงทุน	ชื่อโครงการ
ชนิดสะสมมูลค่า	กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Machine Learning China All Share (ชนิดสะสมมูลค่า)
ชนิดเพื่อการออม	กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Machine Learning China All Share (ชนิดเพื่อการออม)
ชนิดช่องทางอิเล็กทรอนิกส์	กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Machine Learning China All Share (ชนิดช่องทางอิเล็กทรอนิกส์)
ชนิดเพื่อการออมผ่านช่องทางอิเล็กทรอนิกส์	กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Machine Learning China All Share (ชนิดเพื่อการออมผ่านช่องทางอิเล็กทรอนิกส์)

ประเภทโครงการ

: กองทุนรวมตราสารทุนกองทุนรวมที่มีนโยบายเปิดให้มีการลงทุนในกองทุนรวมอื่นภายใต้ บลจ. เดียวกัน /กองทุนรวมที่เน้นลงทุนแบบมีความเสี่ยงต่างประเทศ กลุ่มกองทุนรวม: Greater China Equity

วันเริ่มโครงการ

: วันที่ 24 ธันวาคม 2563

จำนวนเงินทุนของโครงการ

: 3,000 ล้านบาท จำนวนหน่วยลงทุน 300 ล้านหน่วย

นโยบายการลงทุน

: ลงทุนในตราสารทุนที่ออกโดยบริษัทสัญชาติจีน โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV โดยใช้การวิเคราะห์เชิงปริมาณ (Quantitative Analysis) ใช้เทคนิคทาง Machine Learning ซึ่งเป็นระบบที่พัฒนาขึ้นโดยบริษัทจัดการ มาประกอบการคัดเลือกหลักทรัพย์ที่จะลงทุน โดยหลักทรัพย์ที่กองทุนนำมาพิจารณาจะเป็นหลักทรัพย์ที่จดทะเบียนซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ฮ่องกง (H-Share) ตลาดหลักทรัพย์เซี่ยงไฮ้และเงิน (A-Share) และหลักทรัพย์ที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ต่าง ๆ ทั่วโลกที่ดำเนินธุรกิจเกี่ยวข้องกับประเทศจีน ซึ่งอาจรวมถึงหน่วยลงทุนของกองทุนรวมที่มีนโยบายลงทุนในหลักทรัพย์ดังกล่าว กองทุนอาจลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวม หรือกองทุนรวมอสังหาริมทรัพย์ (กอง1) หรือทรัสต์เพื่อการลงทุนในอสังหาริมทรัพย์ (REITs) หรือกองทุนรวมโครงสร้างพื้นฐาน (infra) ซึ่งอยู่ภายใต้การจัดการของบริษัทจัดการในสัดส่วนไม่เกิน 100% ของ NAV

กองทุนอาจลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) เพื่อเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน (Efficient portfolio management) และ/หรือการบริหารความเสี่ยง โดยป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน (Hedging) ตามดุลยพินิจของผู้จัดการกองทุน

กลยุทธ์ในการบริหารกองทุนรวม: มุ่งหวังให้ผลประกอบการเคลื่อนไหวสูงกว่าดัชนีชี้วัด (Active Management)

นโยบายจ่ายเงินปันผล :

ชนิดหน่วยลงทุน	ชื่อ โครงการ
ชนิดสะสมมูลค่า	ไม่มีนโยบายจ่ายเงินปันผล
ชนิดเพื่อการออม	ไม่เกินปีละ 12 ครั้ง
ชนิดช่องทางอิเล็กทรอนิกส์	ไม่มีนโยบายจ่ายเงินปันผล
ชนิดเพื่อการออมผ่านช่องทางอิเล็กทรอนิกส์	ไม่เกินปีละ 12 ครั้ง

ผู้ดูแลผลประโยชน์ : ธนาคารกสิกรไทย จำกัด (มหาชน)

นายทะเบียนหน่วยลงทุน : ธนาคารไทยพาณิชย์ จำกัด (มหาชน)

รอบระยะเวลาบัญชี : สิ้นสุด ณ สิ้นเดือนพฤศจิกายน (รอบปีบัญชีแรกในวันที่ 30 พฤศจิกายน 2564)

สารจากบริษัทจัดการ

เรียน ท่านผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุน

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด ในฐานะบริษัทจัดการกองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Machine Learning China All Share (SCBMLCA) กองทุนมีนโยบายลงทุนในตราสารทุนที่ออกโดยบริษัทสัญชาติจีน ซึ่งจะส่งผลให้กองทุนมี net exposure ในตราสารทุนดังกล่าวโดยเฉลี่ยในรอบปี บัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน และมีการลงทุนที่ส่งผลให้มี net exposure ที่เกี่ยวข้องกับความเสี่ยงต่างประเทศโดยเฉลี่ยในรอบปี บัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน

กองทุนมีเป้าหมายในการลงทุนให้ผลประกอบการสูงกว่าดัชนีชี้วัด (Active Management) โดยใช้การวิเคราะห์เชิงปริมาณ (Quantitative Analysis) ซึ่งมีการใช้เทคนิคทาง Machine Learning ซึ่งเป็นระบบที่พัฒนาขึ้นโดยบริษัทจัดการ มาประกอบการคัดเลือกหลักทรัพย์ที่จะลงทุน โดยหลักทรัพย์ที่กองทุนนำมาพิจารณาจะเป็นหลักทรัพย์ที่จดทะเบียนซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ฮ่องกง (H-Share) ตลาดหลักทรัพย์เซี่ยงไฮ้และเสิ่นเจิ้น (A-Share) และหลักทรัพย์ที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ต่าง ๆ ทั่วโลก ที่ดำเนินธุรกิจเกี่ยวข้องกับประเทศจีน ซึ่งอาจรวมถึงหน่วยลงทุนของกองทุนรวมที่มีนโยบายลงทุนในหลักทรัพย์ดังกล่าว ทั้งนี้ในกรณีที่มีตลาดหลักทรัพย์ใหม่เกิดขึ้นในประเทศจีนหรือฮ่องกง บริษัทจัดการอาจจะนำหลักทรัพย์ที่จดทะเบียนซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ดังกล่าวมาพิจารณาด้วย

ตลาดหุ้นจีนในช่วงที่ผ่านมา เศรษฐกิจเริ่มส่งสัญญาณผ่านพ้นจุดต่ำสุด หลังเศรษฐกิจโลกฟื้นตัวจากแนวโน้มสิ้นสุดวัฏจักรดอกเบี้ยขาขึ้น ประกอบภาครัฐเริ่มทยอยอัดฉีดเพื่อกระตุ้นเศรษฐกิจทั้งนโยบายทางการเงินและการคลัง โดยตลาดหุ้นเองฟื้นตัวขึ้นอย่างรวดเร็วในช่วงล่าสุดที่ผ่านมา หลังจากธนาคารกลางสหรัฐเองปรับลดอัตราดอกเบี้ยถึง 50bps สะท้อนมุมมองการดำเนินนโยบายที่ไม่ต้องการให้เกิดภาวะเศรษฐกิจถดถอย ประกอบกับการอัดฉีดนโยบายของภาครัฐจีนอย่างเข้มข้น อาทิ การเร่งออกพันธบัตรการผ่อนปรนการ Refinance สินเชื่อบ้าน การปรับลดอัตราดอกเบี้ยสินเชื่อจำนอง การชะลอการตายคินหนี้ รวมถึงการผ่อนคลายมาตรการเพื่อฟื้นฟูภาคอสังหาริมทรัพย์เพิ่มเติม ทำให้กระแสเงินไหลเข้าสู่ตลาดจีนอย่างคึกคัก

อย่างไรก็ตามล่าสุด ตลาดจีนเริ่มมีสัญญาณชะลอตัวลง จากความกังวลเกี่ยวกับสงครามการค้าหลังจากทรัมป์ชนะเลือกตั้ง โดยจีนนับเป็นเป้าหมายอันดับแรกในการปรับขึ้นอัตราภาษีนำเข้า บัญชีดังกล่าวเข้ามากดดันทำให้แนวโน้มในระยะข้างหน้ายังคงค่อนข้างผันผวน ทั้งนี้ด้านตัวช่วยอย่างนโยบายทางการคลัง ออกมาก่อนข้างผิดหวังและมีแนวโน้มไม่สามารถชดเชยผลกระทบจากสงครามการค้าได้เท่าไรนัก ยังคงต้องจับตาดูนโยบายใหม่ๆที่จะเพิ่มเข้ามาในระยะข้างหน้า

ทั้งนี้ผลการดำเนินงาน รอบระยะเวลาบัญชี 1 ธันวาคม 2566 ถึง 30 พฤศจิกายน 2567 ของกองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Machine Learning China All Share (SCBMLCA) ให้อัตราผลตอบแทนเพิ่มขึ้นร้อยละ 8.70

สุดท้ายนี้ บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด ขอขอบพระคุณผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุนทุกท่านที่ได้มอบความไว้วางใจลงทุนในกองทุนรวมของ บลจ. ด้วยดีเสมอมา

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด

ข้อมูลการลงทุน ผลการดำเนินงาน และความผันผวนของผลการดำเนินงานของกองทุนหลัก ซึ่งเป็นดัชนีเทียบวัด (Benchmark) ของกองทุนรวม

ผลตอบแทนจากการลงทุน	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี	3 ปี	5 ปี	10 ปี	ตั้งแต่จัดตั้ง
SCBMLCA	16.47%	9.21%	0.56%	8.70%	-10.84%	#N/A	#N/A	-7.89%
เกณฑ์มาตรฐาน	14.46%	16.29%	2.26%	8.22%	-8.45%	#N/A	#N/A	-6.22%
ความผันผวนของผลการดำเนินงาน	19.09%	14.97%	16.19%	20.19%	20.82%	#N/A	#N/A	21.75%
ความผันผวนของเกณฑ์มาตรฐาน	19.94%	15.12%	16.62%	20.93%	22.60%	#N/A	#N/A	22.52%

เกณฑ์มาตรฐาน : ดัชนี S&P Chia All-Shares LargeMidCap (USD) NTR สัดส่วน 100%

ปรับด้วยอัตราแลกเปลี่ยนเพื่อเทียบกับค่าสกุลเงินบาท ณ วันที่คำนวณผลตอบแทน (ดัชนีชี้วัดมีการเปลี่ยนแปลงโดยมีผลตั้งแต่วันที่ 1 มีนาคม 2567 เป็นต้นไป)



ธนาคารกสิกรไทย
开泰银行 KASIKORNBANK



ความเห็นของผู้ดูแลผลประโยชน์

เรียน ผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุน กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Machine Learning China All Share

ข้าพเจ้า บมจ.ธนาคารกสิกรไทย ในฐานะผู้ดูแลผลประโยชน์ได้ดูแลการจัดการ กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Machine Learning China All Share ซึ่งจัดการโดย บริษัท หลักทรัพย์จัดการ กองทุนไทยพาณิชย์ จำกัด สำหรับระยะเวลาตั้งแต่วันที่ 1 ธันวาคม พ.ศ. 2566 ถึงวันที่ 30 พฤศจิกายน พ.ศ. 2567 แล้ว

ข้าพเจ้าเห็นว่า บริษัท หลักทรัพย์จัดการกองทุนไทยพาณิชย์ จำกัด ได้ปฏิบัติหน้าที่ในการจัดการ กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Machine Learning China All Share เหมาะสมตามสมควรแห่ง วัตถุประสงค์ ที่ได้กำหนดไว้ในโครงการและภายใต้พระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535

ขอแสดงความนับถือ
บมจ. ธนาคารกสิกรไทย

(นายวิโรจน์ สิมะทองธรรม)
รองผู้อำนวยการฝ่ายบริการธุรกิจหลักทรัพย์

(นายวุฒิชัย รอดภัย)
หัวหน้าส่วนฝ่ายบริการธุรกิจหลักทรัพย์

วันที่ 12 ธันวาคม พ.ศ. 2567

ผลการดำเนินงาน

ข้อมูล ณ วันที่ 29 พฤศจิกายน 2567

ผลตอบแทนจากการลงทุน	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี	3 ปี	5 ปี	10 ปี	ตั้งแต่จัดตั้ง
SCBMLCAA	16.47%	9.21%	0.56%	8.70%	-10.84%	n.a.	n.a.	-7.89%
เกณฑ์มาตรฐาน	14.46%	16.29%	2.26%	8.22%	-8.45%	n.a.	n.a.	-6.22%
ความผันผวนของการดำเนินงาน	19.09%	14.97%	16.19%	20.19%	20.82%	n.a.	n.a.	21.75%
ความผันผวนของเกณฑ์มาตรฐาน	19.94%	15.12%	16.62%	20.93%	22.60%	n.a.	n.a.	22.52%

เกณฑ์มาตรฐาน : (1) S&P China All-Shares LargeMidCap (USD) NTR 100% ปรับด้วยอัตราแลกเปลี่ยนเพื่อเทียบกับค่าสกุลเงินบาท ณ วันที่คำนวณผลตอบแทน (ดัชนีชี้วัดมีการเปลี่ยนแปลง โดยมีผลตั้งแต่วันที่ 1 มีนาคม 2567 เป็นต้นไป)

ผลตอบแทนจากการลงทุน	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี	3 ปี	5 ปี	10 ปี	ตั้งแต่จัดตั้ง
SCBMLCA(E)	16.60%	9.21%	0.38%	7.34%	n.a.	n.a.	n.a.	2.22%
เกณฑ์มาตรฐาน	14.46%	16.29%	2.26%	8.22%	n.a.	n.a.	n.a.	2.58%
ความผันผวนของการดำเนินงาน	19.10%	14.98%	16.18%	20.28%	n.a.	n.a.	n.a.	19.82%
ความผันผวนของเกณฑ์มาตรฐาน	19.94%	15.12%	16.62%	20.93%	n.a.	n.a.	n.a.	20.49%

เกณฑ์มาตรฐาน : (1) S&P China All-Shares LargeMidCap (USD) NTR 100% ปรับด้วยอัตราแลกเปลี่ยนเพื่อเทียบกับค่าสกุลเงินบาท ณ วันที่คำนวณผลตอบแทน (ดัชนีชี้วัดมีการเปลี่ยนแปลง โดยมีผลตั้งแต่วันที่ 1 มีนาคม 2567 เป็นต้นไป)

ผลตอบแทนจากการลงทุน	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี	3 ปี	5 ปี	10 ปี	ตั้งแต่จัดตั้ง
SCBMLCA(SSF)	16.48%	9.21%	0.56%	8.72%	n.a.	n.a.	n.a.	3.26%
เกณฑ์มาตรฐาน	14.46%	16.29%	2.26%	8.22%	n.a.	n.a.	n.a.	2.58%
ความผันผวนของการดำเนินงาน	19.09%	14.97%	16.19%	20.19%	n.a.	n.a.	n.a.	19.74%
ความผันผวนของเกณฑ์มาตรฐาน	19.94%	15.12%	16.62%	20.93%	n.a.	n.a.	n.a.	20.49%

เกณฑ์มาตรฐาน : (1) S&P China All-Shares LargeMidCap (USD) NTR 100% ปรับด้วยอัตราแลกเปลี่ยนเพื่อเทียบกับค่าสกุลเงินบาท ณ วันที่คำนวณผลตอบแทน (ดัชนีชี้วัดมีการเปลี่ยนแปลง โดยมีผลตั้งแต่วันที่ 1 มีนาคม 2567 เป็นต้นไป)

ผลตอบแทนจากการลงทุน	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี	3 ปี	5 ปี	10 ปี	ตั้งแต่จัดตั้ง
SCBMLCA(SSFE)	17.64%	9.50%	1.10%	9.89%	n.a.	n.a.	n.a.	4.34%
เกณฑ์มาตรฐาน	14.46%	16.29%	2.26%	8.22%	n.a.	n.a.	n.a.	2.58%
ความผันผวนของการดำเนินงาน	19.09%	14.97%	16.19%	20.18%	n.a.	n.a.	n.a.	19.73%
ความผันผวนของเกณฑ์มาตรฐาน	19.94%	15.12%	16.62%	20.93%	n.a.	n.a.	n.a.	20.49%

เกณฑ์มาตรฐาน : (1) S&P China All-Shares LargeMidCap (USD) NTR 100% ปรับด้วยอัตราแลกเปลี่ยนเพื่อเทียบกับค่าสกุลเงินบาท ณ วันที่คำนวณผลตอบแทน (ดัชนีชี้วัดมีการเปลี่ยนแปลง โดยมีผลตั้งแต่วันที่ 1 มีนาคม 2567 เป็นต้นไป)

หมายเหตุ : เอกสารการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวมฉบับนี้ ได้จัดทำขึ้นตามมาตรฐานการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวมของสมาคมบริษัทจัดการลงทุน

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด
 กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Machine Learning China All Share
 รายละเอียดหลักทรัพย์ และสัดส่วนการลงทุน
 ณ วันที่ 30 พฤศจิกายน 2567

ชื่อหลักทรัพย์	ราคา ณ 30 พฤศจิกายน 2567 (บาท)	จำนวนหุ้น (หุ้น)	มูลค่า	ร้อยละของมูลค่า ทรัพย์สินสุทธิ (%)	ค่าประกัน/รับรอง/รับอาวัล หรือสลักหลัง โอน แบบมีสิทธิไล่เบี่ย
หลักทรัพย์จดทะเบียน			255,109,373.50	94.04%	
หุ้นสามัญ			255,109,373.50	94.04%	
TENCENT HOLDINGS LTD.(700HK)	1,751.08	15,100.00	26,441,317.06	9.75%	
YOUNGOR GROUP CO., LTD. CLASS A (600177C1)	38.26	341,700.00	13,075,113.25	4.82%	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD.(9988HK)	368.03	31,100.00	11,445,885.55	4.22%	
MEITUAN CLASS B(3690HK)	742.23	13,300.00	9,871,650.89	3.64%	
BOE TECHNOLOGY GROUP CO., LTD. CLASS A (000725C2)	20.34	361,500.00	7,352,393.06	2.71%	
CHINA LIFE INSURANCE CO., LTD. CLASS H (2628HK)	64.76	112,000.00	7,253,521.41	2.67%	
GREE ELECTRIC APPLIANCES, INC. OF ZHUHAI CLASS A(000651C2)	199.03	35,700.00	7,105,520.65	2.62%	
PEOPLE'S INSURANCE CO. (GROUP) OF CHINA LTD. CLASS H(1339HK)	16.32	399,000.00	6,512,831.91	2.40%	
KWEICHOW MOUTAI CO., LTD. CLASS A (600519C1)	7,216.60	800.00	5,773,278.10	2.13%	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO., LTD. CLASS A(600660C1)	264.87	19,700.00	5,218,025.68	1.92%	
CHINA SHENHUA ENERGY CO., LTD. CLASS H (1088HK)	141.67	35,500.00	5,029,297.07	1.85%	
GRG BANKING EQUIPMENT CO., LTD. CLASS A(002152C2)	61.77	79,300.00	4,898,558.77	1.81%	
CHINA PACIFIC INSURANCE (GROUP) CO., LTD. CLASS H(2601HK)	107.57	41,800.00	4,496,537.40	1.66%	
SUNWODA ELECTRONIC CO., LTD. CLASS A (300207C2)	108.13	40,000.00	4,325,020.56	1.59%	
PETROCHINA CO., LTD. CLASS H(857HK)	24.24	178,000.00	4,315,137.77	1.59%	
BANK OF CHINA LIMITED CLASS H(3988HK)	15.88	267,000.00	4,240,738.84	1.56%	
XIAOMI CORP. CLASS B(1810HK)	122.09	34,400.00	4,199,953.62	1.55%	
UNIVERSAL SCIENTIFIC INDUSTRIAL (SHANGHAI) CO., LTD. CLASS A(601231C1)	67.07	57,900.00	3,883,351.96	1.43%	
INDUSTRIAL AND COMMERCIAL BANK OF CHINA LIMITED CLASS A(601398C1)	29.09	130,900.00	3,807,735.05	1.40%	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO., LTD. CLASS H(1336HK)	104.71	34,900.00	3,654,478.81	1.35%	

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด
 กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Machine Learning China All Share
 รายละเอียดหลักทรัพย์ และสัดส่วนการลงทุน
 ณ วันที่ 30 พฤศจิกายน 2567

ชื่อหลักทรัพย์	ราคา ณ 30 พฤศจิกายน 2567 (บาท)	จำนวนหุ้น (หุ้น)	มูลค่า	ร้อยละของมูลค่า ทรัพย์สินสุทธิ (%)	ค่าประกัน/รับรอง/รับอาวัล หรือสลักหลัง โอน แบบมีสิทธิไล่เบี้ย
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGENT CONTROLS CO., LTD. CLASS A(002050C2)	109.73	32,900.00	3,610,238.07	1.33%	
JD.COM, INC. CLASS A(9618HK)	632.68	5,600.00	3,542,990.42	1.31%	
BYD CO., LTD. CLASS H(1211HK)	1,115.76	3,000.00	3,347,291.76	1.23%	
WULIANGYE YIBIN CO., LTD. CLASS A (000858C2)	694.21	4,700.00	3,262,774.89	1.20%	
SHENZHEN ENERGY GROUP CO., LTD. CLASS A(000027C2)	31.31	103,800.00	3,250,179.16	1.20%	
GEM CO., LTD. CLASS A(002340C2)	32.83	96,600.00	3,170,943.88	1.17%	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDINGS CO., LTD.(144HK)	54.12	54,000.00	2,922,280.74	1.08%	
MEIHUA HOLDINGS GROUP CO LTD. CLASS A (600873C1)	50.52	57,000.00	2,879,373.92	1.06%	
LENS TECHNOLOGY CO., LTD. CLASS A (300433C2)	97.67	28,300.00	2,764,129.91	1.02%	
FOCUS MEDIA INFORMATION TECHNOLOGY CO., LTD. CLASS A(002027C2)	32.64	78,700.00	2,568,477.60	0.95%	
NINGXIA BAOFENG ENERGY GROUP CO., LTD. CLASS A(600989C1)	76.39	32,900.00	2,513,161.42	0.93%	
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY (BEIJING) CO., LTD. CLASS A(300003C2)	56.90	42,700.00	2,429,659.76	0.90%	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS CO., LTD.(966HK)	54.03	43,200.00	2,334,023.25	0.86%	
DONG-E-E-JIAO CO., LTD. CLASS A(000423C2)	274.00	8,500.00	2,329,026.41	0.86%	
ZTE CORPORATION CLASS A(000063C2)	147.38	15,600.00	2,299,185.47	0.85%	
KE HOLDINGS, INC. SPONSORED ADR CLASS A(BEKEUN)	645.50	3,500.00	2,259,247.90	0.83%	
KINGSOFT CORP. LTD.(3888HK)	138.15	15,400.00	2,127,518.93	0.78%	
PINDUODUO, INC. SPONSORED ADR CLASS A (PDDUW)	3,306.60	600.00	1,983,960.38	0.73%	
CITIC SECURITIES CO., LTD. CLASS A (600030C1)	145.44	12,700.00	1,847,144.20	0.68%	
CHANGJIANG SECURITIES CO., LTD CLASS A (000783C2)	33.01	55,600.00	1,835,617.43	0.68%	
CHINA CONSTRUCTION BANK CORPORATION CLASS H(939HK)	25.74	69,000.00	1,775,938.91	0.65%	

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนไทยพาณิชย์ จำกัด
 กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Machine Learning China All Share
 รายละเอียดหลักทรัพย์ และสัดส่วนการลงทุน
 ณ วันที่ 30 พฤศจิกายน 2567

ชื่อหลักทรัพย์	ราคา ณ 30 พฤศจิกายน 2567 (บาท)	จำนวนหุ้น (หุ้น)	มูลค่า	ร้อยละของมูลค่า ทรัพย์สินสุทธิ (%)	ค่าประกัน/รับรอง/รับอาวัล หรือสลักหลังโอน แบบมีสิทธิไต่เบี่ย
GAN & LEE PHARMACEUTICALS CO., LTD. CLASS A(603087C1)	220.37	7,900.00	1,740,891.72	0.64%	
LUXSHARE PRECISION INDUSTRY CO., LTD. CLASS A(002475C2)	182.95	9,400.00	1,719,753.80	0.63%	
BAIDU, INC. CLASS A(9888HK)	357.70	4,800.00	1,716,938.93	0.63%	
SHAANXI ENERGY INVESTMENT CO., LTD. CLASS A(001286C2)	45.41	37,600.00	1,707,304.70	0.63%	
GUOYUAN SECURITIES CO., LTD. CLASS A (000728C2)	40.11	42,000.00	1,684,601.18	0.62%	
TIANQI LITHIUM INDUSTRIES, INC CLASS A (002466C2)	180.59	9,200.00	1,661,405.75	0.61%	
WEICHAI POWER CO., LTD. CLASS H(2338HK)	47.16	35,000.00	1,650,767.44	0.61%	
JIANGXI COPPER CO., LTD. CLASS H(358HK)	54.91	30,000.00	1,647,247.68	0.61%	
WUXI LEAD INTELLIGENT EQUIPMENT CO., LTD. CLASS A(300450C2)	111.72	14,700.00	1,642,287.50	0.61%	
TCL TECHNOLOGY GROUP CORPORATION CLASS A(000100C2)	22.14	73,800.00	1,633,631.78	0.60%	
NINESTAR CORPORATION CLASS A(002180C2)	126.19	11,000.00	1,388,131.05	0.51%	
EAST MONEY INFORMATION CO., LTD CLASS A(300059C2)	128.94	10,700.00	1,379,626.69	0.51%	
KUAISHOU TECHNOLOGY CLASS B(1024HK)	212.07	6,400.00	1,357,219.46	0.50%	
SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOGY CO., LTD. CLASS A(300037C2)	193.88	6,900.00	1,337,762.35	0.49%	
SHANDONG SUNPAPER CO., LTD. CLASS A (002078C2)	69.43	19,200.00	1,333,150.69	0.49%	
CHINA RESOURCES LAND LIMITED(1109HK)	101.19	12,500.00	1,264,913.75	0.47%	
MIDEA GROUP CO. LTD. CLASS A(000333C2)	331.71	3,700.00	1,227,319.18	0.45%	
TINGYI (CAYMAN ISLANDS) HOLDING CORP. (322HK)	42.90	28,000.00	1,201,118.10	0.44%	
CHINA UNITED NETWORK COMMUNICATIONS LIMITED CLASS A (600050C1)	24.36	49,100.00	1,196,026.16	0.44%	
QIFU TECHNOLOGY, INC.(QFINUW)	1,305.04	900.00	1,174,534.96	0.43%	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LIMITED (175HK)	60.98	19,000.00	1,158,617.00	0.43%	
TRIP.COM GROUP LTD.(9961HK)	2,237.25	500.00	1,118,623.73	0.41%	

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด
 กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Machine Learning China All Share
 รายละเอียดหลักทรัพย์ และสัดส่วนการลงทุน
 ณ วันที่ 30 พฤศจิกายน 2567

ชื่อหลักทรัพย์	ราคา ณ 30 พฤศจิกายน 2567 (บาท)	จำนวนหุ้น (หุ้น)	มูลค่า	ร้อยละของมูลค่า หลักทรัพย์ในสุทธิ (%)	ค่าประกัน/รับรอง/รับอาวัล หรือสลักหลังโอน แบบมีสิทธิไล่เบี่ย
LB GROUP CO., LTD.(002601C2)	84.29	13,100.00	1,104,157.32	0.41%	
INDUSTRIAL AND COMMERCIAL BANK OF CHINA LIMITED CLASS H(1398HK)	20.06	55,000.00	1,103,444.76	0.41%	
TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOGY CO., LTD. CLASS A(002185C2)	56.00	19,400.00	1,086,439.11	0.40%	
SEAZEN HOLDINGS CO.,LTD. CLASS A (601155C1)	64.66	16,200.00	1,047,455.27	0.39%	
HENGDIAN GROUP DMEGC MAGNETICS CO.,LTD. CLASS A(002056C2)	63.66	16,400.00	1,044,097.05	0.38%	
GUOLIAN SECURITIES CO., LTD. CLASS A (601456C1)	57.89	17,200.00	995,776.39	0.37%	
SITC INTERNATIONAL HOLDINGS CO., LTD. (1308HK)	89.09	11,000.00	980,033.18	0.36%	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBILE CO., LTD. CLASS A(000625C2)	65.32	14,500.00	947,138.83	0.35%	
ALUMINUM CORPORATION OF CHINA LIMITED CLASS H(2600HK)	20.33	46,000.00	935,024.24	0.34%	
SINO BIOPHARMACEUTICAL LIMITED (1177HK)	14.30	65,000.00	929,436.63	0.34%	
BEIJING YANJING BREWERY CO., LTD. CLASS A(000729C2)	49.10	18,900.00	927,921.24	0.34%	
POP MART INTERNATIONAL GROUP LIMITED (9992HK)	395.31	2,200.00	869,688.70	0.32%	
CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL GROUP LTD.(3320HK)	23.10	37,500.00	866,190.94	0.32%	
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICAL PRODUCTS CO., LTD. CLASS A(300122C2)	139.01	6,000.00	834,070.57	0.31%	
SOOCHOW SECURITIES CO., LTD. CLASS A (601555C1)	38.88	21,300.00	828,139.27	0.31%	
WANDA FILM HOLDING CO., LTD. CLASS A (002739C2)	58.04	13,800.00	800,895.05	0.30%	
CSPC INNOVATION PHARMACEUTICAL CO., LTD. CLASS A(300765C2)	134.85	5,800.00	782,126.80	0.29%	
SUZHOU TFC OPTICAL COMMUNICATION CO., LTD. CLASS A(300394C2)	488.50	1,600.00	781,606.52	0.29%	

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด
 กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Machine Learning China All Share
 รายละเอียดหลักทรัพย์ และสัดส่วนการลงทุน
 ณ วันที่ 30 พฤศจิกายน 2567

ชื่อหลักทรัพย์	ราคา ณ 30 พฤศจิกายน 2567 (บาท)	จำนวนหุ้น (หุ้น)	มูลค่า	ร้อยละของมูลค่า ทรัพย์สินสุทธิ (%)	ค่าประกัน/รับรอง/รับอาวัล หรือสลักหลัง โอน แบบมีสิทธิไต่เบี่ย
LIVZON PHARMACEUTICAL GROUP, INC. CLASS A(000513C2)	180.63	4,300.00	776,729.99	0.29%	
ZHENGZHOU YUTONG BUS CO., LTD. CLASS A(600066C1)	103.58	7,200.00	745,810.63	0.27%	
CONTEMPORARY AMPEREX TECHNOLOGY CO., LTD. CLASS A(300750C2)	1,235.64	600.00	741,383.45	0.27%	
HENAN SHENHUO COAL & POWER CO LTD CLASS A(000933C2)	76.39	9,700.00	740,962.48	0.27%	
ZHEJIANG NHU CO., LTD. CLASS A(002001C2)	102.88	7,100.00	730,414.81	0.27%	
WH GROUP LTD. (HK)(288HK)	27.15	26,500.00	719,372.95	0.27%	
J-YUAN TRUST CO.LTD. CLASS A(600816C1)	17.12	42,000.00	719,134.00	0.27%	
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP CO., LTD.(3692HK)	84.91	8,000.00	679,313.68	0.25%	
VICTORY GIANT TECHNOLOGY (HUIZHOU) CO., LTD. CLASS A(300476C2)	191.84	3,500.00	671,456.60	0.25%	
HUAGONG TECH CO., LTD. CLASS A(000988C2)	168.90	3,900.00	658,728.44	0.24%	
XJ ELECTRIC CO., LTD. CLASS A(000400C2)	122.03	4,800.00	585,750.82	0.22%	
KUNLUN ENERGY CO., LTD.(135HK)	32.29	18,000.00	581,288.36	0.21%	
หน่วยลงทุน			11,550,522.22	4.26%	
หน่วยลงทุนต่างประเทศ			11,550,522.22	4.26%	
CHINAAMC CSI 300 IDX ETF(83188HK)	191.18	37,600.00	7,188,464.18	2.65%	
HUATAI-PINEBRIDGE CSI 300 ETF(510300C1)	18.92	230,500.00	4,362,058.04	1.61%	
เงินฝากธนาคาร			6,946,028.61	2.56%	
บมจ.ธนาคารกสิกรไทย(KBANK)	0.00	0.00	6,946,028.61	2.56%	
สัญญาซื้อขายล่วงหน้า / FORWARD			(2,019,873.77)	(0.74%)	
สัญญาซื้อขายล่วงหน้า/FORWARD (FWTHBHKD25808D)	0.00	1.00	1,665,379.58	0.61%	
สัญญาซื้อขายล่วงหน้า/FORWARD (FWCNHTHB25613A)	0.00	1.00	787,740.00	0.29%	
สัญญาซื้อขายล่วงหน้า/FORWARD (FWTHBHKD25808E)	0.00	1.00	720,542.74	0.27%	
สัญญาซื้อขายล่วงหน้า/FORWARD (FWCNHTHB25613G)	0.00	1.00	556,613.92	0.21%	
สัญญาซื้อขายล่วงหน้า/FORWARD (FWHKDTHB25808G)	0.00	1.00	196,595.65	0.07%	

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด
 กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Machine Learning China All Share
 รายละเอียดหลักทรัพย์ และสัดส่วนการลงทุน
 ณ วันที่ 30 พฤศจิกายน 2567

ชื่อหลักทรัพย์	ราคา ณ 30 พฤศจิกายน 2567 (บาท)	จำนวนหุ้น (หุ้น)	มูลค่า	ร้อยละของมูลค่า ทรัพย์สินสุทธิ (%)	ค่าประกัน/รับรอง/รับอาวัล หรือสลักหลัง โอน แบบมีสิทธิไต่เบี่ย
สัญญาซื้อขายล่วงหน้า/FORWARD (FWTHBUSD25808AE)	0.00	1.00	96,404.59	0.04%	
สัญญาซื้อขายล่วงหน้า/FORWARD (FWTHBUSD25808M)	0.00	1.00	18,012.95	0.01%	
สัญญาซื้อขายล่วงหน้า/FORWARD (FWTHBUSD25808W)	0.00	1.00	16,844.60	0.01%	
สัญญาซื้อขายล่วงหน้า/FORWARD (FWTHBUSD25808K)	0.00	1.00	8,197.77	0.00%	
สัญญาซื้อขายล่วงหน้า/FORWARD (FWUSDTHB25808EC)	0.00	1.00	6,121.08	0.00%	
สัญญาซื้อขายล่วงหน้า/FORWARD (FWTHBUSD25808G)	0.00	1.00	311.59	0.00%	
สัญญาซื้อขายล่วงหน้า/FORWARD (FWTHBUSD25808C)	0.00	1.00	143.18	0.00%	
สัญญาซื้อขายล่วงหน้า/FORWARD (FWTHBCNH25808D)	0.00	1.00	(7,180.00)	0.00%	
สัญญาซื้อขายล่วงหน้า/FORWARD (FWHKDTHB25808I)	0.00	1.00	(8,296.16)	0.00%	
สัญญาซื้อขายล่วงหน้า/FORWARD (FWTHBHKD25808A)	0.00	1.00	(12,322.45)	0.00%	
สัญญาซื้อขายล่วงหน้า/FORWARD (FWTHBCNH25808H)	0.00	1.00	(17,682.64)	(0.01%)	
สัญญาซื้อขายล่วงหน้า/FORWARD (FWTHBCNH25808F)	0.00	1.00	(18,111.58)	(0.01%)	
สัญญาซื้อขายล่วงหน้า/FORWARD (FWCNHTHB25808F)	0.00	1.00	(19,333.93)	(0.01%)	
สัญญาซื้อขายล่วงหน้า/FORWARD (FWTHBCNH25613A)	0.00	1.00	(29,746.28)	(0.01%)	
สัญญาซื้อขายล่วงหน้า/FORWARD (FWUSDTHB25808JL)	0.00	1.00	(47,483.91)	(0.02%)	
สัญญาซื้อขายล่วงหน้า/FORWARD (FWCNHTHB25808C)	0.00	1.00	(74,430.49)	(0.03%)	
สัญญาซื้อขายล่วงหน้า/FORWARD (FWUSDTHB25808MO)	0.00	1.00	(160,059.14)	(0.06%)	
สัญญาซื้อขายล่วงหน้า/FORWARD (FWTHBCNH25808A)	0.00	1.00	(323,854.37)	(0.12%)	

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด
 กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Machine Learning China All Share
 รายละเอียดหลักทรัพย์ และสัดส่วนการลงทุน
 ณ วันที่ 30 พฤศจิกายน 2567

ชื่อหลักทรัพย์	ราคา ณ 30 พฤศจิกายน 2567 (บาท)	จำนวนหุ้น (หุ้น)	มูลค่า	ร้อยละของมูลค่า ทรัพย์สินสุทธิ (%)	ค่าประกัน/รับรอง/รับอาวัล หรือสลักหลัง โอน แบบมีสิทธิไต่เบี่ย
สัญญาซื้อขายล่วงหน้า/FORWARD (FWCNH25613I)	0.00	1.00	(608,494.34)	(0.22%)	
สัญญาซื้อขายล่วงหน้า/FORWARD (FWTHBCNH25808D)	0.00	1.00	(643,767.38)	(0.24%)	
สัญญาซื้อขายล่วงหน้า/FORWARD (FWHKDTHB25808R)	0.00	1.00	(874,778.57)	(0.32%)	
สัญญาซื้อขายล่วงหน้า/FORWARD (FWTHBCNH25613D)	0.00	1.00	(1,002,822.06)	(0.37%)	
สัญญาซื้อขายล่วงหน้า/FORWARD (FWHKDTHB25808U)	0.00	1.00	(2,244,418.12)	(0.83%)	
สินทรัพย์อื่น			343,273.26	0.13%	
หนี้สินอื่น			(664,589.07)	(0.24%)	
มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ			271,264,734.75	100.00%	
มูลค่าหน่วยลงทุน (บาท)			7.2353		

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนไทยพาณิชย์
 กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Machine Learning China All Share

รายงานสรุปเงินลงทุน
 ณ วันที่ 30 พฤศจิกายน 2567

กลุ่มของตราสาร	มูลค่าตามราคาตลาด	%NAV
(ก) ตราสารภาครัฐ ได้แก่ ตัวแลกเปลี่ยน พันธบัตรรัฐบาล พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย พันธบัตร หรือตราสารแห่งหนึ่งที่กองทุนเพื่อการฟื้นฟูและพัฒนาสถาบันการเงิน หรือกระทรวงการคลัง เป็นผู้ออก ผู้รับรอง ผู้รับอ่าวัด หรือผู้ค้ำประกัน	-	-
(ข) ตราสารที่ธนาคารที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้น ธนาคารพาณิชย์ หรือบริษัทเงินทุนเป็นผู้ออก ผู้รับรอง ผู้รับอ่าวัด ผู้สตั๊กหลัง หรือผู้ค้ำประกัน	6,946,028.61	2.56
(ค) ตราสารที่มีบริษัทที่ได้รับ rating ในระดับ investment grade เป็นผู้ออก ผู้รับรอง ผู้รับอ่าวัด ผู้สตั๊กหลัง หรือผู้ค้ำประกัน	-	-
(ง) ตราสารที่มีบริษัทที่ได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือในระดับที่ต่ำกว่า investment grade หรือไม่มี rating เป็นผู้ออก ผู้รับรอง ผู้รับอ่าวัด ผู้สตั๊กหลัง หรือผู้ค้ำประกัน	-	-

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

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนไทยพาณิชย์

กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Machine Learning China All Share

รายละเอียดตัวตราสารและอันดับความน่าเชื่อถือของตราสารทุกตัวใน Port

ณ วันที่ 30 พฤศจิกายน 2567

ประเภท	ผู้ออก	ผู้ค้ำ/ผู้รับรอง/ผู้หลักหลัง	วันครบกำหนด	อันดับความน่าเชื่อถือของผู้ออกตราสาร		มูลค่าหน้าตัว	มูลค่าตามราคาตลาด
				TRIS Rating	FITCH Rating		
เงินฝากธนาคาร	บมจ.ธนาคารกรุงไทย				AA+(tha)	-	6,946,028.61

กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Machine Learning China All Share

SCB Machine Learning China All Share

แบบค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม

FUND'S DIRECT EXPENSES REPORT

ตั้งแต่วันที่ 1 ธันวาคม 2566 ถึงวันที่ 30 พฤศจิกายน 2567

Period from 1 December 2023 to 30 November 2024

ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม * Fund's direct expenses	จำนวนเงิน หน่วย : พันบาท	ร้อยละต่อปีของ มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ
ค่าธรรมเนียมบริหารกองทุน (Management Fee)		
- ชนิดช่องทางอิเล็กทรอนิกส์ (SCBMLCA(E))	-	-
- ชนิดสะสมมูลค่า (SCBMLCAA)	2,773	1.07
- ชนิดเพื่อการออม (SCBMLCA(SSF))	41	1.07
- ชนิดเพื่อการออมผ่านช่องทางอิเล็กทรอนิกส์ (SCBMLCA(SSFE))	-	-
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ (Trustee Fee)	108	0.04
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียนหน่วยลงทุน (Registrar Fee)	180	0.07
ค่าที่ปรึกษาการลงทุน (Advisor Fee)	-	-
ค่าใช้จ่ายทั่วไป (General expense)	363	0.14
ค่าสอบบัญชี (Audit Fee)	45	0.02
ค่าใช้จ่ายอื่น (Other expense)	23	0.01
รวมค่าใช้จ่ายทั้งหมด (Total Expense) **	3,533	1.34

* ค่าใช้จ่ายดังกล่าวได้รวมภาษีมูลค่าเพิ่มแล้ว / Including VAT

** ไม่รวมค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ และค่าธรรมเนียมต่าง ๆ ที่เกิดขึ้นจากการซื้อขายหลักทรัพย์

Excluding brokerage fee and other transactions fees

** ไม่รวมค่าภาษีเงินได้นิติบุคคลสำหรับเงินได้ตามมาตรา 40 (4) (ก) แห่งประมวลรัษฎากร

Not including corporate income tax for income under Section 40 (4) (a) of the Revenue Code

รายงานการซื้อขายหลักทรัพย์และค่าใช้จ่ายต่าง ๆ

VOLUME TRADE AND EXPENSES REPORT

ตั้งแต่วันที่ 1 ธันวาคม 2566 ถึงวันที่ 30 พฤศจิกายน 2567

Period from 1 December 2023 to 30 November 2024

	(พันบาท) / (Thousand Bath)
มูลค่าทรัพย์สินสุทธิเฉลี่ย / Average Net Assets Value	264,605
การซื้อขายหลักทรัพย์รวม / Volume Trade	
มูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์รวม	1,427,153
Total Volume Trade	
ค่าธรรมเนียมหน้าในการซื้อขายหลักทรัพย์รวม	1,301
Total Brokerage Fee	
ค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายอื่น ๆ รวม / Fee and other Expenses	3,533
	(ร้อยละ) / (Percentage)
• สัดส่วนค่าธรรมเนียมหน้าในการซื้อขายหลักทรัพย์รวมคิดเป็นร้อยละของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์รวม	0.09
Brokerage Fee as	
Percentage of Total Trading Volume	
• สัดส่วนค่าธรรมเนียมหน้าในการซื้อขายหลักทรัพย์รวมคิดเป็นร้อยละของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิเฉลี่ย	0.49
Brokerage Fee as	
Percentage of Average Net Assets Value	
• สัดส่วนค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายอื่น ๆ รวมคิดเป็นร้อยละของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิเฉลี่ย	1.34
Fee and other Expenses as	
Percentage of Average Net Assets Value	
• สัดส่วนค่าธรรมเนียมหน้าในการซื้อขายหลักทรัพย์รวมคิดเป็นร้อยละ	2.68
Portfolio Turnover Ratio (PTR)	

รายงานรายชื่อบริษัทนายหน้า และค่าธรรมเนียม ซื้อ-ขาย หลักทรัพย์

ของกองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Machine Learning China All Share

ระหว่างวันที่ 1 ธันวาคม 2566 ถึงวันที่ 30 พฤศจิกายน 2567

ลำดับที่	ชื่อบริษัทนายหน้า	ค่านายหน้า (พันบาท)	อัตราส่วนค่านายหน้าแต่ละราย ต่อค่านายหน้าทั้งหมด
1	UOB Kay Hian Pte Ltd	1,058.91	81.42%
2	Maybank Kim Eng Securities Pte Ltd	240.55	18.50%
3	DBS Vickers Securities (Singapore) Pte Ltd	1.09	0.08%
	รวม	1,300.55	100.00%

การรับผลประโยชน์ตอบแทนเนื่องจากการที่กองทุนใช้บริการบุคคลอื่น ประจำเดือน ธันวาคม 2567

BENEFIT FROM BROKERAGE SERVICES AS OF DECEMBER 2024

บริษัทที่ให้ผลประโยชน์	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	ASIA PLUS SECURITIES COMPANY LIMITED	✓	✓	✓		✓	
บริษัทหลักทรัพย์ บัวหลวง จำกัด (มหาชน)	BUALUANG SECURITIES PUBLIC COMPANY LIMITED	✓	✓	✓	✓	✓	✓
บริษัทหลักทรัพย์ ซี เอส เอ (ประเทศไทย) จำกัด	CLSA SECURITIES (THAILAND) LIMITED	✓	✓	✓		✓	
บริษัทหลักทรัพย์เครดิต สวิส (ประเทศไทย) จำกัด	CREDIT SUISSE SECURITIES (THAILAND) LIMITED	✓	✓	✓		✓	
บริษัทหลักทรัพย์ เมย์แบงก์ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)	MAYBANK SECURITIES (THAILAND) PUBLIC COMPANY LIMITED	✓	✓	✓		✓	
บริษัทหลักทรัพย์ กสิกรไทย จำกัด (มหาชน)	KASIKORN SECURITIES PUBLIC COMPANY LIMITED	✓	✓	✓		✓	
บริษัทหลักทรัพย์ กรุงศรี จำกัด (มหาชน)	KRUNGSRI SECURITIES PUBLIC COMPANY LIMITED	✓	✓	✓		✓	
บริษัทหลักทรัพย์ เกียรตินาคินภัทร จำกัด (มหาชน)	KIATNAKIN PHATRA SECURITIES PUBLIC COMPANY LIMITED	✓	✓	✓	✓	✓	
บริษัทหลักทรัพย์ อินโนเวสตี้ เอกซ์ จำกัด	INNOVESTX SECURITIES CO., LTD.	✓	✓	✓		✓	✓
บริษัทหลักทรัพย์ธนชาต จำกัด (มหาชน)	THANACHART SECURITIES PUBLIC COMPANY LIMITED	✓	✓	✓		✓	
บริษัทหลักทรัพย์ ทีเอสไอ จำกัด	TISCO SECURITIES COMPANY LIMITED	✓	✓	✓		✓	
บริษัทหลักทรัพย์ ซีจีเอส อินเตอร์เนชันแนล (ประเทศไทย) จำกัด	CGS INTERNATIONAL SECURITIES (THAILAND) COMPANY LIMITED	✓	✓	✓	✓	✓	
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 วิคเคอร์ส (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 ดาโอ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)	DAOL SECURITIES (THAILAND) PUBLIC COMPANY LIMITED	✓	✓	✓		✓	
บริษัทหลักทรัพย์ ยูโอบี เคย์ฮัน (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)	UOB KAYHIAN SECURITIES (THAILAND) PUBLIC COMPANY LIMITED	✓	✓	✓	✓	✓	
บริษัทหลักทรัพย์ กรุงไทย เอ็กซ์สปริง จำกัด	KRUNGTHAI XSPRING SECURITIES COMPANY LIMITED	✓	✓	✓		✓	✓
บริษัท หลักทรัพย์ซีทีคอร์ป (ประเทศไทย) จำกัด	CITICORP SECURITIES (THAILAND) LIMITED	✓	✓	✓		✓	
บริษัทหลักทรัพย์ เจพีมอร์แกน (ประเทศไทย) จำกัด	JPMORGAN SECURITIES (THAILAND) LIMITED	✓	✓	✓		✓	
บริษัทหลักทรัพย์ หยวนต้า (ประเทศไทย) จำกัด	YUANTA SECURITIES (THAILAND) COMPANY LIMITED	✓	✓	✓		✓	

*ผลประโยชน์ที่ได้รับ SERVICES

1. บทวิเคราะห์ (รายบริษัทและสภาพตลาดฯ รายวัน, รายเดือน, รายไตรมาส) Analysis Reports (Market Summary and Companies updated analysis on daily, monthly and quarterly basis)
2. ข้อมูลพื้นฐาน (ข้อมูลตลาดฯ, งบการเงิน บมจ. ขึ้นหลัง) (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.scbam.com

กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Machine Learning China All Share

รายชื่อบุคคลที่เกี่ยวข้องที่มีการทำธุรกรรมกับกองทุน

ตั้งแต่วันที่ 01 ธันวาคม 2566 ถึงวันที่ 30 พฤศจิกายน 2567

ลำดับ	รายชื่อบุคคลที่เกี่ยวข้อง
1	ธนาคารไทยพาณิชย์ จำกัด (มหาชน)
2	บริษัทหลักทรัพย์ อินโนเวสต์ เอกซ์ จำกัด

ผู้ลงทุนสามารถตรวจสอบรายละเอียดการทำธุรกรรมกับบุคคลที่เกี่ยวข้องกับกองทุนรวมได้ที่บริษัทจัดการโดยตรง หรือที่ Website ของบริษัทจัดการที่ <http://www.scbam.com> และที่ Website ของสำนักงาน ก.ล.ด.

รายชื่อผู้จัดการกองทุน (Fund Manager)

กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Machine Learning China All Share

ลำดับ	ชื่อ - นามสกุล	ลำดับ	ชื่อ - นามสกุล
1	นายพูนศักดิ์ ไล่ห้สุนทร	10	นายปรกรณ์ เก้าเอียน
2	นายไพรัช นิตยานุภาพ	11	นายทศพร โลหะสุนศิริ
3	นายสฤติพงษ์ จันทระจิรวงศ์	12	นายปิยวัฒน์ ภัทรเชียรชัย
4	นายกฤษ จันทรหนัก	13	นายวิจักขณ์ ณ เชียงใหม่
5	นายณัฐวุฒิ เดชบัณฑิต	14	นางสาวปาติดา เครือโสภณ
6	นายกฤษณา จิตมั่นชัยธรรม	15	นางสาวนรินทรา คิณรัตน์สกุลชัย
7	นางวิไล ชยางคเสน	16	นางสาวกัณต์พี ปธานราษฎร์
8	นายอนุตร อัมระนันท์	17	นายณันพิชา จุงศิริวัฒน์
9	นางสาวนภาพรรณ จึงจิ้นต์เจริญ		

การถือหุ้นลงทุนเกิน 1 ใน 3

- ไม่มี -

ข้อมูลการดำเนินการใช้สิทธิออกเสียงในที่ประชุมผู้ถือหุ้นในนามกองทุนรวม

ผู้ลงทุนสามารถตรวจสอบรายละเอียดรายงานการใช้สิทธิออกเสียงได้ที่ Website ของบริษัทจัดการ ที่ <https://www.scbam.com/th/about/about-conflict/> ในส่วนของนโยบายการใช้สิทธิออกเสียง



SP AUDIT CO.,LTD. บริษัท เอส พี ออดิท จำกัด

475 Siripinyo Building, 16 Floor, Unit 1601, Sriyuthaya Road, Thanon Phayathai, Ratchathewi, Bangkok. 10400 T: +66 2 354-2192-4
เลขที่ 475 อาคารสิริกัญญ์ ชั้น 16 ยูนิท 1601 ถนนศรีอยุธยา แขวงถนนพญาไท เขตราชเทวี กรุงเทพมหานคร 10400 โทร. +66 2 354-2192-4

รายงานของผู้สอบบัญชีรับอนุญาต

เสนอ ผู้ถือหุ้นวงลงทุนของกองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Machine Learning China All Share

ความเห็น

ข้าพเจ้าได้ตรวจสอบงบการเงินของกองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Machine Learning China All Share (“กองทุน”) ซึ่งประกอบด้วย งบแสดงฐานะการเงิน และงบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน ณ วันที่ 30 พฤศจิกายน 2567 งบกำไรขาดทุนเบ็ดเสร็จ และงบแสดงการเปลี่ยนแปลงสินทรัพย์สุทธิ สำหรับปีสิ้นสุดวันเดียวกัน และหมายเหตุประกอบงบการเงินรวมถึงสรุปนโยบายการบัญชีที่สำคัญ

ข้าพเจ้าเห็นว่างบการเงินข้างต้นนี้แสดงฐานะการเงินของกองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Machine Learning China All Share ณ วันที่ 30 พฤศจิกายน 2567 ผลการดำเนินงาน และการเปลี่ยนแปลงสินทรัพย์สุทธิ สำหรับปีสิ้นสุดวันเดียวกัน โดยถูกต้องตามที่ควรในสาระสำคัญตามแนวปฏิบัติทางบัญชีว่าด้วยการบัญชีสำหรับกิจการที่ดำเนินธุรกิจเฉพาะด้านการลงทุนตามที่สมาคมบริษัทจัดการลงทุนกำหนด โดยได้รับความเห็นชอบจากสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

เกณฑ์ในการแสดงความเห็น

ข้าพเจ้าได้ปฏิบัติตามตรวจสอบตามมาตรฐานการสอบบัญชี ความรับผิดชอบของข้าพเจ้าได้กล่าวไว้ในวรรคความรับผิดชอบของผู้สอบบัญชีต่อการตรวจสอบงบการเงินในรายงานของข้าพเจ้า ข้าพเจ้ามีความเป็นอิสระจากกองทุนตามประมวลจรรยาบรรณของผู้ประกอบวิชาชีพบัญชี รวมถึงมาตรฐานเรื่องความเป็นอิสระ ที่กำหนดโดยสภาวิชาชีพบัญชี (“ประมวลจรรยาบรรณของผู้ประกอบวิชาชีพบัญชี”) ในส่วนที่เกี่ยวข้องกับการตรวจสอบงบการเงิน และข้าพเจ้าได้ปฏิบัติตามความรับผิดชอบด้านจรรยาบรรณอื่น ๆ ตามประมวลจรรยาบรรณของผู้ประกอบวิชาชีพบัญชี ข้าพเจ้าเชื่อว่าหลักฐานการสอบบัญชีที่ข้าพเจ้าได้รับเพียงพอและเหมาะสมเพื่อใช้เป็นเกณฑ์ในการแสดงความเห็นของข้าพเจ้า

ความรับผิดชอบของผู้บริหารกองทุนต้องการเงิน

ผู้บริหารกองทุนมีหน้าที่รับผิดชอบในการจัดทำและนำเสนอของงบการเงินเหล่านี้โดยถูกต้องตามที่ควรตามแนวปฏิบัติทางบัญชีว่าด้วยการบัญชีสำหรับกิจการที่ดำเนินธุรกิจเฉพาะด้านการลงทุนตามที่สมาคมบริษัทจัดการลงทุนกำหนด โดยได้รับความเห็นชอบจากสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ และรับผิดชอบเกี่ยวกับการควบคุมภายในที่ผู้บริหารกองทุนพิจารณาว่าจำเป็นเพื่อให้สามารถจัดทำงบการเงินที่ปราศจากการแสดงข้อมูลที่ขัดต่อข้อเท็จจริงอันเป็นสาระสำคัญไม่ว่าจะเกิดจากการทุจริตหรือข้อผิดพลาด

ในการจัดทำงบการเงิน ผู้บริหารกองทุนรับผิดชอบในการประเมินความสามารถของกองทุนในการดำเนินงานต่อเนื่อง เปิดเผยเรื่องที่เกี่ยวข้องกับการดำเนินงานต่อเนื่อง (ตามความเหมาะสม) และการใช้เกณฑ์การบัญชีสำหรับการดำเนินงานต่อเนื่องเว้นแต่ผู้บริหารกองทุนมีความตั้งใจที่จะเลิกกองทุนหรือหยุดดำเนินงานหรือไม่สามารถดำเนินงานต่อเนื่องต่อไปได้

► email : spaudit@spaudit.co.th

SP Audit Co., Ltd.

ความรับผิดชอบของผู้สอบบัญชีต่อการตรวจสอบงบการเงิน

การตรวจสอบของข้าพเจ้ามีวัตถุประสงค์เพื่อให้ได้ความเชื่อมั่นอย่างสมเหตุสมผลว่างบการเงิน โดยรวมปราศจากการแสดงข้อมูลที่ขัดต่อข้อเท็จจริงอันเป็นสาระสำคัญหรือไม่ ไม่ว่าจะเกิดจากการทุจริตหรือข้อผิดพลาด และเสนอรายงานของผู้สอบบัญชีซึ่งรวมความเห็นของข้าพเจ้าอยู่ด้วย ความเชื่อมั่นอย่างสมเหตุสมผลคือความเชื่อมั่นในระดับสูงแต่ไม่ได้เป็นการรับประกันว่าการปฏิบัติงานตรวจสอบตามมาตรฐานการสอบบัญชีจะสามารถตรวจพบข้อมูลที่ขัดต่อข้อเท็จจริงอันเป็นสาระสำคัญที่มีอยู่ได้เสมอไป ข้อมูลที่ขัดต่อข้อเท็จจริงอาจเกิดจากการทุจริตหรือข้อผิดพลาดและถือว่ามีสาระสำคัญเมื่อพิจารณาแล้วได้อย่างสมเหตุสมผลว่ารายการที่ขัดต่อข้อเท็จจริงแต่ละรายการหรือทุกรายการรวมกันจะมีผลต่อการตัดสินใจทางเศรษฐกิจของผู้ใช้งบการเงินจากการใช้งบการเงินเหล่านี้

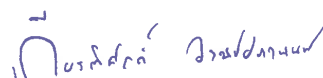
ในการตรวจสอบของข้าพเจ้าตามมาตรฐานการสอบบัญชี ข้าพเจ้าได้ใช้ดุลยพินิจและการสังเกตและสงสัยของผู้ประกอบวิชาชีพตลอดการตรวจสอบ การปฏิบัติงานของข้าพเจ้ารวมถึง

- ระบุและประเมินความเสี่ยงจากการแสดงข้อมูลที่ขัดต่อข้อเท็จจริงอันเป็นสาระสำคัญในงบการเงิน ไม่ว่าจะเกิดจากการทุจริตหรือข้อผิดพลาด ออกแบบและปฏิบัติตามตามวิธีการตรวจสอบเพื่อตอบสนองต่อความเสี่ยงเหล่านั้น และได้หลักฐานการสอบบัญชีที่เพียงพอและเหมาะสมเพื่อเป็นเกณฑ์ในการแสดงความเห็นของข้าพเจ้า ความเสี่ยงที่ไม่พบข้อมูลที่ขัดต่อข้อเท็จจริงอันเป็นสาระสำคัญซึ่งเป็นผลมาจากการทุจริตจะสูงกว่าความเสี่ยงที่เกิดจากข้อผิดพลาด เนื่องจากการทุจริตอาจเกี่ยวกับการสมรู้ร่วมคิด การปลอมแปลงเอกสารหลักฐาน การตั้งใจละเว้นการแสดงผล การแสดงผลที่ไม่ตรงตามข้อเท็จจริงหรือการแทรกแซงการควบคุมภายใน
- ทำความเข้าใจในระบบการควบคุมภายในที่เกี่ยวข้องกับการตรวจสอบ เพื่อออกแบบวิธีการตรวจสอบที่เหมาะสมกับสถานการณ์ แต่ไม่ใช่เพื่อวัตถุประสงค์ในการแสดงความเห็นต่อความมีประสิทธิภาพของการควบคุมภายในของกองทุน
- ประเมินความเหมาะสมของนโยบายการบัญชีที่ผู้บริหารกองทุนใช้และความสมเหตุสมผลของประมาณการทางบัญชีและการเปิดเผยข้อมูลที่เกี่ยวข้องซึ่งจัดทำขึ้น โดยผู้บริหารกองทุน
- สรุปร่วมกับความเหมาะสมของการใช้เกณฑ์การบัญชีสำหรับการดำเนินงานต่อเนื่องของผู้บริหารกองทุนและจากหลักฐานการสอบบัญชีที่ได้รับ สรุปร่วมความไม่แน่นอนที่มีสาระสำคัญเกี่ยวกับเหตุการณ์หรือสถานการณ์ที่อาจเป็นเหตุให้เกิดข้อสงสัยอย่างมีนัยสำคัญต่อความสามารถของกองทุนในการดำเนินงานต่อเนื่องหรือไม่ ถ้าข้าพเจ้าได้ข้อสรุปว่ามีความไม่แน่นอนที่มีสาระสำคัญ ข้าพเจ้าต้องกล่าวไว้ในรายงานของผู้สอบบัญชีของข้าพเจ้า โดยให้สังเกตถึงการเปิดเผยข้อมูลในงบการเงินที่เกี่ยวข้อง หรือถ้าการเปิดเผยข้อมูลดังกล่าวไม่เพียงพอ ความเห็นของข้าพเจ้าจะเปลี่ยนแปลงไป ข้อสรุปของข้าพเจ้าขึ้นอยู่กับหลักฐานการสอบบัญชีที่ได้รับจนถึงวันที่ในรายงานของผู้สอบบัญชีของข้าพเจ้า อย่างไรก็ตาม เหตุการณ์หรือสถานการณ์ในอนาคตอาจเป็นเหตุให้กองทุนต้องหยุดการดำเนินงานต่อเนื่อง
- ประเมินการนำเสนอ โครงสร้างและเนื้อหาของงบการเงิน โดยรวม รวมถึงการเปิดเผยข้อมูลว่างบการเงินแสดงรายการและเหตุการณ์ในรูปแบบที่ทำให้มีการนำเสนอข้อมูล โดยถูกต้องตามที่ควรหรือไม่

SP Audit Co., Ltd.

ข้าพเจ้าได้สื่อสารกับผู้บริหารกองทุนในเรื่องต่างๆ ที่สำคัญ ซึ่งรวมถึงขอบเขตและช่วงเวลาของการตรวจสอบตามที่ได้วางแผนไว้ ประเด็นที่มีนัยสำคัญที่พบจากการตรวจสอบ รวมถึงข้อบกพร่องที่มีนัยสำคัญในระบบการควบคุมภายในหากข้าพเจ้าได้พบในระหว่างการตรวจสอบของข้าพเจ้า

บริษัท เอส พี ออดิท จำกัด



(นายเกียรติศักดิ์ วานิชย์ห่านนท์)

ผู้สอบบัญชีรับอนุญาตเลขที่ 9922

กรุงเทพมหานคร

วันที่ 27 ธันวาคม 2567

กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Machine Learning China All Share

งบแสดงฐานะการเงิน

ณ วันที่ 30 พฤศจิกายน 2567

(หน่วย : บาท)

	หมายเหตุ	2567	2566
สินทรัพย์			
เงินลงทุนแสดงด้วยมูลค่ายุติธรรม		266,708,261.48	242,651,883.95
เงินฝากธนาคาร	4	6,882,257.50	2,001,095.06
ลูกหนี้จากดอกเบี้ยและเงินปันผล		358,678.61	55,291.45
สินทรัพย์อนุพันธ์	4, 6	4,072,907.65	18,527.67
รวมสินทรัพย์		<u>278,022,105.24</u>	<u>244,726,798.13</u>
หนี้สิน			
เจ้าหนี้จากการรับซื้อคืนหน่วยลงทุน		337,809.85	147,800.42
หนี้สินอนุพันธ์	4, 6	6,092,781.42	18,306.42
ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย	4	315,653.57	282,726.28
ภาษีเงินได้ค้างจ่าย		2,310.80	2,435.92
หนี้สินอื่น	4	8,814.85	7,478.37
รวมหนี้สิน		<u>6,757,370.49</u>	<u>458,747.41</u>
สินทรัพย์สุทธิ		<u>271,264,734.75</u>	<u>244,268,050.72</u>
สินทรัพย์สุทธิ:			
ทุนที่ได้รับจากผู้ถือหน่วยลงทุน		374,914,663.17	366,976,624.83
กำไร(ขาดทุน)สะสม			
บัญชีปรับสมดุล		40,060,709.71	42,936,815.95
ขาดทุนสะสมจากการดำเนินงาน		(143,710,638.13)	(165,645,390.06)
สินทรัพย์สุทธิ		<u>271,264,734.75</u>	<u>244,268,050.72</u>

กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Machine Learning China All Share

งบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน

ณ วันที่ 30 พฤศจิกายน 2567

การแสดงรายละเอียดเงินลงทุนใช้การจัดกลุ่มตามประเภทของเงินลงทุนและตามประเภทสกุลเงิน

	วันครบกำหนด	อัตรา ดอกเบี้ย (%)	เงินต้น/ จำนวนหน่วย	มูลค่ายุติธรรม (บาท)	ร้อยละของ มูลค่าเงินลงทุน
เงินฝากธนาคาร					
ธนาคารกสิกรไทย จำกัด (มหาชน)					
สกุลเงินดอลลาร์ฮ่องกง	เมื่อทวงถาม	-	9,432.69	41,501.01	0.02
สกุลเงินหยวนจีน	เมื่อทวงถาม	0.25	681.46	3,223.24	-
สกุลเงินดอลลาร์สหรัฐอเมริกา	เมื่อทวงถาม	0.04	106.34	3,641.51	-
รวมเงินฝากธนาคาร				48,365.76	0.02
ตราสารทุนในต่างประเทศ					
Shenzhen Energy Group Company Limited			103,800	3,250,179.16	1.22
ZTE Corporation			15,600	2,299,185.47	0.86
TCL Technology Group Corporation			73,800	1,633,631.78	0.61
Midea Group Company Limited			3,700	1,227,319.18	0.46
XJ Electric Company Limited			4,800	585,750.82	0.22
Dong-E-E-Jiao Company Limited			8,500	2,329,026.41	0.87
Livzon Pharmaceutical Group Inc.			4,300	776,729.99	0.29
Chongqing Changan Automobile Company Limited			14,500	947,138.83	0.36
Gree Electric Appliances, Inc. of Zhuhai			35,700	7,105,520.65	2.66
BOE Technology Group Company Limited			361,500	7,352,393.06	2.76
Guoyuan Securities Company Limited			42,000	1,684,601.18	0.63
Beijing Yanjing Brewery Company Limited			18,900	927,921.24	0.35
Changjiang Securities Company Limited			55,600	1,835,617.43	0.70
Wuliangye Yibin Company Limited			4,700	3,262,774.89	1.22
Henan Shenhua Coal & Power Company Limited			9,700	740,962.48	0.28
Huagong Tech Company Limited			3,900	658,728.44	0.25
Shaanxi Energy Investment Company Limited			37,600	1,707,304.70	0.64
Zhejiang NHU Company Limited			7,100	730,414.81	0.27
Focus Media Information Technology Company Limited			78,700	2,568,477.60	0.96
Zhejiang Sanhua Intelligent Controls Company Limited			32,900	3,610,238.07	1.35
Hengdian Group DMEGC Magnetics Company Limited			16,400	1,044,097.05	0.39
Shandong Sunpaper Company Limited			19,200	1,333,150.69	0.50
GRG Banking Equipment Company Limited			79,300	4,898,558.77	1.84

กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Machine Learning China All Share

งบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน

ณ วันที่ 30 พฤศจิกายน 2567

การแสดงรายละเอียดเงินลงทุนใช้การจัดกลุ่มตามประเภทของเงินลงทุนและตามประเภทสกุลเงิน

	วันครบกำหนด	อัตรา ดอกเบี้ย (%)	เงินต้น/ จำนวนหน่วย	มูลค่ายุติธรรม (บาท)	ร้อยละของ มูลค่าเงินลงทุน
Ninestar Corporation			11,000	1,388,131.05	0.52
Tianshui Huatian Technology Company Limited			19,400	1,086,439.11	0.41
GEM Company Limited			96,600	3,170,943.88	1.19
Tianqi Lithium Industries Inc.			9,200	1,661,405.75	0.62
Luxshare Precision Industry Company Limited			9,400	1,719,753.80	0.64
Lomon Billions Group Company Limited			13,100	1,104,157.32	0.41
Wanda Film Holding Company Limited			13,800	800,895.05	0.30
Kuaishou Technology			6,400	1,357,219.46	0.51
China Shenhua Energy Company Limited			35,500	5,029,297.07	1.89
China Resources Land Limited			12,500	1,264,913.75	0.47
Sino Biopharmaceutical Limited			65,000	929,436.63	0.35
BYD Company Limited			3,000	3,347,291.76	1.26
SITC International Holdings Company Limited			11,000	980,033.18	0.37
New China Life Insurance Company Limited			34,900	3,654,478.81	1.37
People's Insurance Company (Group) of China Limited			399,000	6,512,831.91	2.44
Kunlun Energy Company Limited			18,000	581,288.36	0.22
Industrial and Commercial Bank of China Limited			55,000	1,103,444.76	0.41
China Merchants Port Holdings Company Limited			54,000	2,922,280.74	1.10
Geely Automobile Holdings Limited			19,000	1,158,617.00	0.43
Xiaomi Corporation			34,400	4,199,953.62	1.57
Weichai Power Company Limited			35,000	1,650,767.44	0.62
Aluminum Corporation of China Limited			46,000	935,024.24	0.35
China Pacific Insurance (Group) Company Limited			41,800	4,496,537.40	1.69
China Life Insurance Company Limited			112,000	7,253,521.41	2.72
WH Group Limited			26,500	719,372.95	0.27
Lepu Medical Technology (Beijing) Company Limited			42,700	2,429,659.76	0.91
Shenzhen Capchem Technology Company Limited			6,900	1,337,762.35	0.50
East Money Information Company Limited			10,700	1,379,626.69	0.52
Chongqing Zhifei Biological Products Company Limited			6,000	834,070.57	0.31
Sunwoda Electronic Company Limited			40,000	4,325,020.56	1.62
Suzhou TFC Optical Communication Company Limited			1,600	781,606.52	0.29

กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Machine Learning China All Share

งบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน

ณ วันที่ 30 พฤศจิกายน 2567

การแสดงรายละเอียดเงินลงทุนใช้การจัดกลุ่มตามประเภทของเงินลงทุนและตามประเภทสกุลเงิน

	อัตรา ดอกเบี้ย (%)	เงินต้น/ จำนวนหน่วย	มูลค่ายุติธรรม (บาท)	ร้อยละของ มูลค่าเงินลงทุน
Lens Technology Company Limited		28,300	2,764,129.91	1.04
Wuxi Lead Intelligent Equipment Company Limited		14,700	1,642,287.50	0.62
Victory Giant Technology (HuiZhou) Company Limited		3,500	671,456.60	0.25
Contemporary Amperex Technology Company Limited		600	741,383.45	0.28
CSPC Innovation Pharmaceutical Company Limited		5,800	782,126.80	0.29
Tingyi (Cayman Islands) Holding Corporation		28,000	1,201,118.10	0.45
China Resources Pharmaceutical Group Limited		37,500	866,190.94	0.32
Jiangxi Copper Company Limited		30,000	1,647,247.68	0.62
Meituan		13,300	9,871,650.89	3.70
Hansoh Pharmaceutical Group Company Limited		8,000	679,313.68	0.25
Kingsoft Corporation Limited		15,400	2,127,518.93	0.80
Bank of China Limited		267,000	4,240,738.84	1.59
CITIC Securities Company Limited		12,700	1,847,144.20	0.69
China United Network Communications Limited		49,100	1,196,026.16	0.45
Zhengzhou Yutong Bus Company Limited		7,200	745,810.63	0.28
Youngor Group Company Limited		341,700	13,075,113.25	4.90
Kweichow Moutai Company Limited		800	5,773,278.10	2.16
Fuyao Glass Industry Group Company Limited		19,700	5,218,025.68	1.96
J-Yuan Trust Company Limited		42,000	719,134.00	0.27
MeiHua Holdings Group Company Limited		57,000	2,879,373.92	1.08
Ningxia Baofeng Energy Group Company Limited		32,900	2,513,161.42	0.94
Seazen Holdings Company Limited		16,200	1,047,455.27	0.39
Universal Scientific Industrial (Shanghai) Company Limited		57,900	3,883,351.96	1.46
Industrial and Commercial Bank of China Limited		130,900	3,807,735.05	1.43
Guolian Securities Company Limited		17,200	995,776.39	0.37
Soochow Securities Company Limited		21,300	828,139.27	0.31
Gan & Lee Pharmaceuticals Company Limited		7,900	1,740,891.72	0.65
Tencent Holdings Limited		15,100	26,441,317.06	9.91
PetroChina Company Limited		178,000	4,315,137.77	1.62
China Construction Bank Corporation		69,000	1,775,938.91	0.67
JD.com Inc.		5,600	3,542,990.42	1.33

กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Machine Learning China All Share

งบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน

ณ วันที่ 30 พฤศจิกายน 2567

การแสดงรายละเอียดเงินลงทุนใช้การจัดกลุ่มตามประเภทของเงินลงทุนและตามประเภทสกุลเงิน

วันครบกำหนด	อัตรา	เงินทุน/	มูลค่ายุติธรรม (บาท)	ร้อยละของ มูลค่าเงินลงทุน
	ดอกเบี้ย (%)	จำนวนหน่วย		
China Taiping Insurance Holdings Company Limited		43,200	2,334,023.25	0.88
Baidu, Inc.		4,800	1,716,938.93	0.64
Trip.com Group Limited		500	1,118,623.73	0.42
Alibaba Group Holding Limited		31,100	11,445,885.55	4.29
Pop Mart International Group Limited		2,200	869,688.70	0.33
KE Holdings Inc.		3,500	2,259,247.90	0.85
PDD Holdings Inc.		600	1,983,960.38	0.74
Qifu Technology, Inc.		900	1,174,534.96	0.44
รวมตราสารทุนในต่างประเทศ			255,109,373.50	95.64
หน่วยลงทุนในต่างประเทศ				
Huatai-PineBridge CSI 300 ETF		230,500	4,362,058.04	1.64
ChinaAMC ETF Series - ChinaAMC CSI 300 Index ETF		37,600	7,188,464.18	2.70
รวมหน่วยลงทุนในต่างประเทศ			11,550,522.22	4.34
รวมเงินลงทุน			266,708,261.48	100.00

กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Machine Learning China All Share

งบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน

ณ วันที่ 30 พฤศจิกายน 2566

การแสดงรายละเอียดเงินลงทุนใช้การจัดกลุ่มตามประเภทของเงินลงทุนและตามประเภทสกุลเงิน

	วันครบกำหนด	อัตรา ดอกเบี้ย (%)	เงินต้น/ จำนวนหน่วย	มูลค่ายุติธรรม (บาท)	ร้อยละของ มูลค่าเงินลงทุน
เงินฝากธนาคาร					
ธนาคารกสิกรไทย จำกัด (มหาชน)					
สกุลเงินดอลลาร์ฮ่องกง	เมื่อทวงถาม	-	113,203.08	510,568.53	0.21
สกุลเงินหยวนจีน	เมื่อทวงถาม	0.25	712,326.03	3,512,622.12	1.45
สกุลเงินดอลลาร์สหรัฐอเมริกา	เมื่อทวงถาม	0.04	2,591.81	91,283.55	0.04
รวมเงินฝากธนาคาร				4,114,474.20	1.70
ตราสารทุนในต่างประเทศ					
Weichai Power Company Limited			8,700	639,231.46	0.26
Dong-E-E-Jiao Company Limited			12,500	3,106,656.00	1.28
XCMG Construction Machinery Company Limited			52,900	1,442,558.45	0.59
Luzhou Laojiao Company Limited			600	613,934.40	0.25
CECEP Solar Energy Company Limited			24,000	659,202.82	0.27
Gree Electric Appliances, Inc. of Zhuhai			6,100	991,146.54	0.41
BOE Technology Group Company Limited			456,800	8,717,454.26	3.59
Wuliangye Yibin Company Limited			1,700	1,250,330.42	0.52
Focus Media Information Technology Company Limited			68,200	2,199,453.27	0.91
Zhejiang Sanhua Intelligent Controls Company Limited			4,500	641,746.37	0.26
Sinoma Science & Technology Company Limited			29,300	2,427,333.89	1.00
S.F. Holding Company Limited			8,700	1,813,014.85	0.75
Suzhou Dongshan Precision Manufacturing Company Limited			23,100	2,122,156.71	0.87
Luxshare Precision Industry Company Limited			11,800	1,852,129.13	0.76
Hangzhou Robam Appliances Company Limited			5,600	641,489.95	0.26
Kingnet Network Company Limited			12,300	708,435.92	0.29
Wuhu Sanqi Interactive Entertainment Network Technology Group Company Limited			7,700	841,040.82	0.35
Lomon Billions Group Company Limited			33,400	2,842,757.90	1.17
Zhejiang Satellite Petrochemical Company Limited			15,300	1,204,139.87	0.50
Avary Holding (Shenzhen) Company Limited			17,100	1,817,171.86	0.74
Kuaishou Technology			6,500	1,691,550.51	0.70
Sinopharm Group Company Limited			6,800	594,372.20	0.24
China Resources Mixc Lifestyle Services Limited			10,600	1,412,729.95	0.58

กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Machine Learning China All Share

งบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน

ณ วันที่ 30 พฤศจิกายน 2566

การแสดงรายละเอียดเงินลงทุนใช้การจัดกลุ่มตามประเภทของเงินลงทุนและตามประเภทสกุลเงิน

วันครบกำหนด	อัตรา	เงินทุน/	มูลค่ายุติธรรม (บาท)	ร้อยละของ มูลค่าเงินลงทุน
	ดอกเบี้ย (%)	จำนวนหน่วย		
		5,000	4,735,710.00	1.95
		509,000	6,634,549.30	2.73
		7,800	545,283.18	0.22
		90,000	2,946,964.68	1.21
		8,000	1,861,810.56	0.77
		46,000	653,527.98	0.27
		36,400	2,564,355.39	1.06
		219,000	1,856,939.54	0.77
		1,600	1,052,139.46	0.43
		52,000	2,127,190.73	0.88
		2,700	1,114,244.91	0.46
		88,000	1,532,024.74	0.63
		125,000	3,585,609.00	1.48
		6,000	964,731.78	0.40
		3,400	707,360.92	0.29
		8,700	2,831,924.05	1.17
		28,700	2,152,601.94	0.89
		4,300	915,383.59	0.38
		1,800	624,082.81	0.26
		1,900	1,564,669.76	0.64
		2,300	557,674.34	0.23
		44,000	2,198,812.70	0.91
		17,600	2,909,259.41	1.20
		6,000	2,451,744.72	1.01
		10,500	767,185.02	0.32
		3,000	530,794.37	0.22
		22,800	614,999.54	0.25
		22,900	1,541,419.15	0.64
		31,200	4,429,440.54	1.83
		56,000	2,833,270.27	1.17
		13,900	1,089,159.08	0.45

กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Machine Learning China All Share

งบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน

ณ วันที่ 30 พฤศจิกายน 2566

การแสดงรายละเอียดเงินลงทุนใช้การจัดกลุ่มตามประเภทของเงินลงทุนและตามประเภทสกุลเงิน

	อัตรา ดอกเบี้ย (%)	เงินต้น/ จำนวนหน่วย	มูลค่ายุติธรรม (บาท)	ร้อยละของ มูลค่าเงินลงทุน
China Jushi Company Limited		24,300	1,326,497.73	0.55
Wanhua Chemical Group Company Limited		3,100	1,232,873.97	0.51
Hengli Petrochemical Company Limited		21,900	1,515,145.72	0.62
Shandong Hualu-Hengsheng Chemical Company Limited		19,800	2,914,487.14	1.20
Kweichow Moutai Company Limited		800	7,067,395.84	2.91
Xiamen Faratronic Company Limited		1,400	648,945.92	0.27
HUAYU Automotive Systems Company Limited		19,800	1,698,897.02	0.70
Hongfa Technology Company Limited		12,100	1,736,324.83	0.72
Sinoma International Engineering Company Limited		18,500	854,798.86	0.35
Sailun Group Company Limited		21,400	1,125,980.35	0.46
Foxconn Industrial Internet Company Limited		9,800	729,718.98	0.30
Tongkun Group Company Limited		8,400	562,926.07	0.23
Agricultural Bank of China Limited		207,300	3,741,390.20	1.54
Ping An Insurance (Group) Company of China, Limited		21,500	4,325,648.64	1.78
New China Life Insurance Company Limited		18,400	2,835,440.00	1.17
Aluminum Corporation of China Limited		21,400	584,623.35	0.24
China Pacific Insurance (Group) Company Limited		7,800	926,582.34	0.38
Shanghai Pharmaceuticals Holding Company Limited		18,500	1,638,440.51	0.68
Zijin Mining Group Company Limited		28,300	1,699,755.05	0.70
SKSHU Paint Company Limited		2,000	532,668.22	0.22
Haier Smart Home Company Limited		10,000	1,021,560.30	0.42
Shenzhen Transsion Holdings Company Limited		1,500	818,603.86	0.34
Tencent Holdings Limited		16,300	24,039,817.02	9.91
PetroChina Company Limited		264,000	6,108,254.06	2.52
China Medical System Holdings Limited		99,000	6,706,577.20	2.76
Huaneng Power International, Inc.		38,000	695,833.66	0.29
Nongfu Spring Company Limited		8,200	1,649,470.34	0.68
Baidu, Inc.		4,800	2,513,444.26	1.04
MINISO Group Holding Limited		3,000	709,679.97	0.29
New Oriental Education & Technology Group Inc.		13,300	3,782,095.86	1.56
Alibaba Group Holding Limited		34,400	11,287,226.52	4.65

กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Machine Learning China All Share

งประกอบรายละเอียดเงินลงทุน

ณ วันที่ 30 พฤศจิกายน 2566

การแสดงรายละเอียดเงินลงทุนใช้การจัดกลุ่มตามประเภทของเงินลงทุนและตามประเภทสกุลเงิน

	วันครบกำหนด	อัตรา ดอกเบี้ย (%)	เงินต้น/ จำนวนหน่วย	มูลค่ายุติธรรม (บาท)	ร้อยละของ มูลค่าเงินลงทุน
NetEase, Inc.			11,200	8,905,660.51	3.67
KE Holdings Inc.			7,000	3,927,382.20	1.62
PDD Holdings Inc.			1,900	9,866,389.92	4.07
TAL Education Group			2,000	882,613.20	0.36
Vipshop Holdings Limited			6,800	3,839,120.88	1.58
JOYY Inc.			500	676,400.10	0.28
รวมตราสารทุนในต่างประเทศ				226,253,571.61	93.24
หน่วยลงทุนในต่างประเทศ					
Huatai-PineBridge CSI 300 ETF			529,200	9,295,363.28	3.83
ChinaAMC ETF Series - ChinaAMC CSI 300 Index ETF			16,900	2,988,474.86	1.23
รวมหน่วยลงทุนในต่างประเทศ				12,283,838.14	5.06
รวมเงินลงทุน				242,651,883.95	100.00

กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Machine Learning China All Share

งบกำไรขาดทุนเบ็ดเสร็จ

สำหรับปีสิ้นสุดวันที่ 30 พฤศจิกายน 2567

(หน่วย : บาท)

หมายเหตุ	2567	2566	
รายได้			
รายได้เงินปันผล	8,259,092.69	5,469,061.65	
รายได้ดอกเบี้ย	35,017.90	39,374.33	
รวมรายได้	8,294,110.59	5,508,435.98	
ค่าใช้จ่าย			
ค่าธรรมเนียมการจัดการ	4	2,813,839.99	2,932,202.10
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์		107,617.25	111,424.04
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน	4	180,058.22	180,648.93
ค่าธรรมเนียมวิชาชีพ		45,000.00	45,000.00
ค่าใช้จ่ายอื่น		1,686,598.67	2,893,640.75
รวมค่าใช้จ่าย		4,833,114.13	6,162,915.82
รายได้(ขาดทุน)สุทธิ		3,460,996.46	(654,479.84)
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิจากเงินลงทุน			
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิที่เกิดขึ้นจากเงินลงทุน		5,681,986.43	(48,276,414.51)
รายการกำไรสุทธิที่ยังไม่เกิดขึ้นจากเงินลงทุน		25,736,010.78	2,301,832.81
รายการขาดทุนสุทธิที่เกิดขึ้นจากสัญญาอนุพันธ์		(98,970.12)	(1,303,936.36)
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิที่ยังไม่เกิดขึ้นจากสัญญาอนุพันธ์		(2,020,095.02)	221.25
รายการขาดทุนสุทธิจากอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ		(10,819,924.02)	(2,584,758.59)
รวมรายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิจากเงินลงทุนที่เกิดขึ้นและที่ยังไม่เกิดขึ้น		18,479,008.05	(49,863,055.40)
การเพิ่มขึ้น(ลดลง)ในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงานก่อนหักภาษีเงินได้		21,940,004.51	(50,517,535.24)
หัก : ภาษีเงินได้		5,252.58	5,906.03
การเพิ่มขึ้น(ลดลง)ในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงานหลังหักภาษีเงินได้		21,934,751.93	(50,523,441.27)

กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Machine Learning China All Share

งบแสดงการเปลี่ยนแปลงสินทรัพย์สุทธิ

สำหรับปีสิ้นสุดวันที่ 30 พฤศจิกายน 2567

(หน่วย : บาท)

	2567	2566
การเพิ่มขึ้น(ลดลง)สุทธิของสินทรัพย์สุทธิจาก		
การดำเนินงาน	21,934,751.93	(50,523,441.27)
การเพิ่มขึ้นของทุนที่ได้รับจากผู้ถือหน่วยลงทุนในระหว่างปี	95,263,770.94	23,882,674.81
การลดลงของทุนที่ได้รับจากผู้ถือหน่วยลงทุนในระหว่างปี	(90,201,838.84)	(23,256,953.08)
การเพิ่มขึ้น(ลดลง)ของสินทรัพย์สุทธิในระหว่างปี	26,996,684.03	(49,897,719.54)
สินทรัพย์สุทธิ ณ วันต้นปี	244,268,050.72	294,165,770.26
สินทรัพย์สุทธิ ณ วันปลายปี	271,264,734.75	244,268,050.72

(หน่วย : หน่วย)

การเปลี่ยนแปลงของจำนวนหน่วยลงทุน

(มูลค่าหน่วยละ 10 บาท)

หน่วยลงทุน ณ วันต้นปี	36,697,662.4832	36,785,334.1906
บวก : หน่วยลงทุนที่ขายในระหว่างปี	13,530,413.8656	3,127,850.1267
หัก : หน่วยลงทุนที่รับซื้อคืนในระหว่างปี	(12,736,610.0328)	(3,215,521.8341)
หน่วยลงทุน ณ วันปลายปี	37,491,466.3160	36,697,662.4832

กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Machine Learning China All Share

หมายเหตุประกอบงบการเงิน

สำหรับปีสิ้นสุดวันที่ 30 พฤศจิกายน 2567

1. ลักษณะของกองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Machine Learning China All Share

กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Machine Learning China All Share (“กองทุน”) ได้จดทะเบียนกับสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ (“ก.ล.ต.”) เมื่อวันที่ 24 ธันวาคม 2563 โดยมีเงินทุนจดทะเบียน 3,000 ล้านบาท (แบ่งเป็น 300 ล้านหน่วยลงทุน มูลค่าหน่วยละ 10 บาท) โดยมีบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด (“บริษัทจัดการ”) เป็นผู้จัดการกองทุน ธนาคารไทยพาณิชย์ จำกัด (มหาชน) เป็นนายทะเบียนหน่วยลงทุน และธนาคารกสิกรไทย จำกัด (มหาชน) เป็นผู้ดูแลผลประโยชน์ของกองทุน

กองทุนมีการแบ่งชนิดหน่วยลงทุนเป็น 8 ชนิด ได้แก่

- ชนิดสะสมมูลค่า เหมาะสำหรับผู้ลงทุนที่ต้องการผลตอบแทนผ่านการเพิ่มมูลค่าของหน่วยลงทุนเป็นหลัก
- ชนิดรับซื้อคืนอัตโนมัติ เหมาะสำหรับผู้ลงทุนที่ต้องการรับผลตอบแทนจากการขายคืนหน่วยลงทุนโดยอัตโนมัติ
- ชนิดจ่ายเงินปันผล เหมาะสำหรับผู้ลงทุนที่ต้องการรับผลตอบแทนจากเงินปันผล
- ชนิดผู้ลงทุนกลุ่ม/บุคคล เหมาะสำหรับผู้ลงทุนประเภทบุคคล กลุ่มบุคคล นิติบุคคล สถาบันที่บริษัทจัดการกำหนดที่ต้องการสะสมผลประโยชน์จากการลงทุน
- ชนิดช่องทางอิเล็กทรอนิกส์ เหมาะสำหรับผู้ลงทุนที่ทำรายการผ่านช่องทางอิเล็กทรอนิกส์
- ชนิดเพื่อการออม เหมาะสำหรับผู้ลงทุนที่ต้องการออมเงินระยะยาว และได้รับสิทธิประโยชน์ทางภาษี
- ชนิดเพื่อการออมผ่านช่องทางอิเล็กทรอนิกส์ เหมาะสำหรับผู้ลงทุนที่ต้องการออมเงินระยะยาว และได้รับสิทธิประโยชน์ทางภาษีที่ทำรายการผ่านช่องทางอิเล็กทรอนิกส์
- ชนิดควบประกัน เหมาะสำหรับผู้ลงทุนที่ต้องการได้รับความคุ้มครองจากบริษัทประกัน

ปัจจุบันบริษัทจัดการเปิดให้บริการหน่วยลงทุนชนิดสะสมมูลค่า ชนิดช่องทางอิเล็กทรอนิกส์ ชนิดเพื่อการออม และชนิดเพื่อการออมผ่านช่องทางอิเล็กทรอนิกส์

กองทุนเป็นกองทุนประเภทรับซื้อคืนหน่วยลงทุน ไม่กำหนดระยะเวลาสิ้นสุดของโครงการ โดยมีนโยบายการลงทุนในตราสารทุนที่ออกโดยบริษัทสัญชาติจีน ซึ่งจะส่งผลให้กองทุนมีมูลค่าการลงทุนสุทธิในตราสารทุนดังกล่าวโดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน และมีการลงทุนที่ส่งผลให้มีมูลค่าการลงทุนสุทธิที่เกี่ยวข้องกับความเสี่ยงต่างประเทศโดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน กองทุนมีเป้าหมายในการลงทุนให้ผลประกอบการสูงกว่าดัชนีชี้วัด (Active Management) โดยใช้การวิเคราะห์เชิงปริมาณ (Quantitative Analysis) ซึ่งมีการใช้เทคนิคทาง Machine Learning ซึ่งเป็นระบบที่พัฒนาขึ้นโดยบริษัทจัดการ มาประกอบการคัดเลือกหลักทรัพย์ที่จะลงทุน โดยหลักทรัพย์ที่กองทุนนำมาพิจารณาจะเป็นหลักทรัพย์ที่จดทะเบียนซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ฮ่องกง (H-Share) ตลาดหลักทรัพย์เซี่ยงไฮ้ และเงิน (A-Share) และหลักทรัพย์ที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ต่าง ๆ ทั่วโลกที่ดำเนินธุรกิจเกี่ยวข้องกับประเทศจีน

ทั้งนี้ กองทุนอาจลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) เพื่อเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน (Efficient portfolio management) และ/หรือการบริหารความเสี่ยง รวมทั้งกองทุนอาจลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) เพื่อป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน (Hedging) ตามความเหมาะสมสำหรับสภาวะการณ์ในแต่ละขณะ โดยขึ้นอยู่กับดุลพินิจของผู้จัดการกองทุน

กองทุนมีนโยบายจ่ายเงินปันผลตามหลักเกณฑ์และวิธีการที่กำหนดในหนังสือชี้ชวน

2. เกณฑ์การจัดทำงบการเงิน

กองทุนจัดทำงบการเงินเป็นภาษาไทยและมีหน่วยเงินตราเป็นเงินบาท โดยจัดทำขึ้นตามแนวปฏิบัติทางบัญชีว่าด้วยการบัญชีสำหรับกิจการที่ดำเนินธุรกิจเฉพาะด้านการลงทุนตามที่สมาคมบริษัทจัดการลงทุนกำหนดโดยได้รับความเห็นชอบจาก ก.ล.ต. (“แนวปฏิบัติทางบัญชี”) ส่วนเรื่องที่ว่าแนวปฏิบัติทางบัญชีฉบับนี้ไม่ได้กำหนดไว้ กองทุนปฏิบัติตามมาตรฐานการรายงานทางการเงินที่ออกโดยสภาวิชาชีพบัญชีที่มีผลบังคับใช้ในรอบระยะเวลาบัญชีนั้น

งบการเงินฉบับภาษาอังกฤษจัดทำขึ้นจากงบการเงินตามกฎหมายที่เป็นภาษาไทย ในกรณีที่มีความหมายขัดแย้งกันหรือมีความแตกต่างในการตีความระหว่างสองภาษา ให้ใช้งบการเงินตามกฎหมายฉบับภาษาไทยเป็นหลัก

3. สรุปนโยบายการบัญชีที่สำคัญ

3.1 เครื่องมือทางการเงิน

สินทรัพย์ทางการเงินและหนี้สินทางการเงิน

การรับรู้รายการและการวัดมูลค่าเมื่อเริ่มแรก

กองทุนรับรู้รายการเมื่อเริ่มแรกของสินทรัพย์และหนี้สินทางการเงินจะรับรู้ในวันที่มีการตกลงกัน (Trade date) คือวันที่กองทุนมีข้อผูกมัดที่จะซื้อหรือขายเงินลงทุน

กองทุนจะรับรู้รายการเมื่อเริ่มแรกของสินทรัพย์และหนี้สินทางการเงินด้วยมูลค่ายุติธรรม โดยต้นทุนในการทำรายการซึ่งเกี่ยวข้องโดยตรงกับการได้มาของสินทรัพย์และหนี้สินทางการเงินที่แสดงด้วยมูลค่ายุติธรรมจะรับรู้เป็นค่าใช้จ่ายทันทีเมื่อเกิดขึ้น

การจัดประเภทรายการและการวัดมูลค่าในภายหลัง

สินทรัพย์ทางการเงินทั้งหมดจะจัดประเภทเป็นสินทรัพย์ทางการเงินที่วัดมูลค่าภายหลังด้วยมูลค่ายุติธรรม

หนี้สินทางการเงินทั้งหมดจะจัดประเภทเป็นหนี้สินทางการเงินที่วัดมูลค่าภายหลังด้วยราคาทุนตัดจำหน่าย ยกเว้นหนี้สินอนุพันธ์จะต้องวัดมูลค่าภายหลังด้วยมูลค่ายุติธรรม

กำไรหรือขาดทุนจากการเปลี่ยนแปลงในมูลค่ายุติธรรมในภายหลังของสินทรัพย์ทางการเงินหรือหนี้สินทางการเงินที่วัดมูลค่าภายหลังด้วยมูลค่ายุติธรรมจะรับรู้ในงบกำไรขาดทุนเบ็ดเสร็จ

การตัดรายการ

กองทุนตัดรายการสินทรัพย์ทางการเงิน เฉพาะเมื่อสิทธิตามสัญญาที่จะได้รับกระแสเงินสดจากสินทรัพย์ทางการเงินหมดอายุ หรือเมื่อโอนสินทรัพย์ทางการเงินและโอนความเสี่ยงและผลตอบแทนของความเป็นเจ้าของเกือบทั้งหมดของสินทรัพย์ให้กิจการอื่น

ณ วันที่ตัดรายการสินทรัพย์ทางการเงิน กองทุนต้องรับรู้ผลต่างระหว่างมูลค่าตามบัญชีของสินทรัพย์และผลรวมของสิ่งตอบแทนที่คาดว่าจะได้รับและค้างรับในงบกำไรขาดทุนเบ็ดเสร็จ

กองทุนตัดรายการหนี้สินทางการเงิน เมื่อภาระผูกพันที่ระบุไว้ในสัญญาได้มีการปฏิบัติตามแล้ว ได้มีการยกเลิก หรือสิ้นสุด

ณ วันที่ตัดรายการหนี้สินทางการเงิน กองทุนต้องรับรู้ผลแตกต่างระหว่างมูลค่าตามบัญชีของหนี้สินทางการเงินที่ตัดรายการและสิ่งตอบแทนที่จ่ายและค้างจ่ายรับรู้ในงบกำไรขาดทุนเบ็ดเสร็จ

3.2 ตราสารอนุพันธ์ทางการเงิน

กองทุนวัดมูลค่าสัญญาตราสารอนุพันธ์ทางการเงินด้วยราคายุติธรรม

กองทุนจะรับรู้กำไรหรือขาดทุนจากการเปลี่ยนแปลงมูลค่ายุติธรรมของสัญญาดังกล่าวในงบกำไรขาดทุนเบ็ดเสร็จ

3.3 การแบ่งปันส่วนทุน

กองทุนรวมบันทึกยอดกำไรสะสม ณ วันที่ประกาศจ่ายปันผลเป็นเงินสด

3.4 การรับรู้รายได้และค่าใช้จ่าย

รายได้เงินปันผล รับรู้เป็นรายได้นับแต่วันที่ประกาศจ่ายและมีสิทธิที่จะได้รับ

รายได้ดอกเบี้ย รับรู้เป็นรายได้ตามเกณฑ์คงค้างโดยคำนึงถึงอัตราผลตอบแทนที่แท้จริง

ค่าใช้จ่ายรับรู้ตามเกณฑ์คงค้าง

3.5 ภาษีเงินได้

กองทุนมีหน้าที่เสียภาษีเงินได้นิติบุคคลเฉพาะเงินได้พึงประเมินตามมาตรา 40(4)(ก) แห่งประมวลรัษฎากรในอัตรา ร้อยละ 15 ของรายได้ก่อนหักรายจ่ายใด ๆ

3.6 การแปลงค่าเงินตราต่างประเทศ

รายการบัญชีที่เป็นเงินตราต่างประเทศแปลงค่าเป็นสกุลเงินบาทโดยใช้อัตราแลกเปลี่ยน ณ วันที่เกิดรายการ

สินทรัพย์และหนี้สินที่เป็นตัวเงินและเป็นเงินตราต่างประเทศ แปลงค่าเป็นสกุลเงินที่ใช้ในการดำเนินงาน โดยใช้อัตราแลกเปลี่ยน ณ วันที่รายงาน

ผลต่างของอัตราแลกเปลี่ยนที่เกิดขึ้นจากการแปลงค่าให้รับรู้เป็นกำไรหรือขาดทุน ซึ่งได้แสดงไว้ในกำไรหรือขาดทุน สุทธิจากอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ

3.7 รายการธุรกิจกับบุคคลหรือกิจการที่เกี่ยวข้องกัน

บุคคลหรือกิจการที่เกี่ยวข้องกันกับกองทุน หมายถึง บุคคลหรือกิจการที่ลงทุนในหุ้นได้เสียของกองทุน ตั้งแต่ ร้อยละ 10 ของส่วนได้เสียทั้งหมดที่มีสิทธิออกเสียงไม่ว่าโดยทางตรงหรือทางอ้อม หรือฝ่ายบริหาร ซึ่งประกอบด้วยบุคคล ที่รับผิดชอบในการจัดการกองทุน หรือมีหน้าที่กำหนดนโยบายหรือตัดสินใจเพื่อให้กองทุนบรรลุวัตถุประสงค์ที่วางไว้

นอกจากนี้ บุคคลหรือกิจการที่เกี่ยวข้องกันยังหมายรวมถึงบุคคลหรือกิจการที่มีอำนาจควบคุมกองทุน หรืออยู่ภายใต้ อำนาจการควบคุมของกองทุน หรือมีอิทธิพลอย่างเป็นสาระสำคัญของกองทุน หรืออยู่ภายใต้อิทธิพลอย่างเป็น สาระสำคัญของกองทุน

3.8 บัญชีปรับสมดุล

ส่วนหนึ่งของราคาขายหรือราคาปรับซื้อคืนของหน่วยลงทุนซึ่งเท่ากับจำนวนต่อหน่วยของกำไรสะสมที่ยังไม่ได้ แบ่งสรร ณ วันที่เกิดรายการถูกบันทึกใน “บัญชีปรับสมดุล”

3.9 การใช้ดุลยพินิจและประมาณการทางบัญชี

ในการจัดทำงบการเงินให้เป็นไปตามแนวปฏิบัติทางบัญชี ฝ่ายบริหารต้องใช้ดุลยพินิจและประมาณการทางบัญชี ซึ่งมีผลกระทบต่อจำนวนเงินที่เกี่ยวข้องกับสินทรัพย์ หนี้สิน รายได้ ค่าใช้จ่าย และการเปิดเผยข้อมูลเกี่ยวกับ สินทรัพย์และหนี้สินที่อาจเกิดขึ้น ซึ่งผลที่เกิดขึ้นจริงอาจแตกต่างไปจากจำนวนที่ประมาณไว้

4. รายการธุรกิจกับกิจการที่เกี่ยวข้องกัน

กองทุนมีรายการธุรกิจที่สำคัญกับกิจการที่เกี่ยวข้องกัน ซึ่งประกอบด้วยบริษัทจัดการ บริษัทที่มีผู้ถือหุ้นหรือผู้ถือหุ้นราย และ/หรือกรรมการเดียวกันกับบริษัทจัดการ และกองทุนอื่นที่บริหาร โดยบริษัทจัดการเดียวกัน รายการที่สำคัญดังกล่าว สำหรับปีสิ้นสุดวันที่ 30 พฤศจิกายน 2567 และ 2566 มีดังต่อไปนี้

(หน่วย : บาท)

	<u>2567</u>	<u>2566</u>	<u>นโยบายการกำหนดราคา</u>
บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด			
ค่าธรรมเนียมการจัดการ	2,813,839.99	2,932,202.10	ตามเกณฑ์ที่ระบุในหนังสือชี้ชวน
ธนาคารไทยพาณิชย์ จำกัด (มหาชน)			
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน	180,058.22	180,648.93	ตามเกณฑ์ที่ระบุในหนังสือชี้ชวน
ซื้อเงินตราต่างประเทศ	27,285,236.02	33,537,809.63	ตามที่ระบุในสัญญา
ขายเงินตราต่างประเทศ	35,959,850.05	15,946,783.79	ตามที่ระบุในสัญญา
สัญญาซื้อเงินตราต่างประเทศล่วงหน้า	99,164,764.36	-	ตามที่ระบุในสัญญา
สัญญาขายเงินตราต่างประเทศล่วงหน้า	30,801,924.00	1,646,376.00	ตามที่ระบุในสัญญา

ณ วันที่ 30 พฤศจิกายน 2567 และ 2566 กองทุนมียอดคงเหลือที่มีสาระสำคัญกับกิจการที่เกี่ยวข้องกันดังนี้

(หน่วย : บาท)

	<u>2567</u>	<u>2566</u>
บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด		
ค่าธรรมเนียมการจัดการค้างจ่าย	246,006.09	215,525.84
เจ้าหนี้อื่น	31.74	111.21
ธนาคารไทยพาณิชย์ จำกัด (มหาชน)		
เงินฝากธนาคาร	3,000.00	56,000.00
สินทรัพย์อนุพันธ์	104,913.95	-
หนี้สินอนุพันธ์	1,265,395.79	-
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียนค้างจ่าย	15,186.83	14,010.03

5. ข้อมูลเกี่ยวกับการซื้อขายเงินลงทุน

กองทุนได้ซื้อขายเงินลงทุนสำหรับปีสิ้นสุดวันที่ 30 พฤศจิกายน 2567 และ 2566 สรุปได้ดังนี้

(หน่วย : บาท)

	<u>2567</u>	<u>2566</u>
ซื้อเงินลงทุน	717,268,919.06	1,113,708,772.92
ขายเงินลงทุน	714,178,652.92	1,109,180,462.85

6. อนุพันธ์ทางการเงินตามมูลค่ายุติธรรม

สัญญาอนุพันธ์ทางการเงินประกอบด้วยสัญญาซื้อขายเงินตราต่างประเทศล่วงหน้า

ณ วันที่ 30 พฤศจิกายน 2567 กองทุนมีจำนวนเงินตามสัญญาและมูลค่ายุติธรรมของตราสารอนุพันธ์ดังนี้

(หน่วย : บาท)

	จำนวนเงิน <u>ตามสัญญา</u>	มูลค่ายุติธรรม	
		<u>สินทรัพย์</u>	<u>หนี้สิน</u>
สัญญาซื้อขายเงินตราต่างประเทศล่วงหน้า	674,807,283.43	<u>4,072,907.65</u>	<u>6,092,781.42</u>

ณ วันที่ 30 พฤศจิกายน 2566 กองทุนมีจำนวนเงินตามสัญญาและมูลค่ายุติธรรมของตราสารอนุพันธ์ดังนี้

(หน่วย : บาท)

	จำนวนเงิน <u>ตามสัญญา</u>	มูลค่ายุติธรรม	
		<u>สินทรัพย์</u>	<u>หนี้สิน</u>
สัญญาซื้อขายเงินตราต่างประเทศล่วงหน้า	5,419,818.00	<u>18,527.67</u>	<u>18,306.42</u>

7. หน่วยลงทุนที่ออกจำหน่าย

รายการเคลื่อนไหวของหน่วยลงทุนและหน่วยลงทุนคงเหลือ แยกตามประเภทผู้ถือหน่วยลงทุน ดังนี้
สำหรับปีสิ้นสุดวันที่ 30 พฤศจิกายน 2567

	(หน่วย : หน่วย)			
		ชนิดช่องทาง		ชนิดเพื่อการออม
	<u>ชนิดสะสมมูลค่า</u>	<u>อิเล็กทรอนิกส์</u>	<u>ชนิดเพื่อการออม</u>	<u>อิเล็กทรอนิกส์</u>
หน่วยลงทุน ณ วันต้นปี	36,657,541.7211	4,621.3039	35,296.9071	202.5511
หน่วยลงทุนที่ขายในระหว่างปี	11,043,783.9142	465,018.0690	1,755,061.9077	266,549.9747
หน่วยลงทุนที่รับซื้อคืนในระหว่างปี	(11,703,085.3512)	(209,670.6910)	(757,969.9153)	(65,884.0753)
หน่วยลงทุน ณ วันปลายปี	<u>35,998,240.2841</u>	<u>259,968.6819</u>	<u>1,032,388.8995</u>	<u>200,868.4505</u>
สินทรัพย์สุทธิ (บาท)	260,463,050.89	1,859,480.65	7,470,940.69	1,471,262.52
มูลค่าสินทรัพย์สุทธิต่อหน่วย (บาท)	7.2354	7.1527	7.2365	7.3245

สำหรับปีสิ้นสุดวันที่ 30 พฤศจิกายน 2566

	(หน่วย : หน่วย)			
		ชนิดช่องทาง		ชนิดเพื่อการออม
	<u>ชนิดสะสมมูลค่า</u>	<u>อิเล็กทรอนิกส์</u>	<u>ชนิดเพื่อการออม</u>	<u>อิเล็กทรอนิกส์</u>
หน่วยลงทุน ณ วันต้นปี	36,785,334.1906	-	-	-
หน่วยลงทุนที่ขายในระหว่างปี	3,087,729.3646	4,621.3039	35,296.9071	202.5511
หน่วยลงทุนที่รับซื้อคืนในระหว่างปี	(3,215,521.8341)	-	-	-
หน่วยลงทุน ณ วันปลายปี	<u>36,657,541.7211</u>	<u>4,621.3039</u>	<u>35,296.9071</u>	<u>202.5511</u>
สินทรัพย์สุทธิ (บาท)	244,000,955.19	30,793.67	234,951.83	1,350.03
มูลค่าสินทรัพย์สุทธิต่อหน่วย (บาท)	6.6562	6.6634	6.6564	6.6651

การเพิ่มขึ้น(ลดลง)ในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงานแยกตามประเภทผู้ถือหน่วยลงทุน สำหรับปีสิ้นสุดวันที่ 30 พฤศจิกายน 2567 และ 2566 มีดังนี้

	(หน่วย : บาท)	
	<u>2567</u>	<u>2566</u>
ชนิดสะสมมูลค่า	21,268,303.20	(50,521,777.80)
ชนิดช่องทางอิเล็กทรอนิกส์	63,485.90	(112.33)
ชนิดเพื่อการออม	549,525.71	(1,548.17)
ชนิดเพื่อการออมผ่านช่องทางอิเล็กทรอนิกส์	53,437.12	(2.97)
รวม	<u>21,934,751.93</u>	<u>(50,523,441.27)</u>

8. การเปิดเผยข้อมูลสำหรับเครื่องมือทางการเงิน

8.1 การประมาณมูลค่ายุติธรรม

มูลค่ายุติธรรมเป็นราคาที่จะได้รับจากการขายสินทรัพย์ หรือจะจ่ายเพื่อโอนหนี้สินในรายการที่เกิดขึ้นในสภาพปกติระหว่างผู้ร่วมตลาด ณ วันที่วัดมูลค่า ยกเว้นในกรณีที่ไม่มิตลาดที่มีสภาพคล่องสำหรับสินทรัพย์หรือหนี้สินที่มีลักษณะเดียวกันหรือไม่สามารถหารราคาเสนอซื้อขายในตลาดที่มีสภาพคล่องได้ กองทุนจะประมาณมูลค่ายุติธรรมและพยายามใช้ข้อมูลที่สามารถสังเกตได้ที่เกี่ยวข้องกับสินทรัพย์หรือหนี้สินที่จะวัดมูลค่ายุติธรรมนั้นให้มากที่สุด

กองทุนวัดมูลค่ายุติธรรมโดยแบ่งตามลำดับชั้นของข้อมูลที่สามารถสังเกตได้ และตามระดับความสำคัญของข้อมูลที่ใช้วัดมูลค่ายุติธรรม ซึ่งมีดังต่อไปนี้

- ระดับที่ 1 เป็นราคาเสนอซื้อขาย (ไม่ต้องปรับปรุง) ในตลาดที่มีสภาพคล่องสำหรับสินทรัพย์ หรือหนี้สินอย่างเดียวกันและกิจการสามารถเข้าถึงตลาดนั้น ณ วันที่วัดมูลค่า
- ระดับที่ 2 เป็นข้อมูลอื่นที่สังเกตได้ไม่ว่าโดยทางตรงหรือโดยทางอ้อมสำหรับสินทรัพย์นั้นหรือหนี้สินนั้น นอกเหนือจากราคาเสนอซื้อขายซึ่งรวมอยู่ในข้อมูลระดับ 1
- ระดับที่ 3 เป็นข้อมูลที่ไม่สามารถสังเกตได้สำหรับสินทรัพย์นั้นหรือหนี้สินนั้น

ณ วันที่ 30 พฤศจิกายน 2567 กองทุนมีสินทรัพย์และหนี้สินที่วัดมูลค่าด้วยมูลค่ายุติธรรมแสดงตามลำดับชั้นของมูลค่ายุติธรรม ดังนี้

(หน่วย : บาท)

	ระดับ 1	ระดับ 2	ระดับ 3	รวม
<u>สินทรัพย์</u>				
ตราสารทุน	255,109,373.50	-	-	255,109,373.50
หน่วยลงทุน	11,550,522.22	-	-	11,550,522.22
เงินฝากธนาคาร	-	48,365.76	-	48,365.76
สัญญาซื้อขายเงินตราต่างประเทศล่วงหน้า	-	4,072,907.65	-	4,072,907.65
<u>หนี้สิน</u>				
สัญญาซื้อขายเงินตราต่างประเทศล่วงหน้า	-	6,092,781.42	-	6,092,781.42

ณ วันที่ 30 พฤศจิกายน 2566 กองทุนมีสินทรัพย์และหนี้สินที่วัดมูลค่าด้วยมูลค่ายุติธรรมแสดงตามลำดับชั้นของมูลค่ายุติธรรม ดังนี้

(หน่วย : บาท)

	ระดับ 1	ระดับ 2	ระดับ 3	รวม
<u>สินทรัพย์</u>				
ตราสารทุน	226,253,571.61	-	-	226,253,571.61
หน่วยลงทุน	12,283,838.14	-	-	12,283,838.14
เงินฝากธนาคาร	-	4,114,474.20	-	4,114,474.20
สัญญาซื้อขายเงินตราต่างประเทศล่วงหน้า	-	18,527.67	-	18,527.67
<u>หนี้สิน</u>				
สัญญาซื้อขายเงินตราต่างประเทศล่วงหน้า	-	18,306.42	-	18,306.42

กองทุนมีการประมาณการมูลค่ายุติธรรมของเครื่องมือทางการเงินตามหลักเกณฑ์ดังนี้

- มูลค่ายุติธรรมของตราสารทุนที่มีตลาดซื้อขายคล่องรองรับคำนวณโดยใช้ราคาซื้อขายครั้งล่าสุด ณ สิ้นวันทำการสุดท้าย
- มูลค่ายุติธรรมของหน่วยลงทุนที่มีตลาดซื้อขายคล่องรองรับคำนวณโดยใช้ราคาซื้อขายครั้งล่าสุด ณ สิ้นวันทำการสุดท้าย
- มูลค่ายุติธรรมของเงินฝากธนาคาร คำนวณโดยใช้วิธีราคาทุนตัดจำหน่าย ซึ่งใกล้เคียงกับมูลค่ายุติธรรม
- มูลค่ายุติธรรมของสัญญาซื้อขายเงินตราต่างประเทศล่วงหน้าแสดงด้วยมูลค่ายุติธรรมคำนวณโดยใช้มูลค่าที่ประกาศโดยสถาบันการเงิน

ในระหว่างปีปัจจุบัน ไม่มีการโอนรายการระหว่างลำดับชั้นของมูลค่ายุติธรรม

8.2 ความเสี่ยงด้านเครดิต

ความเสี่ยงด้านเครดิต คือ ความเสี่ยงที่อาจเกิดจากการที่คู่สัญญาไม่สามารถปฏิบัติตามภาระผูกพันที่ระบุไว้ในเครื่องมือทางการเงินได้ กองทุนมีความเสี่ยงด้านการให้เครดิตที่เกี่ยวข้องกับสินทรัพย์ทางการเงิน อย่างไรก็ตาม สินทรัพย์ทางการเงินดังกล่าวจะครบกำหนดในระยะเวลาอันสั้น กองทุนจึงไม่คาดว่าจะได้รับความเสียหายจากการเก็บหนี้

8.3 ความเสี่ยงด้านอัตราดอกเบี้ย

ความเสี่ยงจากอัตราดอกเบี้ย คือ ความเสี่ยงที่เกิดจากการเปลี่ยนแปลงของอัตราดอกเบี้ยในตลาด ซึ่งอาจจะส่งผลกระทบต่อมูลค่าของสินทรัพย์ทางการเงินและหนี้สินทางการเงิน อย่างไรก็ตาม เนื่องจากสินทรัพย์และหนี้สินทางการเงินส่วนใหญ่อยู่ในประเภทระยะสั้นและมีอัตราดอกเบี้ยที่ปรับขึ้นลงตามอัตราตลาด หรือมีอัตราดอกเบี้ยคงที่ซึ่งใกล้เคียงกับอัตราดอกเบี้ยในปัจจุบัน

ณ วันที่ 30 พฤศจิกายน 2567 สินทรัพย์และหนี้สินทางการเงินที่สามารถจัดตามประเภทอัตราดอกเบี้ย ได้ดังนี้

	(หน่วย : บาท)		
	อัตราดอกเบี้ย		รวม
	ปรับขึ้นลง ตามราคาตลาด	ไม่มี อัตราดอกเบี้ย	
<u>สินทรัพย์ทางการเงิน</u>			
เงินลงทุนแสดงด้วยมูลค่ายุติธรรม	6,864.75	266,701,396.73	266,708,261.48
เงินฝากธนาคาร	6,879,257.50	3,000.00	6,882,257.50
ลูกหนี้จากดอกเบี้ยและเงินปันผล	-	358,678.61	358,678.61
สินทรัพย์อนุพันธ์	-	4,072,907.65	4,072,907.65
<u>หนี้สินทางการเงิน</u>			
เจ้าหนี้จากการรับซื้อคืนหน่วยลงทุน	-	337,809.85	337,809.85
หนี้สินอนุพันธ์	-	6,092,781.42	6,092,781.42
ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย	-	315,653.57	315,653.57

ณ วันที่ 30 พฤศจิกายน 2566 สินทรัพย์และหนี้สินทางการเงินที่สามารถจัดตามประเภทอัตราดอกเบี้ย ได้ดังนี้

(หน่วย : บาท)

	อัตราดอกเบี้ย		รวม
	ปรับขึ้นลง	ไม่มี	
	ตามราคาตลาด	อัตราดอกเบี้ย	
<u>สินทรัพย์ทางการเงิน</u>			
เงินลงทุนแสดงด้วยมูลค่ายุติธรรม	3,603,905.67	239,047,978.28	242,651,883.95
เงินฝากธนาคาร	1,945,095.06	56,000.00	2,001,095.06
ลูกหนี้จากดอกเบี้ยและเงินปันผล	-	55,291.45	55,291.45
สินทรัพย์อนุพันธ์	-	18,527.67	18,527.67
<u>หนี้สินทางการเงิน</u>			
เจ้าหนี้จากการรับซื้อคืนหน่วยลงทุน	-	147,800.42	147,800.42
หนี้สินอนุพันธ์	-	18,306.42	18,306.42
ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย	-	282,726.28	282,726.28

8.4 ความเสี่ยงด้านอัตราแลกเปลี่ยน

ความเสี่ยงด้านอัตราแลกเปลี่ยน คือ ความเสี่ยงจากการเปลี่ยนแปลงของอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ ซึ่งอาจจะทำให้เกิดการเปลี่ยนแปลงต่อมูลค่าตราสารทางการเงิน ความผันผวนต่อรายได้หรือมูลค่าของสินทรัพย์หรือหนี้สินทางการเงิน

ณ วันที่ 30 พฤศจิกายน 2567 กองทุนมีบัญชีที่เป็นเงินตราต่างประเทศ ดังนี้

(หน่วย : หน่วย)

รายการ	ดอลลาร์ฮ่องกง	หยวนจีน	ดอลลาร์สหรัฐอเมริกา
เงินลงทุน (มูลค่ายุติธรรม)	27,804,653.69	29,377,944.96	158,316.34
ลูกหนี้จากดอกเบี้ย	-	754.70	3.69
ลูกหนี้จากเงินปันผล	78,021.97	-	-

ณ วันที่ 30 พฤศจิกายน 2566 กองทุนมีบัญชีที่เป็นเงินตราต่างประเทศ ดังนี้

(หน่วย : หน่วย)

รายการ	ดอลลาร์ฮ่องกง	หยวนจีน	ดอลลาร์สหรัฐอเมริกา
เงินลงทุน (มูลค่ายุติธรรม)	24,861,630.08	22,557,951.43	547,506.81
ลูกหนี้จากดอกเบี้ย	-	368.26	2.01
ลูกหนี้จากเงินปันผล	-	-	1,108.80

8.5 ความเสี่ยงที่เกิดจากการได้รับชำระเงินค่าขายคืนหน่วยลงทุนกองทุนรวมต่างประเทศล่าช้า

ความเสี่ยงที่เกิดจากการได้รับชำระเงินค่าขายคืนหน่วยลงทุนกองทุนรวมต่างประเทศล่าช้า คือ ความเสี่ยงที่เกิดจากวันหยุดทำการของประเทศที่กองทุนลงทุนหรือประเทศที่เกี่ยวข้องกับการลงทุนอาจหยุดไม่ตรงกับวันหยุดทำการของประเทศไทย ทำให้กองทุนอาจได้รับชำระเงินค่าขายคืนหน่วยลงทุนจากกองทุนรวมต่างประเทศที่กองทุนลงทุนล่าช้าและส่งผลกระทบต่อชำระเงินค่าขายคืนหน่วยลงทุนให้กับผู้ถือหน่วยลงทุนในประเทศ

กองทุนลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมต่างประเทศ อาจเกิดปัญหาอันเกิดจากวันหยุดทำการของประเทศที่กองทุนลงทุน คือ มีวันหยุดทำการไม่ตรงกับวันหยุดทำการของประเทศไทย กองทุนจึงอาจประสบปัญหาความล่าช้าในการชำระเงินค่าขายคืนหน่วยลงทุนให้กับผู้ถือหน่วยลงทุน โดยบริษัทจัดการจะชำระเงินค่าขายคืนหน่วยลงทุนดังกล่าวให้กับผู้ถือหน่วยลงทุนภายใน 5 วันทำการ นับแต่วันคำนวณมูลค่าทรัพย์สิน มูลค่าหน่วยลงทุน ราคาขายและราคารับซื้อคืนหน่วยลงทุนของวันทำการรับซื้อคืนหน่วยลงทุน

9. ภาวะผูกพัน

กองทุนมีภาวะผูกพันที่ต้องจ่ายค่าธรรมเนียมการจัดการ ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ และค่าธรรมเนียมนายทะเบียนตามเกณฑ์ที่ระบุในหนังสือชี้ชวน

10. การอนุมัติงบการเงิน

งบการเงินนี้ได้รับการอนุมัติให้ออกโดยผู้มีอำนาจของกองทุนเมื่อวันที่ 27 ธันวาคม 2567



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

SCBAM Call Center 0 2777 7777 หรือ WWW.SCBAM.COM