

# Mutual Funds Report

กองทุนเปิดไทยพาณิชย์  
Machine Learning Thai Equity  
(SCBMLT)

รายงานประจำปี  
ตั้งแต่วันที่ 1 ธันวาคม 2565 - 30 พฤศจิกายน 2566

## บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด

### สถานที่ตั้ง

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

### รายละเอียดเกี่ยวกับบริษัท

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด จัดตั้งขึ้นเมื่อวันที่ 18 มีนาคม พ.ศ. 2535 เป็นบริษัทในเครือธนาคารไทยพาณิชย์ ที่ได้รับใบอนุญาตจากกระทรวงการคลังให้ประกอบธุรกิจหลักทรัพย์ประเภทธุรกิจการจัดการกองทุนรวม กองทุนสำรองเลี้ยงชีพ และกองทุนส่วนบุคคล จากความพร้อม ความเชี่ยวชาญในการเสนอผลิตภัณฑ์ ประกอบกับผลงานการบริหารกองทุนที่มั่นคงและอยู่ในเกณฑ์ดีอย่างต่อเนื่อง โดยยึดมั่นในหลักจรรยาบรรณและคำนึงถึงประโยชน์สูงสุดต่อผู้ลงทุน

### รายนามผู้ถือหุ้น

### ร้อยละ

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

### รายนามคณะกรรมการ

1. นางกิตติยา	โตชนะเกษม	ประธานกรรมการ
2. นายชรรยง	ไทยเจริญ	กรรมการ
3. นางสาวลิณี	วังดาล	กรรมการ
4. นายชลิตติ	เนืองจ่านงค์	กรรมการ
5. นายณรงค์ศักดิ์	ปลอดมีชัย	กรรมการ
6. นายปฏิภาณ	เลิศประเสริฐศิริ	กรรมการ
7. นายวิฑูรย์	พรสกุลวานิช	กรรมการ

การลงทุนมีความเสี่ยง ผู้ลงทุนควรศึกษาข้อมูลก่อนการตัดสินใจลงทุน

ผู้ลงทุนสามารถตรวจสอบดูแนวทางในการใช้สิทธิออกเสียงและการดำเนินการใช้สิทธิออกเสียงได้ที่บริษัทจัดการ หรือ [http:// www.scbam.com](http://www.scbam.com) และสามารถตรวจสอบการทำธุรกรรมกับบุคคลที่เกี่ยวข้องกับกองทุนรวมได้ที่ บริษัทจัดการ โดยตรงหรือที่ Website ของบริษัทจัดการและสำนักงาน ก.ล.ต.

**กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Machine Learning Thai Equity (SCBMLT)**

**ชื่อโครงการ**

ชนิดหน่วยลงทุน	ชื่อโครงการ
ชนิดสะสมมูลค่า	กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Machine Learning Thai Equity (ชนิดสะสมมูลค่า)
ชนิดผู้ลงทุนกลุ่ม/บุคคล	กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Machine Learning Thai Equity (ชนิดผู้ลงทุนกลุ่ม/บุคคล)
ชนิดช่องทางอิเล็กทรอนิกส์	กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Machine Learning Thai Equity (ชนิดช่องทางอิเล็กทรอนิกส์)
ชนิดเพื่อการออม	กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Machine Learning Thai Equity (ชนิดเพื่อการออม)
ชนิดเพื่อการออมผ่านช่องทางอิเล็กทรอนิกส์	กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Machine Learning Thai Equity (ชนิดเพื่อการออมผ่านช่องทางอิเล็กทรอนิกส์)

**ประเภทโครงการ** : กองทุนรวมตราสารทุน/กองทุนรวมที่มีนโยบายเปิดให้มีการลงทุนในกองทุนรวมอื่นภายใต้ บลจ. เดียวกัน/กองทุนรวมเพื่อการออม (SSF)/กองทุนรวมที่ลงทุนแบบไม่มีความเสี่ยงต่างประเทศ  
 กลุ่มกองทุนรวม : Equity General

**วันเริ่มต้นโครงการ** : วันที่ 6 ธันวาคม 2560

**จำนวนเงินทุนของโครงการ** : 3,000 ล้านบาท จำนวนหน่วยลงทุน 300 ล้านหน่วย

**นโยบายการลงทุน** ลงทุนในตราสารทุนของบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย ตลาดหลักทรัพย์ เอ็ม เอ ไอ โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV โดยใช้การวิเคราะห์เชิงปริมาณ (Quantitative Analysis) ใช้เทคนิคทาง Machine Learning มาประกอบการคัดเลือกหลักทรัพย์ในการลงทุนผ่านระบบที่พัฒนาขึ้นโดยบริษัทจัดการ

กองทุนอาจลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวม หรือกองทุนรวมอสังหาริมทรัพย์ (กอง 1) หรือทรัสต์เพื่อการลงทุนในอสังหาริมทรัพย์ (REITs) หรือกองทุนรวมโครงสร้างพื้นฐาน (infra) ซึ่งอยู่ภายใต้การจัดการของบริษัทจัดการ ในสัดส่วนไม่เกิน 100% ของ NAV

กองทุนอาจลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) เพื่อเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน (Efficient Portfolio Management) และ/หรือการบริหารความเสี่ยง

กลยุทธ์ในการบริหารกองทุนรวม: มุ่งหวังให้ผลประกอบการสูงกว่าดัชนีชี้วัด (active management) โดยใช้การวิเคราะห์เชิงปริมาณ (Quantitative analysis) โดยแยกเป็นกลุ่มปัจจัยที่คาดว่าจะมีผลต่อราคาหุ้น และใช้โมเดลคำนวณให้น้ำหนักเพิ่มแก่ปัจจัยที่คาดว่าจะให้ผลตอบแทนเหนือตลาด หรือลดน้ำหนักปัจจัยที่คาดว่าจะให้ผลตอบแทนต่ำกว่าตลาด ซึ่งโมเดลนี้จะพิจารณาจากหลายๆ ตัวแปร เช่น ค่าความสัมพันธ์ของผลตอบแทนของแต่ละกลุ่มปัจจัย, สภาวะตลาด, สภาวะความเสี่ยง, ตัวเลขทางเศรษฐกิจ หรือตัวแปรอื่นๆ ที่คาดว่าจะเกี่ยวข้อง

นโยบายการจ่ายเงินปันผล :

ชนิดหน่วยลงทุน	รายละเอียด
ชนิดสะสมมูลค่า	ไม่จ่ายเงินปันผล
ชนิดผู้ลงทุนกลุ่ม/บุคคล	ไม่จ่ายเงินปันผล
ชนิดช่องทางอิเล็กทรอนิกส์	ไม่จ่ายเงินปันผล
ชนิดเพื่อการออม	จ่ายปันผลไม่เกินปีละ 12 ครั้ง
ชนิดเพื่อการออมผ่านช่องทางอิเล็กทรอนิกส์	จ่ายปันผลไม่เกินปีละ 12 ครั้ง

ผู้ดูแลผลประโยชน์ : ธนาคารกสิกรไทย จำกัด (มหาชน)

นายทะเบียนหน่วยลงทุน : ธนาคารไทยพาณิชย์ จำกัด (มหาชน)

รอบระยะเวลาบัญชี : สิ้นสุด ณ วันที่ 30 พฤศจิกายน ของทุกปี

## สารจากบริษัทจัดการ

### เรียน ท่านผู้ถือหน่วยลงทุน

กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Machine Learning Thai Equity (SCBMLT) เป็นกองทุนที่ลงทุนในตราสารทุนของบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยและ/หรือตลาดหลักทรัพย์ เอ็ม เอ ไอ โดยมี net exposure ในตราสารดังกล่าวโดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุนรวม กองทุนมีเป้าหมายในการลงทุนให้ผลประกอบการสูงกว่าดัชนีชี้วัด (Active Management) โดยใช้การวิเคราะห์เชิงปริมาณ (Quantitative Analysis) ซึ่งมีการใช้เทคนิคทาง Machine Learning มาประกอบการคัดเลือกหลักทรัพย์ในการลงทุนผ่านระบบที่พัฒนาขึ้น โดยบริษัทจัดการ ดังนั้นผลตอบแทนโดยรวมอาจผันผวนตามราคาดัชนี SET Index ทั้งนี้ในรอบ 12 เดือนที่ผ่านมาตั้งแต่วันที่ 1 ธันวาคม 2565 - 30 พฤศจิกายน 2566 ดัชนีปรับลงร้อยละ 16.27 มาปิดที่ระดับ 1,380.18 จุด

ในไตรมาสที่ 4 ปี 2566 พบว่า SET Index ลดลง 3.8% ต่างชาติยังคงขายหุ้นไทยสุทธิลดลงถึง 3.5 หมื่นล้านบาท ความเสี่ยงด้านลบยังคงอยู่ในตลาดทำให้ SET Index ปรับตัวลง โดยมีการกดดันมาจากปัจจัยต่างประเทศและภายในประเทศ อาทิ 1) สงครามระหว่างอิสราเอลและฮามาส 2) ผลตอบแทนของพันธบัตรรัฐบาลสหรัฐฯ ที่ปรับตัวสูงขึ้น ทำให้มีการกดดันที่สินทรัพย์เสี่ยง โดยมีระดับ Bond Yield 10 ปีสูงสุดในรอบ 16 ปีที่ระดับ 5.02% ณ วันที่ 20 ตุลาคม และ 3) การไม่แจกเงินดิจิทัลตามกำหนดระยะเวลาวันที่ 1 ก.พ. 2567 และการปรับเปลี่ยนเกณฑ์ผู้ได้รับเงินดิจิทัลมาเป็นเฉพาะกลุ่มผู้มีเงินเดือนน้อยกว่า 7 หมื่นหรือเงินฝากน้อยกว่า 5 แสนบาท ซึ่งอาจมีผลกระทบต่อเศรษฐกิจไทยในปีต่อไป โดยมีโอกาสที่การเติบโตของเศรษฐกิจไทยในปีถัดไปอาจไม่สูงถึงระดับ 4% ส่วนภาคการท่องเที่ยวที่มีอิทธิพลต่อเศรษฐกิจต่อเนื่องมานั้น ดูเหมือนจะมีโอกาสน้อยกว่าที่ตลาดคาดการณ์เมื่อต้นปี นอกจากนี้ ยังมีประเด็นความกังวลของนักลงทุนรายย่อยในเรื่อง Naked Short และ Program Trading มีผลให้ตลาดปรับลดลงอย่างต่อเนื่อง ส่งผลให้ SET ทำ new low ของปีที่ 1,357.97 จุด อย่างไรก็ตาม ตลาดมีการปรับตัวดีขึ้นในปลายปี จากการ 1) การประชุมของ FED ในเดือนธันวาคม ซึ่งได้ส่งสัญญาณเพื่อยุติการปรับขึ้นดอกเบี้ยและระบุแนวทางในการลดดอกเบี้ยในปี 2567 ประมาณ 75bps ส่งผลให้อัตราผลตอบแทนของพันธบัตรรัฐบาลสหรัฐฯ ระยะเวลา 10 ปีลดลงเป็น 3.88% และ 2) กองทุน Thai-ESG เริ่มมีการเข้ามามีส่วนร่วมในตลาด โดยรวมทั้งปี 2566 การปรับตัวลงของตลาดตลอดทั้งปีทำให้ประเทศไทยเป็นหนึ่งในประเทศที่มีผลงานที่แย่ที่สุด ลดลงประมาณ 15% และการขายสุทธิของต่างชาติในหุ้นไทยมากกว่า 1.92 แสนล้านบาทตลอดทั้งปี

สำหรับแนวโน้มของตลาดในครึ่งแรกของปี 2567 ถึงแม้ว่าภาพรวมของตลาดหุ้นไทยในปีนี้จะดูดีขึ้น แต่ควรระมัดระวังกับความผันผวนที่อาจเกิดขึ้นในช่วงเริ่มต้นของปี จากความล่าช้าการอนุมัติงบประมาณปี 2567 ซึ่งจะทำให้เศรษฐกิจไทยในช่วง 3-4 เดือนแรกยังขาดแรงผลักดันที่สำคัญ นอกจากนี้ มีความกังวลเกี่ยวกับการปรับฐานของตลาดหุ้นสหรัฐฯ หลังจากที่มีการบันทึกสถิติสูงสุดใหม่ในปีที่ผ่านมา ทำให้ตลาดอาจจะคาดหวังเกินไปในการลดดอกเบี้ยของ FED ที่จะเกิดขึ้นในการประชุมเดือนมีนาคม 2567 และคาดหวังว่าจะลดลงมากถึง 6 ครั้งในปี 2567 หรือประมาณ -150 bps เมื่อเปรียบเทียบกับ Dot Plot ล่าสุดของ FED ที่คาดว่าจะลดดอกเบี้ย 3 ครั้งหรือประมาณ -75 bps อีกทั้งเศรษฐกิจโลกกำลังแสดงให้เห็นถึงแนวโน้มที่อ่อนแอมากขึ้น โดยเฉพาะการเพิ่มอัตราดอกเบี้ยของธนาคารกลางในหลายประเทศ ซึ่งข้อมูลทางเศรษฐกิจเริ่มส่งสัญญาณที่ชัดเจนขึ้น แม้ตลาดจะมองว่าการชะลอลงเป็นเรื่องดี เพราะคาดหวังว่า Fed จะหยุดขึ้นดอกเบี้ย แต่ถึงจุดๆ หนึ่ง ตลาดจะเริ่มตีความเป็นข่าวร้ายเพราะจะสะท้อนถึง EPS ที่จะต้องถูกปรับลงในอนาคต และอาจจะจุดตลาดโลกลงมา ส่งผลเชิงลบต่อตลาดไทย

สุดท้ายนี้ บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด ขอขอบพระคุณผู้ถือหน่วยลงทุนทุกท่านที่ได้มอบความไว้วางใจลงทุนในกองทุนรวมของ บลจ. ด้วยดีเสมอมา

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด



ธนาคารกสิกรไทย  
开泰银行 KASIKORNBANK



## ความเห็นของผู้ดูแลผลประโยชน์

เรียน ผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุน กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Machine Learning Thai Equity

ข้าพเจ้า บมจ.ธนาคารกสิกรไทย ในฐานะผู้ดูแลผลประโยชน์ได้ดูแลการจัดการกองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Machine Learning Thai Equity ซึ่งจัดการโดย บริษัท หลักทรัพย์จัดการกองทุนไทยพาณิชย์ จำกัด สำหรับระยะเวลาตั้งแต่วันที่ 1 ธันวาคม พ.ศ. 2565 ถึงวันที่ 30 พฤศจิกายน พ.ศ. 2566 แล้ว

ข้าพเจ้าเห็นว่า บริษัท หลักทรัพย์จัดการกองทุนไทยพาณิชย์ จำกัด ได้ปฏิบัติหน้าที่ในการจัดการ กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Machine Learning Thai Equity เหมาะสมตามสมควรแห่งวัตถุประสงค์ ที่ได้กำหนดไว้ในโครงการและภายใต้พระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535

ขอแสดงความนับถือ  
บมจ. ธนาคารกสิกรไทย

(นายวิโรจน์ สิมะทองธรรม)  
รองผู้อำนวยการฝ่ายบริการธุรกิจหลักทรัพย์

(นายวุฒิชัย รอดภัย)  
หัวหน้าส่วนฝ่ายบริการธุรกิจหลักทรัพย์

วันที่ 8 ธันวาคม พ.ศ. 2566

**ผลการดำเนินงาน**  
**ข้อมูล ณ วันที่ 30 พฤศจิกายน 2566**

ผลตอบแทนจากการลงทุน	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี	3 ปี	5 ปี	10 ปี	ตั้งแต่จัดตั้ง
SCBMLTA	-14.27%	-11.72%	-9.61%	-12.79%	1.73%	-1.02%	n.a.	-1.39%
เกณฑ์มาตรฐาน	-14.93%	-11.39%	-9.09%	-13.18%	2.19%	-0.47%	n.a.	-0.45%
ความผันผวนของผลการดำเนินงาน	11.38%	6.26%	8.36%	11.84%	12.81%	17.51%	n.a.	16.82%
ความผันผวนของเกณฑ์มาตรฐาน	11.24%	6.40%	8.61%	11.67%	12.38%	16.72%	n.a.	15.95%

เกณฑ์มาตรฐาน : ดัชนีผลตอบแทนรวมตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET TRI) สัดส่วน 100%

ผลตอบแทนจากการลงทุน	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี	3 ปี	5 ปี	10 ปี	ตั้งแต่จัดตั้ง
SCBMLTP	-13.42%	-11.48%	-9.12%	-11.85%	2.83%	0.04%	n.a.	-0.97%
เกณฑ์มาตรฐาน	-14.93%	-11.39%	-9.09%	-13.18%	2.19%	-0.47%	n.a.	-1.00%
ความผันผวนของผลการดำเนินงาน	11.38%	6.26%	8.36%	11.84%	12.81%	17.51%	n.a.	16.88%
ความผันผวนของเกณฑ์มาตรฐาน	11.24%	6.40%	8.61%	11.67%	12.38%	16.72%	n.a.	16.02%

เกณฑ์มาตรฐาน : ดัชนีผลตอบแทนรวมตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET TRI) สัดส่วน 100%

ผลตอบแทนจากการลงทุน	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี	3 ปี	5 ปี	10 ปี	ตั้งแต่จัดตั้ง
SCBMLT(E)	-5.72%	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.	-5.72%
เกณฑ์มาตรฐาน	-4.76%	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.	-4.76%
ความผันผวนของผลการดำเนินงาน	5.69%	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.	5.69%
ความผันผวนของเกณฑ์มาตรฐาน	5.72%	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.	5.72%

เกณฑ์มาตรฐาน : ดัชนีผลตอบแทนรวมตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET TRI) สัดส่วน 100%

ผลตอบแทนจากการลงทุน	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี	3 ปี	5 ปี	10 ปี	ตั้งแต่จัดตั้ง
SCBMLT(SSF)	-5.78%	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.	-5.78%
เกณฑ์มาตรฐาน	-4.76%	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.	-4.76%
ความผันผวนของผลการดำเนินงาน	5.68%	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.	5.68%
ความผันผวนของเกณฑ์มาตรฐาน	5.72%	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.	5.72%

เกณฑ์มาตรฐาน : ดัชนีผลตอบแทนรวมตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET TRI) สัดส่วน 100%

ผลตอบแทนจากการลงทุน	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี	3 ปี	5 ปี	10 ปี	ตั้งแต่จัดตั้ง
SCBMLT(SSFE)	-5.64%	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.	-5.64%
เกณฑ์มาตรฐาน	-4.76%	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.	5.68%
ความผันผวนของผลการดำเนินงาน	5.68%	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.	5.68%
ความผันผวนของเกณฑ์มาตรฐาน	5.72%	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.	5.72%

เกณฑ์มาตรฐาน : ดัชนีผลตอบแทนรวมตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET TRI) สัดส่วน 100%

หมายเหตุ : เอกสารการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวมฉบับนี้ ได้จัดทำขึ้นตามมาตรฐานการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวมของสมาคมบริษัทจัดการลงทุน

**บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด**  
**กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Machine Learning Thai Equity**  
**รายละเอียดหลักทรัพย์ และสัดส่วนการลงทุน**  
**ณ วันที่ 30 พฤศจิกายน 2566**

ชื่อหลักทรัพย์	ราคา ณ 30 พ.ย. 2566 (บาท)	จำนวนหุ้น (หุ้น)	มูลค่า ตามราคาตลาด (บาท)	ร้อยละของมูลค่า ทรัพย์สินสุทธิ (%)	ถ้าประกัน/รับรอง/รับอวัล หรือสלקหลังโอน แบบมีสิทธิไต่เบี่ย
<b>หลักทรัพย์จดทะเบียน</b>			<b>344,051,808.50</b>	<b>80.12%</b>	
<b>หุ้นสามัญ</b>			<b>344,051,808.50</b>	<b>80.12%</b>	
<b>การท่องเที่ยวและสันทนาการ</b>			<b>14,121,325.00</b>	<b>3.29%</b>	
บมจ.ดิ เอราวัณ กรุ๊ป(ERW)	5.25	2,229,900.00	11,706,975.00	2.73%	
บมจ. ไมเนอร์ อินเตอร์เนชั่นแนล(MINT)	27.25	88,600.00	2,414,350.00	0.56%	
<b>การแพทย์</b>			<b>41,771,662.00</b>	<b>9.73%</b>	
บมจ. โรงพยาบาลบำรุงราษฎร์(BH)	223.00	72,000.00	16,056,000.00	3.74%	
บมจ. บางกอก เชน ฮอस्पิตอล(BCH)	21.40	667,900.00	14,293,060.00	3.33%	
บมจ. กรุงเทพดุสิตเวชการ(BDMS)	26.25	365,200.00	9,586,500.00	2.23%	
บมจ. โรงพยาบาลจุฬารัตน์(CHG)	2.82	651,100.00	1,836,102.00	0.43%	
<b>ขนส่งและโลจิสติกส์</b>			<b>13,268,200.00</b>	<b>3.09%</b>	
บมจ. ท่าอากาศยานไทย(AOT)	59.50	124,400.00	7,401,800.00	1.72%	
บมจ. ปริมา มารีน(PRM)	5.10	768,400.00	3,918,840.00	0.91%	
บมจ. การบินกรุงเทพ(BA)	14.20	107,600.00	1,527,920.00	0.36%	
บมจ. ทางด่วนและรถไฟฟ้ากรุงเทพ(BEM)	7.80	53,800.00	419,640.00	0.10%	
<b>ชิ้นส่วนอิเล็กทรอนิกส์</b>			<b>29,347,825.00</b>	<b>6.83%</b>	
บมจ. เคซีอี อีเลคโทรนิคส์(KCE)	52.50	260,000.00	13,650,000.00	3.18%	
บมจ. ฮานา ไมโครอิเล็กทรอนิกส์(HANA)	44.75	211,100.00	9,446,725.00	2.20%	
บมจ. เดลต้า อีเลคโทรนิคส์ (ประเทศไทย) (DELTA)	77.75	80,400.00	6,251,100.00	1.46%	
<b>ธนาคาร</b>			<b>62,999,955.00</b>	<b>14.67%</b>	
บมจ. ทูนคราชาติ(TCAP)	48.00	275,700.00	13,233,600.00	3.08%	
บมจ. ธนาคารกรุงไทย(KTB)	18.20	554,200.00	10,086,440.00	2.35%	
บมจ. เอสซีบี เอกซ์(SCB)	99.25	88,400.00	8,773,700.00	2.04%	
บมจ. ธนาคารกสิกรไทย(KBANK)	128.00	66,100.00	8,460,800.00	1.97%	
บมจ. ทีสโก้ไฟแนนเชียลกรุ๊ป(TISCO)	97.25	84,700.00	8,237,075.00	1.92%	
บมจ. ธนาคารกรุงเทพ(BBL)	151.00	48,100.00	7,263,100.00	1.69%	
บมจ. ธนาคารทหารไทยนครชาติ(TTB)	1.54	4,236,000.00	6,523,440.00	1.52%	
บมจ. ธนาคารกรุงศรีอยุธยา(BAY)	27.75	15,200.00	421,800.00	0.10%	
<b>ธุรกิจการเกษตร</b>			<b>5,534,010.00</b>	<b>1.29%</b>	
บมจ. ศรีตรังแอโกรอินดัสทรี(STA)	15.30	361,700.00	5,534,010.00	1.29%	
<b>ประกันภัยและประกันชีวิต</b>			<b>233,100.00</b>	<b>0.05%</b>	
บมจ. ทีคิวเอ็ม อัลฟา(TQM)	27.75	8,400.00	233,100.00	0.05%	
<b>ปิโตรเคมีและเคมีภัณฑ์</b>			<b>857,500.00</b>	<b>0.20%</b>	
บมจ. อินโดรามา เวนเจอร์ส(IVL)	24.50	35,000.00	857,500.00	0.20%	



**บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด**  
**กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Machine Learning Thai Equity**  
**รายละเอียดหลักทรัพย์ และสัดส่วนการลงทุน**  
**ณ วันที่ 30 พฤศจิกายน 2566**

ชื่อหลักทรัพย์	ราคา ณ 30 พ.ย. 2566 (บาท)	จำนวนหุ้น (หุ้น)	มูลค่า ตามราคาตลาด (บาท)	ร้อยละของมูลค่า ทรัพย์สินสุทธิ (%)	ถ้าประกัน/รับรอง/รับอวัล หรือสลักหลังโอน แบบมีสิทธิไต่เบี่ย
<b>พลังงานและสาธารณูปโภค</b>			<b>44,485,323.50</b>	<b>10.36%</b>	
บมจ.ปตท.สำรวจและผลิตปิโตรเลียม(PTTEP)	151.50	107,900.00	16,346,850.00	3.81%	
บมจ.บางจาก คอร์ปอเรชั่น(BCP)	43.50	185,200.00	8,056,200.00	1.88%	
บมจ.บี.กริม เพาเวอร์(BGRIM)	25.25	314,900.00	7,951,225.00	1.85%	
บมจ.ปตท.(PTT)	34.75	128,100.00	4,451,475.00	1.04%	
บมจ.ไทยออยล์(TOP)	51.50	68,949.00	3,550,873.50	0.83%	
บมจ.ทีทีดับบลิว(TTW)	8.85	320,800.00	2,839,080.00	0.66%	
บมจ.กันกุลเอ็นจิเนียริง(GUNKUL)	2.60	268,000.00	696,800.00	0.16%	
บมจ.สตาร์ ปิโตรเลียม รีไฟน์นิ่ง(SPRC)	8.20	59,500.00	487,900.00	0.11%	
บมจ.เอสพีซีจี(SPCG)	12.20	8,600.00	104,920.00	0.02%	
<b>พัฒนาอสังหาริมทรัพย์</b>			<b>45,841,719.00</b>	<b>10.67%</b>	
บมจ.ดับบลิวเอชเอ คอร์ปอเรชั่น(WHA)	5.00	2,992,800.00	14,964,000.00	3.48%	
บมจ.แลนด์แอนด์เฮาส์(LH)	7.70	1,067,400.00	8,218,980.00	1.91%	
บมจ.อมตะ คอร์ปอเรชั่น(AMATA)	25.00	302,600.00	7,565,000.00	1.76%	
บมจ.เอพี (ไทยแลนด์)(AP)	10.80	534,700.00	5,774,760.00	1.34%	
บมจ.ควอลิตี้เฮาส์(QH)	2.16	1,850,700.00	3,997,512.00	0.93%	
บมจ.ศุภาลักษณ์(SPALI)	17.60	120,500.00	2,120,800.00	0.49%	
บมจ.แสนสิริ(SIRI)	1.67	768,900.00	1,284,063.00	0.30%	
บมจ.เอสซี แอสเสท คอร์ปอเรชั่น(SC)	3.08	385,800.00	1,188,264.00	0.28%	
บมจ.พุกกะยา โฮลดิ้ง(PSH)	12.20	59,700.00	728,340.00	0.17%	
<b>พาณิชย์</b>			<b>4,881,530.00</b>	<b>1.14%</b>	
บมจ.โฮมโปรคัส เซ็นเตอร์(HMPRO)	11.80	165,500.00	1,952,900.00	0.45%	
บมจ.คอมเซเวน(COM7)	22.90	52,200.00	1,195,380.00	0.28%	
บมจ.เมก้า ไลฟ์ไชนเอนซ์(MEGA)	39.75	30,000.00	1,192,500.00	0.28%	
บมจ.เบอร์ลี่ ชูเกอร์(BJC)	26.25	20,600.00	540,750.00	0.13%	
<b>วัสดุก่อสร้าง</b>			<b>5,946,384.00</b>	<b>1.38%</b>	
บมจ.ทีบีทีเอสพี(TASCO)	16.50	163,300.00	2,694,450.00	0.63%	
บมจ.ปูนซิเมนต์ไทย(SCC)	287.00	6,100.00	1,750,700.00	0.41%	
บมจ.ไดนาสตีเซรามิค(DCC)	1.57	956,200.00	1,501,234.00	0.35%	
<b>สื่อและสิ่งพิมพ์</b>			<b>1,523,875.00</b>	<b>0.35%</b>	
บมจ.แพลน บี มีเดีย(PLANB)	8.35	182,500.00	1,523,875.00	0.35%	
<b>อาหารและเครื่องดื่ม</b>			<b>34,500,355.00</b>	<b>8.03%</b>	
บมจ.อิชิคิน กรุ๊ป(ICHI)	14.30	755,000.00	10,796,500.00	2.51%	
บมจ.ไอ-เทล คอร์ปอเรชั่น(ITC)	20.90	369,000.00	7,712,100.00	1.80%	
บมจ.คาราบาวกรุ๊ป(CBG)	81.75	81,600.00	6,670,800.00	1.55%	
บมจ.โอสภสกา(OSP)	22.90	209,700.00	4,802,130.00	1.12%	

**บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด**  
**กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Machine Learning Thai Equity**  
**รายละเอียดหลักทรัพย์ และสัดส่วนการลงทุน**  
**ณ วันที่ 30 พฤศจิกายน 2566**

ชื่อหลักทรัพย์	ราคา ณ 30 พ.ย. 2566 (บาท)	จำนวนหุ้น (หุ้น)	มูลค่า ตามราคาตลาด (บาท)	ร้อยละของมูลค่า ทรัพย์สินสุทธิ (%)	ถ้าประกัน/รับรอง/รับอาวัล หรือสลับหลังโอน แบบมีสิทธิไต่เบี่ย
บมจ.เอ็มเค เรสโตรองต์ กรุ๊ป(M)	39.75	64,700.00	2,571,825.00	0.60%	
บมจ.อาร์ แอนด์ บี ฟู้ด ซัพพลาย(RBF)	13.20	147,500.00	1,947,000.00	0.45%	
<b>เงินทุนและหลักทรัพย์</b>			<b>17,231,425.00</b>	<b>4.01%</b>	
บมจ.ศรีสวัสดิ์ คอร์ปอเรชั่น(SAWAD)	44.25	154,800.00	6,849,900.00	1.60%	
บมจ.เมืองไทย แคปปิตอล(MTC)	43.75	140,800.00	6,160,000.00	1.43%	
บมจ.บริหารสินทรัพย์ กรุงเทพพาณิชย์ (BAM)	8.25	511,700.00	4,221,525.00	0.98%	
<b>เทคโนโลยีสารสนเทศและการสื่อสาร</b>			<b>21,507,620.00</b>	<b>5.01%</b>	
บมจ.แอดวานซ์ อินโฟร์ เซอร์วิส (ADVANC)	218.00	72,300.00	15,761,400.00	3.67%	
บมจ.ไทยคม(THCOM)	12.30	422,600.00	5,197,980.00	1.21%	
บมจ.ทรู คอร์ปอเรชั่น(TRUE)	5.60	97,900.00	548,240.00	0.13%	
<b>หลักทรัพย์ไม่จดทะเบียน</b>			<b>10,304.00</b>	<b>0.00%</b>	
<b>หุ้นสามัญ</b>			<b>10,304.00</b>	<b>0.00%</b>	
<b>วัตถุประสงค์สร้าง</b>			<b>10,304.00</b>	<b>0.00%</b>	
บมจ.เอสซีจี เดคคอร์ด(SCGD/U)	11.50	896.00	10,304.00	0.00%	
<b>ตราสารหนี้</b>			<b>67,995,409.26</b>	<b>15.83%</b>	
<b>ตราสารหนี้ในประเทศ</b>			<b>67,995,409.26</b>	<b>15.83%</b>	
<b>พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย</b>			<b>67,995,409.26</b>	<b>15.83%</b>	
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 1/364/66(CB24104A)	0.00	0.00	17,966,528.10	4.18%	
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 43/91/66(CB24125A)	0.00	0.00	15,944,980.32	3.71%	
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 44/91/66(CB24201A)	0.00	0.00	15,939,884.48	3.71%	
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 6/FRB364/66(CBF24610A)	1,000.24	10,000.00	10,110,771.80	2.35%	
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 10/FRB183/66(CBF24409A)	1,000.46	8,000.00	8,033,244.56	1.87%	
<b>เงินฝากธนาคาร</b>			<b>14,065,475.09</b>	<b>3.28%</b>	
บมจ.ธนาคารกสิกรไทย(KBANK)	0.00	0.00	14,065,475.09	3.28%	
<b>สัญญาซื้อขาย Future</b>			<b>(4,616,575.20)</b>	<b>(1.08%)</b>	
ฟิวเจอร์สที่อ้างอิงกับหุ้นสามัญ บมจ.ซูเปอร์ เอนเนอร์ยี คอร์ปอเรชั่น(SUPERZ23)	0.46	1,324.00	458,816.00	0.11%	

**บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด**  
**กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Machine Learning Thai Equity**  
**รายละเอียดหลักทรัพย์ และสัดส่วนการลงทุน**  
**ณ วันที่ 30 พฤศจิกายน 2566**

ชื่อหลักทรัพย์	ราคา ณ 30 พ.ย. 2566 (บาท)	จำนวนหุ้น (หุ้น)	มูลค่า ตามราคาตลาด (บาท)	ร้อยละของมูลค่า ทรัพย์สินสุทธิ (%)	ถ้าประกัน/รับรอง/รับอาวัล หรือสลักหลังโอน แบบมีสิทธิไต่เบี่ย
ฟิวเจอร์สที่อ้างอิงกับหุ้นสามัญ บมจ.ศรีตรัง โกลฟส์ (ประเทศไทย)(STGTZ23)	6.11	101.00	469,831.80	0.11%	
ฟิวเจอร์สที่อ้างอิงกับหุ้นสามัญ บมจ.สยามแก๊ส แอนด์ ปิโตรเคมีคัลส์(SGPZ23)	8.58	20.00	128,912.00	0.03%	
ฟิวเจอร์สที่อ้างอิงกับหุ้นสามัญ บมจ.พีรเชิษ ชิปปิ้ง(PSLZ23)	8.48	68.00	411,672.00	0.10%	
ฟิวเจอร์สที่อ้างอิงกับหุ้นสามัญ บมจ.กัลฟ์ เอ็น เนอร์จี ดีเวลลอปเม้นท์(GULFZ23)	45.73	8.00	294,832.00	0.07%	
ฟิวเจอร์สที่อ้างอิงกับดัชนี SET50 - ธ.ก. 66(S50Z23)	851.60	120.00	(2,231,074.40)	(0.52%)	
ฟิวเจอร์สที่อ้างอิงกับดัชนี SET50 - ก.ย. 67(S50U24)	843.70	70.00	(484,607.60)	(0.11%)	
ฟิวเจอร์สที่อ้างอิงกับดัชนี SET50 - มี.ย. 67(S50M24)	848.00	100.00	(1,597,924.60)	(0.37%)	
ฟิวเจอร์สที่อ้างอิงกับดัชนี SET50 - มี.ก. 67(S50H24)	849.70	120.00	(2,067,032.40)	(0.48%)	
สินทรัพย์อื่น			<b>13,475,413.54</b>	<b>3.14%</b>	
หนี้สินอื่น			<b>(5,542,715.98)</b>	<b>(1.29%)</b>	
<b>มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ</b>			<b>429,439,119.21</b>	<b>100.00%</b>	
<b>มูลค่าหน่วยลงทุน (บาท)</b>	<b>9.1990</b>				

**บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด**  
**กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Machine Learning Thai Equity**  
**รายงานสรุปเงินลงทุน**  
**ณ วันที่ 30 พฤศจิกายน 2566**

กลุ่มของตราสาร	มูลค่าตามราคาตลาด	%NAV
(ก) ตราสารภาครัฐ ได้แก่ คิวแลงเงิน พันธบัตรรัฐบาล พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย พันธบัตร หรือตราสารแห่งหนึ่งที่กองทุนเพื่อการฟื้นฟูและพัฒนาสถาบันการเงิน หรือกระทรวงการคลัง เป็นผู้ออก ผู้รับรอง ผู้รับอ่าวัด หรือผู้ค้ำประกัน	67,995,409.26	15.83
(ข) ตราสารที่ธนาคารที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้น ธนาคารพาณิชย์ หรือบริษัทเงินทุนเป็นผู้ออก ผู้รับรอง ผู้รับอ่าวัด ผู้สตั๊กหลัง หรือผู้ค้ำประกัน	14,065,475.09	3.28
(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

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด  
 กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Machine Learning Thai Equity  
 รายละเอียดตัวตราสารและอันดับความน่าเชื่อถือของตราสารทุกตัวใน Port  
 ณ วันที่ 30 พฤศจิกายน 2566

ประเภท	ผู้ออก	ผู้ค้ำผู้รับรอง/ผู้หลักหลัง	วันครบกำหนด	อันดับความน่าเชื่อถือของผู้ออกตราสาร		มูลค่าหน้าตัว	มูลค่าตามราคาตลาด
				TRIS Rating	FITCH Rating		
พันธบัตร	ธนาคารแห่งประเทศไทย		04/01/2024			18,000,000.00	17,966,528.10
	ธนาคารแห่งประเทศไทย		25/01/2024			16,000,000.00	15,944,980.32
	ธนาคารแห่งประเทศไทย		01/02/2024			16,000,000.00	15,939,884.48
	ธนาคารแห่งประเทศไทย		09/04/2024			8,000,000.00	8,033,244.56
	ธนาคารแห่งประเทศไทย		10/06/2024			10,000,000.00	10,110,771.80
เงินฝากธนาคาร	บมจ.ธนาคารกสิกรไทย				AA+(tha)	-	14,065,475.09

กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Machine Learning Thai Equity

SCB Machine Learning Thai Equity Fund

แบบค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม

FUND'S DIRECT EXPENSES REPORT

ตั้งแต่วันที่ 01 ธันวาคม 2565 ถึงวันที่ 30 พฤศจิกายน 2566

Period from 01 December 2022 to 30 November 2023

ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม * Fund's direct expenses	รอบปีบัญชี (01 ธันวาคม 2565 ถึงวันที่ 30 พฤศจิกายน 2566)	
	จำนวนเงิน หน่วย : พันบาท	ร้อยละต่อปีของ มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ
ค่าธรรมเนียมบริหารกองทุน (Management fee)		
- ชนิดผู้ลงทุนกลุ่ม/บุคคล ( SCBMLTP )	-	-
- ชนิดช่องทางอิเล็กทรอนิกส์ ( SCBMLT(E) )	-	-
- ชนิดสะสมมูลค่า ( SCBMLTA )	5,930	1.07
- ชนิดเพื่อการออม ( SCBMLT(SSF) )	-	1.07
- ชนิดเพื่อการออมผ่านช่องทางอิเล็กทรอนิกส์ ( SCBMLT(SSFE) )	-	-
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ (Trustee fee)	151	0.03
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน (Registrar fee)	373	0.07
ค่าที่ปรึกษาการลงทุน (Advisory fee)	-	-
ค่าใช้จ่ายอื่น ๆ (Other expenses)	52	0.01
รวมค่าใช้จ่ายทั้งหมด (Total Expense) **	6,506	1.16

\* 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 2565 ถึง วันที่ 30 พฤศจิกายน 2566

Period from 1 December 2022 to 30 November 2023

	(พันบาท) / (Thousand Baht)
มูลค่าทรัพย์สินสุทธิเฉลี่ย / Average Net Assets Value	565,071
การซื้อขายหลักทรัพย์รวม / Volume Trade	
มูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์รวม	3,692,691
Total Volume Trade	
ค่าธรรมเนียมหน้าในการซื้อขายหลักทรัพย์รวม	1,443
Total Brokerage Fee	
ค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายอื่น ๆ รวม / Fee and other Expenses	6,506
	(ร้อยละ) / (Percentage)
<ul style="list-style-type: none"> <li>สัดส่วนค่าธรรมเนียมหน้าในการซื้อขายหลักทรัพย์รวมคิดเป็นร้อยละของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์รวม</li> </ul>	0.04
<ul style="list-style-type: none"> <li>    Brokerage Fee as</li> <li>    Percentage of Total Trading Volume</li> </ul>	
<ul style="list-style-type: none"> <li>สัดส่วนค่าธรรมเนียมหน้าในการซื้อขายหลักทรัพย์รวมคิดเป็นร้อยละของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิเฉลี่ย</li> </ul>	0.26
<ul style="list-style-type: none"> <li>    Brokerage Fee as</li> <li>    Percentage of Average Net Assets Value</li> </ul>	
<ul style="list-style-type: none"> <li>สัดส่วนค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายอื่น ๆ รวมคิดเป็นร้อยละของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิเฉลี่ย</li> </ul>	1.16
<ul style="list-style-type: none"> <li>    Fee and other Expenses as</li> <li>    Percentage of Average Net Assets Value</li> </ul>	
<ul style="list-style-type: none"> <li>อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุนของกองทุนรวม (PTR)</li> </ul>	3.13
<ul style="list-style-type: none"> <li>    Portfolio Turnover Ratio (PTR)</li> </ul>	

รายงานรายชื่อบริษัทนายหน้า และค่าธรรมเนียม ซื้อ-ขาย หลักทรัพย์  
 ของกองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Machine Learning Thai Equity  
 ระหว่างวันที่ 1 ธันวาคม 2565 ถึงวันที่ 30 พฤศจิกายน 2566

ลำดับที่	ชื่อบริษัทนายหน้า	ค่านายหน้า (พันบาท)	อัตราส่วนค่านายหน้าแต่ละราย ต่อค่านายหน้าทั้งหมด
1	บริษัทหลักทรัพย์ กรุงไทย เอ็กซ์สปริง จำกัด	198.63	13.76%
2	บริษัทหลักทรัพย์ หยวนต้า (ประเทศไทย) จำกัด	152.01	10.53%
3	INNOVESTX SECURITIES CO.,LTD.	144.94	10.04%
4	บริษัทหลักทรัพย์ ยูโอบี เคย์เสียน (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)	142.97	9.91%
5	บริษัทหลักทรัพย์ ธนชาด จำกัด (มหาชน)	130.63	9.05%
6	KGI SECURITIES (THAILAND) PLC.	126.69	8.78%
7	บริษัทหลักทรัพย์ อาร์เอชบี (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)	122.25	8.47%
8	บริษัทหลักทรัพย์ เมย์แบงก์ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)	109.37	7.58%
9	บริษัทหลักทรัพย์ โนมูระ พัฒนสิน จำกัด (มหาชน)	75.83	5.25%
10	บริษัทหลักทรัพย์ กรุงศรี จำกัด (มหาชน)	54.46	3.77%
11-18	บล.อื่นๆ	185.39	12.85%
<b>รวม</b>		1,443.17	100.00%

หมายเหตุ : บริษัทหลักทรัพย์ ไทยพาณิชย์ จำกัด ประกาศเปลี่ยนชื่อบริษัทเป็น “บริษัทหลักทรัพย์ อินโนเวสต์ เอกซ์ จำกัด” มีผลตั้งแต่วันที่ 12 กันยายน 2565



การรับผลประโยชน์ตอบแทนเนื่องจากการที่กองทุนใช้บริการบุคคลอื่น ประจำเดือน พฤศจิกายน 2566

**BENEFIT FROM BROKERAGE SERVICES AS OF NOVEMBER 2023**

บริษัทที่ให้บริการ	BROKERAGE HOUSES	ผลประโยชน์ที่ได้รับ*					
		บทวิเคราะห์ <sup>1</sup> Research Paper	ข้อมูลพื้นฐาน <sup>2</sup> Fundamental Data	รายงานสรุปข่าว <sup>3</sup> News Summary	สัมมนา <sup>4</sup> Seminar	บรรยายกลยุทธ์การลงทุน <sup>5</sup> Strategy Presentation	จัดเยี่ยมชมบริษัท <sup>6</sup> Company Visit
บริษัทหลักทรัพย์ เอเชีย พลัส จำกัด	ASIA PLUS SECURITIES COMPANY LIMITED	✓	✓	✓		✓	
บริษัทหลักทรัพย์ บัวหลวง จำกัด (มหาชน)	BUALUANG SECURITIES PUBLIC COMPANY LIMITED	✓	✓	✓	✓	✓	✓
บริษัทหลักทรัพย์ ซี แอส เอส เอ (ประเทศไทย) จำกัด	CLSA SECURITIES (THAILAND) LIMITED	✓	✓	✓		✓	✓
บริษัทหลักทรัพย์ กรุงศรี ฟิลิปปินส์ จำกัด (มหาชน)	KRUNGSRI CAPITAL SECURITIES PUBLIC COMPANY LIMITED	✓	✓	✓		✓	
บริษัทหลักทรัพย์ เครดิต สวิส (ประเทศไทย) จำกัด	CREDIT SUISSE SECURITIES (THAILAND) LIMITED	✓	✓	✓		✓	
บริษัทหลักทรัพย์ เมย์แบงก์ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)	MAYBANK SECURITIES (THAILAND) PUBLIC COMPANY LIMITED	✓	✓	✓	✓	✓	✓
บริษัทหลักทรัพย์ อีสทรีท ไทย จำกัด (มหาชน)	KASKORN SECURITIES PUBLIC COMPANY LIMITED	✓	✓	✓	✓	✓	✓
บริษัทหลักทรัพย์ กรุงศรี จำกัด (มหาชน)	KRUNGSRI SECURITIES PUBLIC COMPANY LIMITED	✓	✓	✓		✓	✓
บริษัทหลักทรัพย์ เคทีเอ็นเคอินเวส จำกัด (มหาชน)	KIATNAKIN PHATRA SECURITIES PUBLIC COMPANY LIMITED	✓	✓	✓		✓	
บริษัทหลักทรัพย์ อินโนเวสตซ์ จำกัด	INNOVESTX SECURITIES COMPANY LIMITED	✓	✓	✓		✓	✓
บริษัทหลักทรัพย์ ธนชาต จำกัด (มหาชน)	THANACHART SECURITIES PUBLIC COMPANY LIMITED	✓	✓	✓		✓	
บริษัทหลักทรัพย์ ทีเอสไอ จำกัด	TISCO SECURITIES COMPANY LIMITED	✓	✓	✓	✓	✓	
บริษัทหลักทรัพย์ ซีจีเอส-ซีไอเอ็มบี (ประเทศไทย) จำกัด	CGS-CIMB 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 วิกเคอร์ส (ประเทศไทย) จำกัด	DBS VICKERS SECURITIES (THAILAND) COMPANY LIMITED	✓	✓	✓	✓	✓	✓
บริษัทหลักทรัพย์ อาร์เอชบี (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)	RHB SECURITIES (THAILAND) PUBLIC COMPANY LIMITED	✓	✓	✓		✓	
บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ซีเอส จำกัด (มหาชน)	FINANSIA SYRUS SECURITIES PUBLIC COMPANY LIMITED	✓	✓	✓		✓	
บริษัทหลักทรัพย์ ดาโอ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)	DAOL SECURITIES (THAILAND) PUBLIC COMPANY LIMITED	✓	✓	✓		✓	✓
บริษัทหลักทรัพย์ ยูโอบี เคอีเอช (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)	UOB KAYHIAN SECURITIES (THAILAND) PUBLIC COMPANY LIMITED	✓	✓	✓		✓	✓
บริษัทหลักทรัพย์ กรุงไทย เอ็กซ์สปริง จำกัด	KRUNGTHAI XSPRING SECURITIES COMPANY LIMITED	✓	✓	✓		✓	
บริษัทหลักทรัพย์ ซิตี้คอร์ป (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 (รายงานบริษัทและสภาพตลาดฯ รายวัน, รายเดือน, รายไตรมาส) Analysis Reports (Market Summary and Companies updated analysis on daily, monthly and quarterly basis)
2. ข้อมูลพื้นฐาน (ข้อมูลตลาดฯ, งบการเงิน บมจ. ย้อนหลัง) (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)

ข้อมูลการดำเนินการจัดหรือออกเสียงในที่ประชุมผู้ถือหุ้นในนามกองทุนรวมของรอบปีปฏิทินล่าสุด

สามารถตรวจสอบข้อมูลได้จาก Website : www.scbam.com

กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Machine Learning Thai Equity  
 รายชื่อบุคคลที่เกี่ยวข้องที่มีการทำธุรกรรมกับกองทุน  
 ตั้งแต่วันที่ 1 ธันวาคม 2565 ถึงวันที่ 30 พฤศจิกายน 2566

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

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

การถือหุ้นของลงทุนเกิน 1 ใน 3
- ไม่มี -

รายชื่อผู้จัดการกองทุน (Fund Manager)  
 กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Machine Learning Thai Equity

ลำดับ	ชื่อ - นามสกุล	ลำดับ	ชื่อ - นามสกุล
1	คุณพูนศักดิ์ โลหะสุนทร	4	คุณกฤษฎา จันทร์หนัก
2	คุณไพรัช นิตยานุภาพ	5	คุณณัฐวุฒิ เดชบดินทร์
3	คุณสถิตย์พงษ์ จันทระจิรวงศ์		

ที่มาข้อมูล : <http://www.scbam.com> ข้อมูล ณ วันที่ 3 มกราคม 2567



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

475 Siripinyo Building, 16 Floor, Unit 1061, Sriyuthaya Road, Thanon Phayathai Sub-District, Ratchathewi District, Bangkok. 10400. T. +66 23542192-4  
475 อาคารสิริปิณทุย ชั้น 16 ยูนิต 1601 ถนนศรีอยุธยา แขวงถนนพญาไท เขตราชเทวี กรุงเทพมหานคร 10400. โทร. +66 23542192-4

รายงานของผู้สอบบัญชีรับอนุญาต

เสนอ ผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุนของกองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Machine Learning Thai Equity

**ความเห็น**

ข้าพเจ้าได้ตรวจสอบงบการเงินของกองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Machine Learning Thai Equity (“กองทุน”) ซึ่งประกอบด้วย งบแสดงฐานะการเงิน และงบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน ณ วันที่ 30 พฤศจิกายน 2566 งบกำไรขาดทุนเบ็ดเสร็จ และงบแสดงการเปลี่ยนแปลงสินทรัพย์สุทธิ สำหรับปีสิ้นสุดวันเดียวกัน และหมายเหตุประกอบงบการเงินรวมถึงสรุปนโยบายการบัญชีที่สำคัญ

ข้าพเจ้าเห็นว่างบการเงินข้างต้นนี้แสดงฐานะการเงินของกองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Machine Learning Thai Equity ณ วันที่ 30 พฤศจิกายน 2566 ผลการดำเนินงาน และการเปลี่ยนแปลงสินทรัพย์สุทธิ สำหรับปีสิ้นสุดวันเดียวกัน โดยถูกต้องตามที่ควรในสาระสำคัญตามแนวปฏิบัติทางบัญชีว่าด้วยการบัญชีสำหรับกิจการที่ดำเนินธุรกิจเฉพาะด้านการลงทุนตามที่สมาคมบริษัทจัดการลงทุนกำหนด โดยได้รับความเห็นชอบจากสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

**เกณฑ์ในการแสดงความเห็น**

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

**ความรับผิดชอบของผู้บริหารกองทุนต่องบการเงิน**

ผู้บริหารกองทุนมีหน้าที่รับผิดชอบในการจัดทำและนำเสนองบการเงินเหล่านี้ โดยถูกต้องตามที่ควรตามแนวปฏิบัติทางบัญชีว่าด้วยการบัญชีสำหรับกิจการที่ดำเนินธุรกิจเฉพาะด้านการลงทุนตามที่สมาคมบริษัทจัดการลงทุนกำหนด โดยได้รับความเห็นชอบจากสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ และรับผิดชอบเกี่ยวกับการควบคุมภายในที่ผู้บริหารกองทุนพิจารณาว่าจำเป็นเพื่อให้สามารถจัดทำงบการเงินที่ปราศจากการแสดงข้อมูลที่ขัดต่อข้อเท็จจริงอันเป็นสาระสำคัญไม่ว่าจะเกิดจากการทุจริตหรือข้อผิดพลาด

ในการจัดทำงบการเงิน ผู้บริหารกองทุนรับผิดชอบในการประเมินความสามารถของกองทุนในการดำเนินงานต่อเนื่อง เปิดเผยเรื่องที่เกี่ยวข้องกับการดำเนินงานต่อเนื่อง (ตามความเหมาะสม) และการใช้เกณฑ์การบัญชีสำหรับการดำเนินงานต่อเนื่องเว้นแต่ผู้บริหารกองทุนมีความตั้งใจที่จะเลิกกองทุนหรือหยุดดำเนินงานหรือไม่สามารถดำเนินงานต่อเนื่องต่อไปได้

อ.พ.

## SP Audit Co., Ltd.

### ความรับผิดชอบของผู้สอบบัญชีต่อการตรวจสอบงบการเงิน

การตรวจสอบของข้าพเจ้ามีวัตถุประสงค์เพื่อให้ได้ความเชื่อมั่นอย่างสมเหตุสมผลว่างบการเงินโดยรวมปราศจากการแสดงข้อมูลที่ขัดต่อข้อเท็จจริงอันเป็นสาระสำคัญหรือไม่ ไม่ว่าจะเกิดจากการทุจริตหรือข้อผิดพลาด และเสนอรายงานของผู้สอบบัญชีซึ่งรวมความเห็นของข้าพเจ้าอยู่ด้วย ความเชื่อมั่นอย่างสมเหตุสมผลคือความเชื่อมั่นในระดับสูงแต่ไม่ได้เป็นการรับประกันว่าการปฏิบัติงานตรวจสอบตามมาตรฐานการสอบบัญชีจะสามารถตรวจพบข้อมูลที่ขัดต่อข้อเท็จจริงอันเป็นสาระสำคัญที่มีอยู่ได้เสมอไป ข้อมูลที่ขัดต่อข้อเท็จจริงอาจเกิดจากการทุจริตหรือข้อผิดพลาดและถือว่ามีสาระสำคัญเมื่อคาดการณ์ได้อย่างสมเหตุสมผลว่ารายการที่ขัดต่อข้อเท็จจริงแต่ละรายการหรือทุกรายการรวมกันจะมีผลต่อการตัดสินใจทางเศรษฐกิจของผู้ใช้งบการเงินจากการใช้งบการเงินเหล่านี้

ในการตรวจสอบของข้าพเจ้าตามมาตรฐานการสอบบัญชี ข้าพเจ้าได้ใช้ดุลยพินิจและการสังเกตและสงสัยของผู้ประกอบวิชาชีพตลอดการตรวจสอบ การปฏิบัติงานของข้าพเจ้ารวมถึง

- ระบุและประเมินความเสี่ยงจากการแสดงข้อมูลที่ขัดต่อข้อเท็จจริงอันเป็นสาระสำคัญในงบการเงิน ไม่ว่าจะเกิดจากการทุจริตหรือข้อผิดพลาด ออกแบบและปฏิบัติงานตามวิธีการตรวจสอบเพื่อตอบสนองต่อความเสี่ยงเหล่านั้น และได้หลักฐานการสอบบัญชีที่เพียงพอและเหมาะสมเพื่อเป็นเกณฑ์ในการแสดงความเห็นของข้าพเจ้า ความเสี่ยงที่ไม่พบข้อมูลที่ขัดต่อข้อเท็จจริงอันเป็นสาระสำคัญซึ่งเป็นผลมาจากการทุจริตจะสูงกว่าความเสี่ยงที่เกิดจากข้อผิดพลาด เนื่องจากการทุจริตอาจเกี่ยวกับการสมรู้ร่วมคิด การปลอมแปลงเอกสารหลักฐาน การตั้งใจละเว้นการแสดงผล การแสดงผลที่ไม่ตรงตามข้อเท็จจริงหรือการแทรกแซงการควบคุมภายใน
- ทำความเข้าใจในระบบการควบคุมภายในที่เกี่ยวข้องกับการตรวจสอบ เพื่อออกแบบวิธีการตรวจสอบที่เหมาะสมกับสถานการณ์ แต่ไม่ใช่เพื่อวัตถุประสงค์ในการแสดงความเห็นต่อความมีประสิทธิภาพของการควบคุมภายในของกองทุน
- ประเมินความเหมาะสมของนโยบายการบัญชีที่ผู้บริหารกองทุนใช้และความสมเหตุสมผลของประมาณการทางบัญชีและการเปิดเผยข้อมูลที่เกี่ยวข้องซึ่งจัดทำขึ้น โดยผู้บริหารกองทุน
- สรุปร่วมกับความเหมาะสมของการใช้เกณฑ์การบัญชีสำหรับการดำเนินงานต่อเนื่องของผู้บริหารกองทุนและจากหลักฐานการสอบบัญชีที่ได้รับ สรุปว่ามีความไม่แน่นอนที่มีสาระสำคัญเกี่ยวกับเหตุการณ์หรือสถานการณ์ที่อาจเป็นเหตุให้เกิดข้อสงสัยอย่างมีนัยสำคัญต่อความสามารถของกองทุนในการดำเนินงานต่อเนื่องหรือไม่ ถ้าข้าพเจ้าได้ข้อสรุปว่ามีความไม่แน่นอนที่มีสาระสำคัญ ข้าพเจ้าต้องกล่าวไว้ในรายงานของผู้สอบบัญชีของข้าพเจ้า โดยให้สังเกตถึงการเปิดเผยข้อมูลในงบการเงินที่เกี่ยวข้อง หรือถ้าการเปิดเผยข้อมูลดังกล่าวไม่เพียงพอความเห็นของข้าพเจ้าจะเปลี่ยนแปลงไป ข้อสรุปของข้าพเจ้าขึ้นอยู่กับหลักฐานการสอบบัญชีที่ได้รับจนถึงวันที่ในรายงานของผู้สอบบัญชีของข้าพเจ้า อย่างไรก็ตาม เหตุการณ์หรือสถานการณ์ในอนาคตอาจเป็นเหตุให้กองทุนต้องหยุดการดำเนินงานต่อเนื่อง
- ประเมินการนำเสนอ โครงสร้างและเนื้อหาของงบการเงิน โดยรวม รวมถึงการเปิดเผยข้อมูลว่างบการเงินแสดงรายการและเหตุการณ์ในรูปแบบที่ทำให้มีการนำเสนอข้อมูล โดยถูกต้องตามที่ควรหรือไม่

อนันต์

## SP Audit Co., Ltd.

---

ข้าพเจ้าได้สื่อสารกับผู้บริหารกองทุนในเรื่องต่าง ๆ ที่สำคัญ ซึ่งรวมถึงขอบเขตและช่วงเวลาของการตรวจสอบตามที่  
ได้วางแผนไว้ ประเด็นที่มีนัยสำคัญที่พบจากการตรวจสอบ รวมถึงข้อบกพร่องที่มีนัยสำคัญในระบบการควบคุมภายในหาก  
ข้าพเจ้าได้พบในระหว่างการตรวจสอบของข้าพเจ้า

บริษัท เอส พี ออดิท จำกัด



(นางสาวอมรรัตน์ เจือทองบริสุทธิ์)  
ผู้สอบบัญชีรับอนุญาตเลขที่ 10998

กรุงเทพมหานคร

วันที่ 28 ธันวาคม 2566

กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Machine Learning Thai Equity

งบแสดงฐานะการเงิน

ณ วันที่ 30 พฤศจิกายน 2566

(หน่วย : บาท)

	หมายเหตุ	2566	2565
<b>สินทรัพย์</b>			
เงินลงทุนแสดงด้วยมูลค่ายุติธรรม	4	405,430,815.12	611,978,049.86
เงินฝากธนาคาร	4	14,018,449.34	15,669,954.03
<b>ลูกหนี้</b>			
จากดอกเบี้ยและเงินปันผล	4	1,154,259.07	530,953.06
จากการขายเงินลงทุน		4,838,210.45	5,021,835.67
เงินวางประกันตามสัญญาซื้อขายตราสารอนุพันธ์	4	9,540,101.21	22,048,711.52
รวมสินทรัพย์		<u>434,981,835.19</u>	<u>655,249,504.14</u>
<b>หนี้สิน</b>			
<b>เจ้าหนี้</b>			
จากการซื้อเงินลงทุน	4	2,527,371.60	10,883,560.69
จากการรับซื้อคืนหน่วยลงทุน		2,472,375.86	425,914.28
ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย	4	494,909.17	637,502.55
ภาษีเงินได้ค้างจ่าย		28,715.11	5,922.97
หนี้สินอื่น		19,344.24	21,574.20
รวมหนี้สิน		<u>5,542,715.98</u>	<u>11,974,474.69</u>
<b>สินทรัพย์สุทธิ</b>		<u><u>429,439,119.21</u></u>	<u><u>643,275,029.45</u></u>
<b>สินทรัพย์สุทธิ:</b>			
ทุนที่ได้รับจากผู้ถือหน่วยลงทุน		466,831,696.92	608,927,380.94
กำไร(ขาดทุน)สะสม			
บัญชีปรับสมดุล		92,425,245.57	93,535,650.26
ขาดทุนสะสมจากการดำเนินงาน		(129,817,823.28)	(59,188,001.75)
<b>สินทรัพย์สุทธิ</b>		<u><u>429,439,119.21</u></u>	<u><u>643,275,029.45</u></u>

หมายเหตุประกอบงบการเงินเป็นส่วนหนึ่งของงบการเงินนี้

## กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Machine Learning Thai Equity

## งบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน

ณ วันที่ 30 พฤศจิกายน 2566

การแสดงรายละเอียดเงินลงทุนใช้การจัดกลุ่มตามประเภทของเงินลงทุนและอุตสาหกรรม

	วันครบ กำหนด	อัตรา ดอกเบี้ย (%)	จำนวน หน่วย (หน่วย)	มูลค่ายุติธรรม (บาท)	ร้อยละของ มูลค่าเงินลงทุน
<b>หลักทรัพย์จดทะเบียน</b>					
<b>หุ้นสามัญ</b>					
<b>ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย</b>					
<b>ธุรกิจการเกษตร</b>					
				<b>5,534,010.00</b>	<b>1.36</b>
บริษัท ศรีศรีรุ่งเอนโคโนอินดัสทรี จำกัด (มหาชน)			361,700	5,534,010.00	1.36
<b>ธนาคาร</b>					
				<b>62,999,955.00</b>	<b>15.54</b>
ธนาคารกรุงศรีอยุธยา จำกัด (มหาชน)			15,200	421,800.00	0.10
ธนาคารกรุงเทพ จำกัด (มหาชน)			48,100	7,263,100.00	1.79
ธนาคารกสิกรไทย จำกัด (มหาชน)			66,100	8,460,800.00	2.10
ธนาคารกรุงไทย จำกัด (มหาชน)			554,200	10,086,440.00	2.49
บริษัท เอสซีบี เอกซ์ จำกัด (มหาชน)			88,400	8,773,700.00	2.16
บริษัท ทุนธนาชาติ จำกัด (มหาชน)			275,700	13,233,600.00	3.26
บริษัท ทีเอสไอไฟแนนเชียลกรุ๊ป จำกัด (มหาชน)			84,700	8,237,075.00	2.03
ธนาคารทหารไทยธนชาติ จำกัด (มหาชน)			4,236,000	6,523,440.00	1.61
<b>พาณิชย์</b>					
				<b>4,881,530.00</b>	<b>1.20</b>
บริษัท เบอร์ลี่ ยุคเกอร์ จำกัด (มหาชน)			20,600	540,750.00	0.14
บริษัท คอมเซเว่น จำกัด (มหาชน)			52,200	1,195,380.00	0.29
บริษัท โฮม โปรดักส์ เซ็นเตอร์ จำกัด (มหาชน)			165,500	1,952,900.00	0.48
บริษัท เมก้า ไลฟ์ไชนเอนซ์ จำกัด (มหาชน)			30,000	1,192,500.00	0.29
<b>วัสดุก่อสร้าง</b>					
				<b>5,946,384.00</b>	<b>1.46</b>
บริษัท ไคนาสดี เซรามิค จำกัด (มหาชน)			956,200	1,501,234.00	0.37
บริษัท ปูนซิเมนต์ไทย จำกัด (มหาชน)			6,100	1,750,700.00	0.43
บริษัท ทิปก๊อส์เอสพีเอส จำกัด (มหาชน)			163,300	2,694,450.00	0.66
<b>ชิ้นส่วนอิเล็กทรอนิกส์</b>					
				<b>29,347,825.00</b>	<b>7.24</b>
บริษัท เอลต้า อิเล็กทรอนิกส์ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)			80,400	6,251,100.00	1.54
บริษัท ฮานา ไมโครอิเล็กทรอนิกส์ จำกัด (มหาชน)			211,100	9,446,725.00	2.33
บริษัท เคซีอี อิเล็กทรอนิกส์ จำกัด (มหาชน)			260,000	13,650,000.00	3.37
<b>พลังงานและสาธารณูปโภค</b>					
				<b>44,485,323.50</b>	<b>10.98</b>
บริษัท บางจาก คอร์ปอเรชั่น จำกัด (มหาชน)			185,200	8,056,200.00	1.99
บริษัท บี.กริม เพาเวอร์ จำกัด (มหาชน)			314,900	7,951,225.00	1.96
บริษัท กันกุลเอ็นจิเนียริ่ง จำกัด (มหาชน)			268,000	696,800.00	0.17
บริษัท ปตท. จำกัด (มหาชน)			128,100	4,451,475.00	1.10
บริษัท ปตท.สำรวจและผลิตปิโตรเลียม จำกัด (มหาชน)			107,900	16,346,850.00	4.03
บริษัท เอสพีซีจี จำกัด (มหาชน)			8,600	104,920.00	0.03

หมายเหตุประกอบงบการเงินเป็นส่วนหนึ่งของงบการเงินนี้

กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Machine Learning Thai Equity

งบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน

ณ วันที่ 30 พฤศจิกายน 2566

การแสดงรายละเอียดเงินลงทุนใช้การจัดกลุ่มตามประเภทของเงินลงทุนและอุตสาหกรรม

	วันครบกำหนด	อัตราดอกเบี้ย (%)	จำนวนหน่วย (หน่วย)	มูลค่ายุติธรรม (บาท)	ร้อยละของมูลค่าเงินลงทุน
บริษัท สตาร์ ปิโตรเลียม รีไฟน์นิ่ง จำกัด (มหาชน)			59,500	487,900.00	0.12
บริษัท ไทยออยล์ จำกัด (มหาชน)			68,949	3,550,873.50	0.88
บริษัท ทีทีดับบลิว จำกัด (มหาชน)			320,800	2,839,080.00	0.70
<b>เงินทุนและหลักทรัพย์</b>				<b>17,231,425.00</b>	<b>4.25</b>
บริษัทบริหารสินทรัพย์ กรุงเทพพาณิชย์ จำกัด (มหาชน)			511,700	4,221,525.00	1.04
บริษัท เมืองไทย แคปปิตอล จำกัด (มหาชน)			140,800	6,160,000.00	1.52
บริษัท ศรีสวัสดิ์ คอร์ปอเรชั่น จำกัด (มหาชน)			154,800	6,849,900.00	1.69
<b>อาหารและเครื่องดื่ม</b>				<b>34,500,355.00</b>	<b>8.50</b>
บริษัท คาราบาวกรุ๊ป จำกัด (มหาชน)			81,600	6,670,800.00	1.65
บริษัท อิชิตัน กรุ๊ป จำกัด (มหาชน)			755,000	10,796,500.00	2.66
บริษัท ไอ-เทล คอร์ปอเรชั่น จำกัด (มหาชน)			369,000	7,712,100.00	1.90
บริษัท เอ็มแมค เรสโตรองด์ กรุ๊ป จำกัด (มหาชน)			64,700	2,571,825.00	0.63
บริษัท โอสดสภา จำกัด (มหาชน)			209,700	4,802,130.00	1.18
บริษัท อาร์ แอนด์ บี ฟู้ด ซัพพลาย จำกัด (มหาชน)			147,500	1,947,000.00	0.48
<b>การแพทย์</b>				<b>41,771,662.00</b>	<b>10.30</b>
บริษัท บางกอก เซน ฮอสปิทอล จำกัด (มหาชน)			667,900	14,293,060.00	3.53
บริษัท กรุงเทพดุสิตเวชการ จำกัด (มหาชน)			365,200	9,586,500.00	2.36
บริษัท โรงพยาบาลบำรุงราษฎร์ จำกัด (มหาชน)			72,000	16,056,000.00	3.96
บริษัท โรงพยาบาลจุฬารัตน์ จำกัด (มหาชน)			651,100	1,836,102.00	0.45
<b>เทคโนโลยีสารสนเทศและการสื่อสาร</b>				<b>21,507,620.00</b>	<b>5.31</b>
บริษัท แอดวานซ์ อินโฟร์ เซอร์วิส จำกัด (มหาชน)			72,300	15,761,400.00	3.89
บริษัท ไทยคม จำกัด (มหาชน)			422,600	5,197,980.00	1.28
บริษัท ทู คอร์ปอเรชั่น จำกัด (มหาชน)			97,900	548,240.00	0.14
<b>ประกันภัยและประกันชีวิต</b>				<b>233,100.00</b>	<b>0.06</b>
บริษัท ทีคิวเอ็ม อัลฟา จำกัด (มหาชน)			8,400	233,100.00	0.06
<b>สื่อและสิ่งพิมพ์</b>				<b>1,523,875.00</b>	<b>0.38</b>
บริษัท แพลน บี มีเดีย จำกัด (มหาชน)			182,500	1,523,875.00	0.38
<b>ปิโตรเคมีและเคมีภัณฑ์</b>				<b>857,500.00</b>	<b>0.21</b>
บริษัท อินโดรามา เวนเจอร์ส จำกัด (มหาชน)			35,000	857,500.00	0.21
<b>พัฒนาอสังหาริมทรัพย์</b>				<b>45,841,719.00</b>	<b>11.31</b>
บริษัท อมตะ คอร์ปอเรชั่น จำกัด (มหาชน)			302,600	7,565,000.00	1.87
บริษัท เอที (ไทยแลนด์) จำกัด (มหาชน)			534,700	5,774,760.00	1.42

หมายเหตุประกอบงบการเงินเป็นส่วนหนึ่งของงบการเงินนี้



กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Machine Learning Thai Equity

งบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน

ณ วันที่ 30 พฤศจิกายน 2566

การแสดงรายละเอียดเงินลงทุนใช้การจัดกลุ่มตามประเภทของเงินลงทุนและอุตสาหกรรม

	วันครบ กำหนด	อัตรา ดอกเบี้ย (%)	จำนวน หน่วย (หน่วย)	มูลค่ายุติธรรม (บาท)	ร้อยละของ มูลค่าเงินลงทุน
บริษัท แลนด์แอนด์เฮาส์ จำกัด (มหาชน)			1,067,400	8,218,980.00	2.03
บริษัท พุกกษา โฮลดิ้ง จำกัด (มหาชน)			59,700	728,340.00	0.18
บริษัท ควอลิตี้เฮาส์ จำกัด (มหาชน)			1,850,700	3,997,512.00	0.99
บริษัท เอสซี แอสเสท คอร์ปอเรชั่น จำกัด (มหาชน)			385,800	1,188,264.00	0.29
บริษัท แสตนลิว จำกัด (มหาชน)			768,900	1,284,063.00	0.32
บริษัท สุภาลัย จำกัด (มหาชน)			120,500	2,120,800.00	0.52
บริษัท ดับบลิวเอชเอ คอร์ปอเรชั่น จำกัด (มหาชน)			2,992,800	14,964,000.00	3.69
<b>การท่องเที่ยวและสันทนาการ</b>				<b>14,121,325.00</b>	<b>3.49</b>
บริษัท ดี เอราวัณ กรุ๊ป จำกัด (มหาชน)			2,229,900	11,706,975.00	2.89
บริษัท ไมเนอร์ อินเตอร์เนชั่นแนล จำกัด (มหาชน)			88,600	2,414,350.00	0.60
<b>ขนส่งและโลจิสติกส์</b>				<b>13,268,200.00</b>	<b>3.28</b>
บริษัท ท่าอากาศยานไทย จำกัด (มหาชน)			124,400	7,401,800.00	1.83
บริษัท การบินกรุงเทพ จำกัด (มหาชน)			107,600	1,527,920.00	0.38
บริษัท ทางด่วนและรถไฟฟ้ากรุงเทพ จำกัด (มหาชน)			53,800	419,640.00	0.10
บริษัท ปริมา มารีน จำกัด (มหาชน)			768,400	3,918,840.00	0.97
<b>รวมหุ้นสามัญ</b>				<b>344,051,808.50</b>	<b>84.87</b>
<b>รวมหลักทรัพย์จดทะเบียน</b>				<b>344,051,808.50</b>	<b>84.87</b>
<b>หลักทรัพย์ไม่จดทะเบียน</b>					
<b>หุ้นสามัญ</b>					
<b>วัสดุก่อสร้าง</b>					
บริษัท เอสซีจี เกล็ดอร์ จำกัด (มหาชน)			896	10,304.00	-
<b>รวมหุ้นสามัญ</b>				<b>10,304.00</b>	<b>-</b>
<b>รวมหลักทรัพย์ไม่จดทะเบียน</b>				<b>10,304.00</b>	<b>-</b>
<b>ตราสารอนุพันธ์ทางการเงินจดทะเบียนในตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า</b>					
<b>สัญญาซื้อฟิวเจอร์</b>					
ดัชนี SET50 ครบกำหนดธันวาคม 2566 (S50Z23)			120	(2,231,074.40)	(0.55)
ดัชนี SET50 ครบกำหนดมีนาคม 2567 (S50H24)			120	(2,067,032.40)	(0.51)
ดัชนี SET50 ครบกำหนดมิถุนายน 2567 (S50M24)			100	(1,597,924.60)	(0.39)
ดัชนี SET50 ครบกำหนดกันยายน 2567 (S50U24)			70	(484,607.60)	(0.12)
<b>สัญญาขายฟิวเจอร์</b>					
Single Stock Futures ครบกำหนดธันวาคม 2566 (GULFZ23)			8	2,160.00	-
Single Stock Futures ครบกำหนดธันวาคม 2566 (PSLZ23)			68	(49,640.00)	(0.01)

หมายเหตุประกอบงบการเงินเป็นส่วนหนึ่งของการงบการเงินนี้

กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Machine Learning Thai Equity

งบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน

ณ วันที่ 30 พฤศจิกายน 2566

การแสดงรายละเอียดเงินลงทุนใช้การจัดกลุ่มตามประเภทของเงินลงทุนและอุตสาหกรรม

	วันครบ กำหนด	อัตรา ดอกเบี้ย (%)	จำนวน หน่วย (หน่วย)	มูลค่ายุติธรรม (บาท)	ร้อยละของ มูลค่าเงินลงทุน
Single Stock Futures ครบกำหนดธันวาคม 2566 (SGPZ23)			20	(8,368.00)	-
Single Stock Futures ครบกำหนดธันวาคม 2566 (STGTZ23)			101	(23,856.20)	(0.01)
Single Stock Futures ครบกำหนดธันวาคม 2566 (SUPERZ23)			1,324	(28,416.00)	(0.01)
<b>รวมตราสารอนุพันธ์ทางการเงินจดทะเบียนในตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า</b>				<b>(6,488,759.20)</b>	<b>(1.60)</b>
<b>พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย</b>					
CB24104A	4 ม.ค. 67	-	18,000	17,966,528.10	4.43
CB24125A	25 ม.ค. 67	-	16,000	15,944,980.32	3.93
CB24201A	1 ก.พ. 67	-	16,000	15,939,884.48	3.93
CBF24409A	9 เม.ย. 67	THOR + 0.05%	8,000	8,003,667.92	1.97
CBF24610A	10 มิ.ย. 67	THOR + 0.05%	10,000	10,002,401.00	2.47
<b>รวมพันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย</b>				<b>67,857,461.82</b>	<b>16.73</b>
<b>รวมเงินลงทุน</b>				<b>405,430,815.12</b>	<b>100.00</b>

หมายเหตุประกอบงบการเงินเป็นส่วนหนึ่งของงบการเงินนี้

กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Machine Learning Thai Equity

งบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน

ณ วันที่ 30 พฤศจิกายน 2565

การแสดงรายละเอียดเงินลงทุนใช้การจัดกลุ่มตามประเภทของเงินลงทุนและอุตสาหกรรม

	วันครบ กำหนด	อัตรา ดอกเบี้ย (%)	จำนวน หน่วย (หน่วย)	มูลค่ายุติธรรม (บาท)	ร้อยละของ มูลค่าเงินลงทุน
<b>หลักทรัพย์จดทะเบียน</b>					
<b>หุ้นสามัญ</b>					
<b>ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย</b>					
<b>ธุรกิจการเกษตร</b>				<b>709,920.00</b>	<b>0.12</b>
บริษัท จีเอฟพีที จำกัด (มหาชน)			52,200	709,920.00	0.12
<b>ยานยนต์</b>				<b>936,900.00</b>	<b>0.15</b>
บริษัท อ่าปีโก ไฮเทค จำกัด (มหาชน)			9,000	310,500.00	0.05
บริษัท สมบูรณ์ แอ็ดวานซ์ เทคโนโลยี จำกัด (มหาชน)			14,100	310,200.00	0.05
บริษัท ไทยสแตนเลย์การไฟฟ้า จำกัด (มหาชน)			1,700	316,200.00	0.05
<b>ธนาคาร</b>				<b>71,551,720.00</b>	<b>11.69</b>
ธนาคารกรุงเทพ จำกัด (มหาชน)			95,800	13,795,200.00	2.25
ธนาคารเกียรตินาคินภัทร จำกัด (มหาชน)			75,100	5,369,650.00	0.88
ธนาคารกรุงไทย จำกัด (มหาชน)			1,856,400	32,672,640.00	5.34
บริษัท เอสซีบี เอกซ์ จำกัด (มหาชน)			71,100	7,465,500.00	1.22
บริษัท ทูชนชาติ จำกัด (มหาชน)			19,000	802,750.00	0.13
ธนาคารทหารไทยชนชาติ จำกัด (มหาชน)			8,175,700	11,445,980.00	1.87
<b>พาณิชย์</b>				<b>47,752,335.00</b>	<b>7.80</b>
บริษัท เบอร์ลี ยูคเกอร์ จำกัด (มหาชน)			97,800	3,349,650.00	0.55
บริษัท คอมเซเว่น จำกัด (มหาชน)			26,700	847,725.00	0.14
บริษัท ซีพี ออลล์ จำกัด (มหาชน)			113,000	7,345,000.00	1.20
บริษัท เซ็นทรัล รีเทล คอร์ปอเรชั่น จำกัด (มหาชน)			585,000	25,155,000.00	4.10
บริษัท สยามโกลบอลเฮ้าส์ จำกัด (มหาชน)			36,900	738,000.00	0.12
บริษัท โฮม โปรดักส์ เซ็นเตอร์ จำกัด (มหาชน)			353,000	5,189,100.00	0.85
บริษัท คาร์มาร์ท จำกัด (มหาชน)			44,400	344,100.00	0.06
บริษัท สยามแม็คโคร จำกัด (มหาชน)			63,236	2,450,395.00	0.40
บริษัท แม็คกรุ๊ป จำกัด (มหาชน)			32,200	322,000.00	0.05
บริษัท เมก้า ไลฟ์ไชนเอนซ์ จำกัด (มหาชน)			18,300	855,525.00	0.14
บริษัท สบาย เทคโนโลยี จำกัด (มหาชน)			103,200	1,155,840.00	0.19
<b>วัสดุก่อสร้าง</b>				<b>14,781,569.00</b>	<b>2.41</b>
บริษัท ปูนซีเมนต์นครหลวง จำกัด (มหาชน)			11,500	1,725,000.00	0.28
บริษัท ทีพีโอ โพลีน จำกัด (มหาชน)			6,835,900	13,056,569.00	2.13
<b>บริการรับเหมาก่อสร้าง</b>				<b>941,070.00</b>	<b>0.15</b>
บริษัท ช.การช่าง จำกัด (มหาชน)			38,100	941,070.00	0.15

หมายเหตุประกอบงบการเงินเป็นส่วนหนึ่งของงบการเงินนี้

กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Machine Learning Thai Equity

งบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน

ณ วันที่ 30 พฤศจิกายน 2565

การแสดงรายละเอียดเงินลงทุนใช้การจัดกลุ่มตามประเภทของเงินลงทุนและอุตสาหกรรม

	วันครบ กำหนด	อัตรา ดอกเบี้ย (%)	จำนวน หน่วย (หน่วย)	มูลค่ายุติธรรม (บาท)	ร้อยละของ มูลค่าเงินลงทุน
<b>จีนส่วนอิเล็กทรอนิกส์</b>				<b>37,174,350.00</b>	<b>6.08</b>
บริษัท เกลต้า อิเล็กทรอนิกส์ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)			46,300	31,113,600.00	5.08
บริษัท ฮานา ไมโครอิเล็กทรอนิกส์ จำกัด (มหาชน)			59,000	3,053,250.00	0.50
บริษัท เคซีอี อิเล็กทรอนิกส์ จำกัด (มหาชน)			26,100	1,259,325.00	0.21
บริษัท เอสวีไอ จำกัด (มหาชน)			179,300	1,748,175.00	0.29
<b>พลังงานและสาธารณูปโภค</b>				<b>66,625,923.00</b>	<b>10.88</b>
บริษัท บ้านปู จำกัด (มหาชน)			272,900	3,574,990.00	0.58
บริษัท บางจาก คอร์ปอเรชั่น จำกัด (มหาชน)			73,200	2,342,400.00	0.38
บริษัท ซีเตค พาวเวอร์ จำกัด (มหาชน)			95,900	467,992.00	0.08
บริษัท พลังงานบริสุทธิ์ จำกัด (มหาชน)			153,000	14,802,750.00	2.42
บริษัท ผลิตไฟฟ้า จำกัด (มหาชน)			3,800	651,700.00	0.11
บริษัท เอสโซ่ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)			818,600	9,905,060.00	1.62
บริษัท โกลบอล เพาเวอร์ ซินเนอร์ยี จำกัด (มหาชน)			7,900	549,050.00	0.09
บริษัท กัลฟ์ เอ็นเนอร์จี ดีเวลลอปเม้นท์ จำกัด (มหาชน)			37,680	1,997,040.00	0.33
บริษัท ปตท. จำกัด (มหาชน)			96,100	3,195,325.00	0.52
บริษัท ปตท. สำรวจและผลิตปิโตรเลียม จำกัด (มหาชน)			60,700	11,411,600.00	1.86
บริษัท ราช กรุ๊ป จำกัด (มหาชน)			211,600	8,675,600.00	1.42
บริษัท เอสพีซีจี จำกัด (มหาชน)			30,800	446,600.00	0.07
บริษัท สตาร์ ปิโตรเลียม รีไฟน์นิ่ง จำกัด (มหาชน)			169,900	1,970,840.00	0.32
บริษัท ชัสโก้ จำกัด (มหาชน)			74,900	328,062.00	0.05
บริษัท ไทยออยล์ จำกัด (มหาชน)			44,902	2,492,061.00	0.41
บริษัท ทีพีโอ โพลีน เพาเวอร์ จำกัด (มหาชน)			205,100	672,728.00	0.11
บริษัท ทีทีดับบลิว จำกัด (มหาชน)			359,100	3,142,125.00	0.51
<b>เงินทุนและหลักทรัพย์</b>				<b>7,592,700.00</b>	<b>1.25</b>
บริษัท อีออน ธนสินทรัพย์ (ไทยแลนด์) จำกัด (มหาชน)			12,400	1,990,200.00	0.33
บริษัทบริหารสินทรัพย์ กรุงเทพพาณิชย์ จำกัด (มหาชน)			373,500	5,602,500.00	0.92
<b>อาหารและเครื่องดื่ม</b>				<b>38,163,907.00</b>	<b>6.24</b>
บริษัท คาราบาวกรุ๊ป จำกัด (มหาชน)			9,200	878,600.00	0.14
บริษัท เจริญโภคภัณฑ์อาหาร จำกัด (มหาชน)			78,500	1,876,150.00	0.31
บริษัท อิชิตัน กรุ๊ป จำกัด (มหาชน)			825,000	9,735,000.00	1.59
บริษัท น้ำตาลขอนแก่น จำกัด (มหาชน)			643,400	2,432,052.00	0.40
บริษัท เอ็มเค เรสโตรองด์ กรุ๊ป จำกัด (มหาชน)			130,100	7,318,125.00	1.20

หมายเหตุประกอบงบการเงินเป็นส่วนหนึ่งของงบการเงินนี้

กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Machine Learning Thai Equity

งบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน

ณ วันที่ 30 พฤศจิกายน 2565

การแสดงรายละเอียดเงินลงทุนใช้การจัดกลุ่มตามประเภทของเงินลงทุนและอุตสาหกรรม

	วันครบ กำหนด	อัตรา ดอกเบี้ย (%)	จำนวน หน่วย (หน่วย)	มูลค่ายุติธรรม (บาท)	ร้อยละของ มูลค่าเงินลงทุน
บริษัท พรีเมียร์ มาร์เก็ตติ้ง จำกัด (มหาชน)			32,000	310,400.00	0.05
บริษัท เช็ปปี้ จำกัด (มหาชน)			8,700	337,125.00	0.06
บริษัท ศรีนาราพร มาร์เก็ตติ้ง จำกัด (มหาชน)			360,000	7,416,000.00	1.21
บริษัท ไทยฟู้ดส์ กรุ๊ป จำกัด (มหาชน)			457,900	2,495,555.00	0.41
บริษัท ไทยยูเนี่ยน กรุ๊ป จำกัด (มหาชน)			133,700	2,286,270.00	0.37
บริษัท น้ำมันพืชไทย จำกัด (มหาชน)			97,560	2,756,070.00	0.45
บริษัท เซ็น คอร์ปอเรชั่น กรุ๊ป จำกัด (มหาชน)			19,200	322,560.00	0.05
<b>การแพทย์</b>				<b>58,061,776.00</b>	<b>9.47</b>
บริษัท กรุงเทพดุสิตเวชการ จำกัด (มหาชน)			895,200	27,079,800.00	4.42
บริษัท โรงพยาบาลบำรุงราษฎร์ จำกัด (มหาชน)			113,900	25,855,300.00	4.22
บริษัท เอกชัยการแพทย์ จำกัด (มหาชน)			38,300	321,720.00	0.05
บริษัท โรงพยาบาลพระรามเก้า จำกัด (มหาชน)			11,500	201,250.00	0.03
บริษัท ธนบุรี เฮลท์แคร์ กรุ๊ป จำกัด (มหาชน)			3,100	196,850.00	0.03
บริษัท โรงพยาบาลวิภาวดี จำกัด (มหาชน)			1,585,200	4,406,856.00	0.72
<b>เทคโนโลยีสารสนเทศและการสื่อสาร</b>				<b>4,108,770.00</b>	<b>0.67</b>
บริษัท แอดวานซ์ อินโฟร์ เซอร์วิส จำกัด (มหาชน)			12,700	2,400,300.00	0.39
บริษัท ฟอร์ท คอร์ปอเรชั่น จำกัด (มหาชน)			11,500	419,750.00	0.07
บริษัท ซินเน็ค (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)			72,400	1,288,720.00	0.21
<b>ประกันภัยและประกันชีวิต</b>				<b>4,863,250.00</b>	<b>0.80</b>
บริษัท กรุงเทพประกันชีวิต จำกัด (มหาชน)			52,500	1,561,875.00	0.26
บริษัท ไทยประกันชีวิต จำกัด (มหาชน)			200,200	3,003,000.00	0.49
บริษัท ทีคิวเอ็ม อัลฟา จำกัด (มหาชน)			7,700	298,375.00	0.05
<b>สื่อและสิ่งพิมพ์</b>				<b>5,497,020.00</b>	<b>0.90</b>
บริษัท บีอีซี เวิลด์ จำกัด (มหาชน)			125,700	1,319,850.00	0.22
บริษัท แพลน บี มีเดีย จำกัด (มหาชน)			515,700	4,177,170.00	0.68
<b>บรรจุภัณฑ์</b>				<b>2,238,600.00</b>	<b>0.37</b>
บริษัท โพลีเพ็คซ์ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)			91,000	2,238,600.00	0.37
<b>ของใช้ส่วนตัวและเวชภัณฑ์</b>				<b>328,520.00</b>	<b>0.05</b>
บริษัท ไทยออปติคอลล กรุ๊ป จำกัด (มหาชน)			34,400	328,520.00	0.05
<b>พัฒนาอสังหาริมทรัพย์</b>				<b>114,466,389.00</b>	<b>18.71</b>
บริษัท อมตะ คอร์ปอเรชั่น จำกัด (มหาชน)			14,200	275,480.00	0.05
บริษัท เอพี (ไทยแลนด์) จำกัด (มหาชน)			353,400	3,569,340.00	0.58
บริษัท แอสเสท เวิร์ด คอร์ป จำกัด (มหาชน)			3,644,100	22,957,830.00	3.75

หมายเหตุประกอบงบการเงินเป็นส่วนหนึ่งของงบการเงินนี้

กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Machine Learning Thai Equity

งบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน

ณ วันที่ 30 พฤศจิกายน 2565

การแสดงรายละเอียดเงินลงทุนใช้การจัดกลุ่มตามประเภทของเงินลงทุนและอุตสาหกรรม

	วันครบ กำหนด	อัตรา ดอกเบี้ย (%)	จำนวน หน่วย (หน่วย)	มูลค่าสุทธิรวม (บาท)	ร้อยละของ มูลค่าเงินลงทุน
บริษัท เซ็นทรัลพัฒนา จำกัด (มหาชน)			446,800	32,393,000.00	5.29
บริษัท แลนด์แอนด์เฮาส์ จำกัด (มหาชน)			583,300	5,599,680.00	0.92
บริษัท เอ็ม บี เค จำกัด (มหาชน)			7,200	133,200.00	0.02
บริษัท ควอลิตี้เฮาส์ จำกัด (มหาชน)			650,600	1,444,332.00	0.24
บริษัท เอสซี แอสเสท คอร์ปอเรชั่น จำกัด (มหาชน)			524,800	2,162,176.00	0.35
บริษัท แสนสิริ จำกัด (มหาชน)			15,331,100	24,069,827.00	3.93
บริษัท สุภาลัย จำกัด (มหาชน)			249,100	5,729,300.00	0.94
บริษัท ดับบลิวเอชเอ คอร์ปอเรชั่น จำกัด (มหาชน)			4,201,100	16,132,224.00	2.64
<b>การท่องเที่ยวและสันทนาการ</b>				<b>8,850,804.00</b>	<b>1.45</b>
บริษัท โรงแรมเซ็นทรัลพลาซา จำกัด (มหาชน)			25,900	1,282,050.00	0.21
บริษัท ดี เอร่าวัน กรุ๊ป จำกัด (มหาชน)			481,600	2,138,304.00	0.35
บริษัท ไมเนอร์ อินเตอร์เนชั่นแนล จำกัด (มหาชน)			176,600	5,430,450.00	0.89
<b>ขนส่งและโลจิสติกส์</b>				<b>46,606,470.00</b>	<b>7.61</b>
บริษัท ท่าอากาศยานไทย จำกัด (มหาชน)			517,800	38,835,000.00	6.35
บริษัท การบินกรุงเทพ จำกัด (มหาชน)			27,900	373,860.00	0.06
บริษัท เจดับเบิลยูดี อินโฟโลจิสติกส์ จำกัด (มหาชน)			15,600	324,480.00	0.05
บริษัท พรินา มารีน จำกัด (มหาชน)			875,800	6,437,130.00	1.05
บริษัท อาร์ ซี แอล จำกัด (มหาชน)			21,200	636,000.00	0.10
<b>รวมหุ้นสามัญ</b>				<b>531,251,993.00</b>	<b>86.80</b>
<b>รวมหลักทรัพย์จดทะเบียน</b>				<b>531,251,993.00</b>	<b>86.80</b>
<b>หลักทรัพย์ไม่จดทะเบียน</b>					
<b>หุ้นสามัญ</b>					
<b>อาหารและเครื่องดื่ม</b>					
บริษัท ไอ-เทล คอร์ปอเรชั่น จำกัด (มหาชน)			116,998	3,743,936.00	0.61
<b>รวมหุ้นสามัญ</b>				<b>3,743,936.00</b>	<b>0.61</b>
<b>รวมหลักทรัพย์ไม่จดทะเบียน</b>				<b>3,743,936.00</b>	<b>0.61</b>
<b>ตราสารอนุพันธ์ทางการเงินจดทะเบียนในตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า</b>					
<b>สัญญาซื้อขายฟิวเจอร์</b>					
ดัชนี SET50 ครบกำหนดธันวาคม 2565 (S50Z22)			500	4,265,207.28	0.70
ดัชนี SET50 ครบกำหนดมีนาคม 2566 (S50H23)			130	465,057.26	0.08
ดัชนี SET50 ครบกำหนดมิถุนายน 2566 (S50M23)			10	10,317.20	-
ดัชนี SET50 ครบกำหนดกันยายน 2566 (S50U23)			10	28,302.80	-

หมายเหตุประกอบงบการเงินเป็นส่วนหนึ่งของงบการเงินนี้

กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Machine Learning Thai Equity

งบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน

ณ วันที่ 30 พฤศจิกายน 2565

การแสดงรายละเอียดเงินลงทุนใช้การจัดกลุ่มตามประเภทของเงินลงทุนและอุตสาหกรรม

	วันครบ กำหนด	อัตรา ดอกเบี้ย (%)	จำนวน หน่วย (หน่วย)	มูลค่าสุทธิ บาท	ร้อยละของ มูลค่าเงินลงทุน
<b>สัญญาขายฟิวเจอร์</b>					
Single Stock Futures ครบกำหนด ธันวาคม 2565 (BCHZ22)			10	(18,000.00)	-
Single Stock Futures ครบกำหนด ธันวาคม 2565 (BJCZ22)			26	22,739.60	-
Single Stock Futures ครบกำหนด ธันวาคม 2565 (CKZ22)			14	(59,522.40)	(0.01)
Single Stock Futures ครบกำหนด ธันวาคม 2565 (DTACZ22)			10	32,500.00	0.01
Single Stock Futures ครบกำหนด ธันวาคม 2565 (EAZ22)			3	(15,000.00)	-
Single Stock Futures ครบกำหนด ธันวาคม 2565 (GPSCZ22)			3	(12,720.00)	-
Single Stock Futures ครบกำหนด ธันวาคม 2565 (IRPCZ22)			102	67,320.00	0.01
Single Stock Futures ครบกำหนด ธันวาคม 2565 (KCEZ22)			3	8,400.00	-
Single Stock Futures ครบกำหนด ธันวาคม 2565 (KEXZ22)			20	40,800.00	0.01
Single Stock Futures ครบกำหนด ธันวาคม 2565 (ORZ22)			36	58,482.00	0.01
Single Stock Futures ครบกำหนด ธันวาคม 2565 (PTTGCZ22)			7	7,070.00	-
Single Stock Futures ครบกำหนด ธันวาคม 2565 (SCBZ22)			4	15,000.00	-
Single Stock Futures ครบกำหนด ธันวาคม 2565 (SCCZ22)			3	127,500.00	0.02
Single Stock Futures ครบกำหนด ธันวาคม 2565 (SCGPZ22)			3	(780.00)	-
Single Stock Futures ครบกำหนด ธันวาคม 2565 (STGTZ22)			25	53,800.00	0.01
Single Stock Futures ครบกำหนด ธันวาคม 2565 (SUPERZ22)			135	37,570.50	0.01
Single Stock Futures ครบกำหนด ธันวาคม 2565 (TASCOZ22)			15	(26,850.00)	-
Single Stock Futures ครบกำหนด ธันวาคม 2565 (TRUEZ22)			76	(2,363.60)	-
<b>รวมตราสารอนุพันธ์ทางการเงินจดทะเบียนในตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า</b>				<b>5,104,830.64</b>	<b>0.85</b>
<b>พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย</b>					
CB22D15A	15 ธ.ค. 65	-	4,000	3,998,849.64	0.65
CB23105B	5 ม.ค. 66	-	1,000	999,070.73	0.16
CB23202B	2 ก.พ. 66	-	67,000	66,879,369.85	10.93
<b>รวมพันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย</b>				<b>71,877,290.22</b>	<b>11.74</b>
<b>รวมเงินลงทุน</b>				<b>611,978,049.86</b>	<b>100.00</b>

หมายเหตุประกอบงบการเงินเป็นส่วนหนึ่งของงบการเงินนี้

กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Machine Learning Thai Equity

งบกำไรขาดทุนเบ็ดเสร็จ

สำหรับปีสิ้นสุดวันที่ 30 พฤศจิกายน 2566

(หน่วย : บาท)

	หมายเหตุ	2566	2565
<b>รายได้</b>			
รายได้เงินปันผล	4	14,511,263.59	17,127,697.81
รายได้ดอกเบี้ย	4	1,500,914.90	717,511.59
รวมรายได้		16,012,178.49	17,845,209.40
<b>ค่าใช้จ่าย</b>			
ค่าธรรมเนียมการจัดการ	4	5,930,272.89	7,161,762.44
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์		151,166.18	183,195.10
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน	4	372,542.83	446,996.09
ค่าธรรมเนียมวิชาชีพ		45,000.00	45,000.00
ค่าใช้จ่ายอื่น	4	1,453,673.05	2,243,701.78
รวมค่าใช้จ่าย		7,952,654.95	10,080,655.41
รายได้สุทธิ		8,059,523.54	7,764,553.99
<b>รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิจากเงินลงทุน</b>			
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิที่เกิดขึ้นจากเงินลงทุน		(15,561,905.22)	1,004,056.78
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิตั้งแต่ยังไม่เกิดขึ้นจากเงินลงทุน		(63,068,752.62)	38,752,215.31
รวมรายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิจากเงินลงทุนที่เกิดขึ้นและที่ยังไม่เกิดขึ้น		(78,630,657.84)	39,756,272.09
<b>การเพิ่มขึ้น(ลดลง)ในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงานก่อนหักภาษีเงินได้</b>			
หัก : ภาษีเงินได้		58,687.23	10,093.19
การเพิ่มขึ้น(ลดลง)ในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงานหลังหักภาษีเงินได้		(70,629,821.53)	47,510,732.89

หมายเหตุประกอบงบการเงินเป็นส่วนหนึ่งของงบการเงินนี้



กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Machine Learning Thai Equity

งบแสดงการเปลี่ยนแปลงสินทรัพย์สุทธิ

สำหรับปีสิ้นสุดวันที่ 30 พฤศจิกายน 2566

(หน่วย : บาท)

	2566	2565
การเพิ่มขึ้น(ลดลง)สุทธิของสินทรัพย์สุทธิจาก		
การดำเนินงาน	(70,629,821.53)	47,510,732.89
การเพิ่มขึ้นของทุนที่ได้รับจากผู้ถือหน่วยลงทุนในระหว่างปี	177,724,765.08	208,527,423.18
การลดลงของทุนที่ได้รับจากผู้ถือหน่วยลงทุนในระหว่างปี	(320,930,853.79)	(294,597,818.25)
การลดลงของสินทรัพย์สุทธิในระหว่างปี	(213,835,910.24)	(38,559,662.18)
สินทรัพย์สุทธิ ณ วันต้นปี	643,275,029.45	681,834,691.63
สินทรัพย์สุทธิ ณ วันปลายปี	429,439,119.21	643,275,029.45

(หน่วย : หน่วย)

การเปลี่ยนแปลงของจำนวนหน่วยลงทุน

(มูลค่าหน่วยละ 10 บาท)

หน่วยลงทุน ณ วันต้นปี

60,892,738.0939

69,030,938.6354

บวก : หน่วยลงทุนที่ขายในระหว่างปี

17,405,486.8973

20,010,854.5074

หัก : หน่วยลงทุนที่รับซื้อคืนในระหว่างปี

(31,615,055.2975)

(28,149,055.0489)

หน่วยลงทุน ณ วันปลายปี

46,683,169.6937

60,892,738.0939

หมายเหตุประกอบงบการเงินเป็นส่วนหนึ่งของงบการเงินนี้

## กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Machine Learning Thai Equity

### หมายเหตุประกอบงบการเงิน

สำหรับปีสิ้นสุดวันที่ 30 พฤศจิกายน 2566

#### 1. ลักษณะของกองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Machine Learning Thai Equity

กองทุนเปิดไทยพาณิชย์ Machine Learning Thai Equity (“กองทุน”) ได้จดทะเบียนกับสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ (“ก.ล.ต.”) เมื่อวันที่ 6 ธันวาคม 2560 มีเงินทุนจดทะเบียน 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           เหมาะสำหรับผู้ลงทุนที่ต้องการรับผลตอบแทนจากการขายคืนหน่วยลงทุน โดยอัตโนมัติ
- ชนิดจ่ายเงินปันผล                   เหมาะสำหรับผู้ลงทุนที่ต้องการรับผลตอบแทนจากเงินปันผล
- ชนิดผู้ลงทุนกลุ่ม/บุคคล           เหมาะสำหรับผู้ลงทุนประเภทบุคคล กลุ่มบุคคล นิติบุคคล สถาบันที่บริษัทจัดการกำหนด  
ที่ต้องการสะสมผลประโยชน์จากการลงทุน
- ชนิดช่องทางอิเล็กทรอนิกส์       เหมาะสำหรับผู้ลงทุนที่ทำรายการผ่านช่องทางอิเล็กทรอนิกส์
- ชนิดเพื่อการออม                    เหมาะสำหรับผู้ลงทุนที่ต้องการออมเงินระยะยาวและได้รับสิทธิประโยชน์ทางภาษี
- ชนิดเพื่อการออมผ่านช่องทางอิเล็กทรอนิกส์   เหมาะสำหรับผู้ลงทุนที่ต้องการออมเงินระยะยาวและได้รับสิทธิประโยชน์ทางภาษีที่ทำ  
รายการผ่านช่องทางอิเล็กทรอนิกส์
- ชนิดควบประกัน                      เหมาะสำหรับผู้ลงทุนที่ต้องการได้รับความคุ้มครองจากบริษัทประกัน

ปัจจุบันบริษัทจัดการเปิดให้บริการหน่วยลงทุนชนิดสะสมมูลค่า ชนิดผู้ลงทุนกลุ่ม/บุคคล ชนิดช่องทางอิเล็กทรอนิกส์ ชนิดเพื่อการออม และชนิดเพื่อการออมผ่านช่องทางอิเล็กทรอนิกส์

กองทุนเป็นกองทุนรวมประเภทรับซื้อคืนหน่วยลงทุน ไม่กำหนดระยะเวลาสิ้นสุดของโครงการ กองทุนมีนโยบายการลงทุนในตราสารแห่งทุนของบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย และ/หรือตลาดหลักทรัพย์เอ็ม เอ ไอ โดยมีมูลค่าการลงทุนสุทธิในตราสารดังกล่าวโดยเฉลี่ยรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน กองทุนมีเป้าหมายในการลงทุนให้ผลประกอบการ สูงกว่าดัชนีชี้วัด (Active Management) โดยใช้การวิเคราะห์เชิงปริมาณ (Quantitative Analysis) ซึ่งมีการใช้เทคนิคทาง Machine Learning มาประกอบการคัดเลือกหลักทรัพย์ในการลงทุนผ่านระบบที่พัฒนาขึ้นโดยบริษัทจัดการ ส่วนที่เหลืออาจลงทุนในตราสารแห่งทุนนอกเหนือจากที่กล่าวข้างต้นและ/หรือตราสารแห่งหนี้ และ/หรือเงินฝาก ตลอดจนหลักทรัพย์ หรือหลักทรัพย์อื่น เช่น กองทุนรวมอสังหาริมทรัพย์ หน่วยทรัสต์เพื่อการลงทุนใน

อสังหาริมทรัพย์ (REITs) กองทุนรวมโครงสร้างพื้นฐาน (IFF) และ/หรือกองทุนอีทีเอฟ (ETF) เป็นต้น หรือการหาออกผลโดยวิธีอื่นตามที่สำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ต. กำหนดหรือให้ความเห็นชอบ

กองทุนมีนโยบายจ่ายเงินปันผลตามหลักเกณฑ์และวิธีการที่กำหนดในหนังสือชี้ชวน

## 2. เกณฑ์การจัดทำงบการเงิน

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

งบการเงินฉบับภาษาอังกฤษจัดทำขึ้นจากงบการเงินตามกฎหมายที่เป็นภาษาไทย ในกรณีที่มีความหมายขัดแย้งกันหรือ มีความแตกต่างในการตีความระหว่างสองภาษา ให้ใช้งบการเงินตามกฎหมายฉบับภาษาไทยเป็นหลัก

## 3. สรุปนโยบายการบัญชีที่สำคัญ

### 3.1 เครื่องมือทางการเงิน

สินทรัพย์ทางการเงินและหนี้สินทางการเงิน

*การรับรู้รายการและการวัดมูลค่าเมื่อเริ่มแรก*

กองทุนรับรู้รายการเมื่อเริ่มแรกของสินทรัพย์และหนี้สินทางการเงินจะรับรู้ในวันที่มีการตกลงกัน (Trade date) คือวันที่กองทุนมีข้อผูกมัดที่จะซื้อหรือขายเงินลงทุน

กองทุนจะรับรู้รายการเมื่อเริ่มแรกของสินทรัพย์และหนี้สินทางการเงินด้วยมูลค่ายุติธรรม โดยต้นทุนในการทำรายการซึ่งเกี่ยวข้องกับได้มาของสินทรัพย์และหนี้สินทางการเงินที่แสดงด้วยมูลค่ายุติธรรมจะรับรู้เป็นค่าใช้จ่ายทันทีเมื่อเกิดขึ้น

*การจัดประเภทรายการและการวัดมูลค่าในภายหลัง*

สินทรัพย์ทางการเงินทั้งหมดจะจัดประเภทเป็นสินทรัพย์ทางการเงินที่วัดมูลค่าภายหลังด้วยมูลค่ายุติธรรม

หนี้สินทางการเงินทั้งหมดจะจัดประเภทเป็นหนี้สินทางการเงินที่วัดมูลค่าภายหลังด้วยราคาทุนตัดจำหน่าย ยกเว้นหนี้สินอนุพันธ์จะต้องวัดมูลค่าภายหลังด้วยมูลค่ายุติธรรม

กำไรหรือขาดทุนจากการเปลี่ยนแปลงในมูลค่ายุติธรรมในภายหลังของสินทรัพย์ทางการเงินหรือหนี้สินทางการเงินที่วัดมูลค่าภายหลังด้วยมูลค่ายุติธรรมจะรับรู้ในงบกำไรขาดทุนเบ็ดเสร็จ

### การตัดรายการ

กองทุนตัดรายการสินทรัพย์ทางการเงิน เฉพาะเมื่อสิทธิตามสัญญาที่จะได้รับกระแสเงินสดจากสินทรัพย์ทางการเงินหมดอายุ หรือเมื่อโอนสินทรัพย์ทางการเงินและโอนความเสี่ยงและผลตอบแทนของความเป็นเจ้าของเกือบทั้งหมดของสินทรัพย์ให้กิจการอื่น

ณ วันที่ตัดรายการสินทรัพย์ทางการเงิน กองทุนต้องรับรู้ผลต่างระหว่างมูลค่าตามบัญชีของสินทรัพย์และผลรวมของสิ่งตอบแทนที่คาดว่าจะได้รับและค้างรับในงบกำไรขาดทุนเบ็ดเสร็จ

กองทุนตัดรายการหนี้สินทางการเงิน เมื่อภาระผูกพันที่ระบุไว้ในสัญญาได้มีการปฏิบัติตามแล้ว ได้มีการยกเลิก หรือสิ้นสุด

ณ วันที่ตัดรายการหนี้สินทางการเงิน กองทุนต้องรับรู้ผลแตกต่างระหว่างมูลค่าตามบัญชีของหนี้สินทางการเงินที่ตัดรายการและสิ่งตอบแทนที่จ่ายและค้างจ่ายรับรู้ในงบกำไรขาดทุนเบ็ดเสร็จ

### 3.2 การแบ่งปันส่วนทุน

กองทุนรวมบันทึกผลกำไรสะสม ณ วันที่ประกาศจ่ายปันผลเป็นเงินสด

### 3.3 การรับรู้รายได้และค่าใช้จ่าย

รายได้เงินปันผล รับรู้เป็นรายได้นับแต่วันที่ประกาศจ่ายและมีสิทธิที่จะได้รับ

รายได้ดอกเบี้ย รับรู้เป็นรายได้ตามเกณฑ์คงค้าง โดยคำนึงถึงอัตราผลตอบแทนที่แท้จริง

ส่วนเกินมูลค่าหรือต่ำกว่ามูลค่าของตราสารหนี้ตัดจำหน่ายตามระยะเวลาที่เหลือของตราสารหนี้ และถือเป็นส่วนหนึ่งของรายได้ดอกเบี้ย

ค่าใช้จ่ายรับรู้ตามเกณฑ์คงค้าง

### 3.4 ภาษีเงินได้

กองทุนมีหน้าที่เสียภาษีเงินได้นิติบุคคลเฉพาะเงินได้พึงประเมินตามมาตรา 40(4)(ก) แห่งประมวลรัษฎากรในอัตราร้อยละ 15 ของรายได้ก่อนหักรายจ่ายใด ๆ

### 3.5 รายการธุรกิจกับบุคคลหรือกิจการที่เกี่ยวข้องกัน

บุคคลหรือกิจการที่เกี่ยวข้องกันกับกองทุน หมายถึง บุคคลหรือกิจการที่ลงทุนในส่วนตัวได้เสียของกองทุน ตั้งแต่ร้อยละ 10 ของส่วนได้เสียทั้งหมดที่มีสิทธิออกเสียงไม่ว่าโดยทางตรงหรือทางอ้อม หรือฝ่ายบริหาร ซึ่งประกอบด้วยบุคคลที่รับผิดชอบในการจัดการกองทุน หรือมีหน้าที่กำหนดนโยบายหรือตัดสินใจเพื่อให้กองทุนบรรลุวัตถุประสงค์ที่วางไว้

นอกจากนี้ บุคคลหรือกิจการที่เกี่ยวข้องกันยังหมายรวมถึงบุคคลหรือกิจการที่มีอำนาจควบคุมกองทุน หรืออยู่ภายใต้อำนาจการควบคุมของกองทุน หรือมีอิทธิพลอย่างเป็นสาระสำคัญของกองทุน หรืออยู่ภายใต้อิทธิพลอย่างเป็นสาระสำคัญของกองทุน

3.6 บัญชีปรับสมดุล

ส่วนหนึ่งของราคาขายหรือราคารับซื้อคืนของหน่วยลงทุนซึ่งเท่ากับจำนวนต่อหน่วยของกำไรสะสมที่ยังไม่ได้แบ่งสรร ณ วันที่เกิดรายการถูกบันทึกใน “บัญชีปรับสมดุล”

3.7 การใช้ดุลยพินิจและประมาณการทางบัญชี

ในการจัดทำงบการเงินให้เป็นไปตามแนวปฏิบัติทางบัญชี ฝ่ายบริหารต้องใช้ดุลยพินิจและประมาณการทางบัญชี ซึ่งมีผลกระทบต่อจำนวนเงินที่เกี่ยวข้องกับสินทรัพย์ หนี้สิน รายได้ ค่าใช้จ่าย และการเปิดเผยข้อมูลเกี่ยวกับสินทรัพย์และหนี้สินที่อาจเกิดขึ้น ซึ่งผลที่เกิดขึ้นจริงอาจแตกต่างไปจากจำนวนที่ประมาณไว้

4. รายการธุรกิจกับกิจการที่เกี่ยวข้องกัน

กองทุนมีรายการธุรกิจที่สำคัญกับกิจการที่เกี่ยวข้องกัน ซึ่งประกอบด้วยบริษัทจัดการ บริษัทที่มีผู้ถือหุ้นหรือผู้ถือหุ้นและ/หรือกรรมการเดียวกันกับบริษัทจัดการ และกองทุนอื่นที่บริหารโดยบริษัทจัดการเดียวกัน รายการที่สำคัญดังกล่าว สำหรับปีสิ้นสุดวันที่ 30 พฤศจิกายน 2566 และ 2565 มีดังต่อไปนี้

(หน่วย : บาท)

	<u>2566</u>	<u>2565</u>	<u>นโยบายการกำหนดราคา</u>
<b>บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด</b>			
ค่าธรรมเนียมการจัดการ	5,930,272.89	7,161,762.44	ตามเกณฑ์ที่ระบุในหนังสือชี้ชวน
<b>บริษัท เอสซีบี เอกซ์ จำกัด (มหาชน)</b>			
- ในฐานะผู้ออกหลักทรัพย์			
ซื้อเงินลงทุน	32,366,939.30	13,361,596.18	ราคาตลาด
ขายเงินลงทุน	29,504,939.59	5,565,985.04	ราคาตลาด
รายได้เงินปันผล	623,973.00	57,000.00	ตามที่ประกาศจ่าย
<b>ธนาคารไทยพาณิชย์ จำกัด (มหาชน)</b>			
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน	372,542.83	446,996.09	ตามเกณฑ์ที่ระบุในหนังสือชี้ชวน
- ในฐานะผู้ออกหลักทรัพย์			
ซื้อเงินลงทุน	-	3,891,950.39	ราคาตลาด
ขายเงินลงทุน	-	13,076,617.80	ราคาตลาด
รายได้เงินปันผล	-	164,901.00	ตามที่ประกาศจ่าย
- ในฐานะผู้ค้าหลักทรัพย์			
ซื้อเงินลงทุน	14,975,792.30	8,974,674.18	ราคาตลาด

(หน่วย : บาท)

	2566	2565	นโยบายการกำหนดราคา
บริษัทหลักทรัพย์ อินโนเวสต์ เอกซ์ จำกัด			
- ในฐานะผู้ค้าหลักทรัพย์			
ค่านายหน้า	144,943.65	352,214.60	อัตราที่ตกลงร่วมกัน
รายได้ดอกเบี้ย	8,655.69	23,756.65	อัตราตลาด
หลักทรัพย์ที่ขายกับกองทุนอื่นที่บริหารโดย บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด			
ขายเงินลงทุน	9,628,000.00	-	ราคาตลาด

ณ วันที่ 30 พฤศจิกายน 2566 และ 2565 กองทุนมียอดคงเหลือที่มีสาระสำคัญกับกิจการที่เกี่ยวข้องกันดังนี้

(หน่วย : บาท)

	2566	2565
บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด		
ค่าธรรมเนียมการจัดการค้างจ่าย	412,418.07	544,441.17
บริษัท เอสซีบี เอกซ์ จำกัด (มหาชน)		
เงินลงทุน	8,773,700.00	7,465,500.00
ธนาคารไทยพาณิชย์ จำกัด (มหาชน)		
เงินฝากธนาคาร	4,978.83	8,182.57
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียนค้างจ่าย	27,076.96	34,090.04
บริษัทหลักทรัพย์ อินโนเวสต์ เอกซ์ จำกัด		
ลูกหนี้จากดอกเบี้ย	6,460.88	22,062.71
เงินวางประกันตามสัญญาซื้อขายตราสารอนุพันธ์	9,540,101.21	22,048,711.52
เจ้าหนี้จากการซื้อเงินลงทุน	-	7,067,938.59

5. ข้อมูลเกี่ยวกับการซื้อขายเงินลงทุน

กองทุนได้ซื้อขายเงินลงทุนสำหรับปีสิ้นสุดวันที่ 30 พฤศจิกายน 2566 และ 2565 สรุปได้ดังนี้

(หน่วย : บาท)

	2566	2565
ซื้อเงินลงทุน	1,922,915,972.58	2,834,607,355.28
ขายเงินลงทุน	2,052,145,558.41	2,910,214,972.32

6. หน่วยลงทุนที่ออกจำหน่าย

รายการเคลื่อนไหวของหน่วยลงทุนและหน่วยลงทุนคงเหลือ แยกตามประเภทผู้ถือหน่วยลงทุน ดังนี้

สำหรับปีสิ้นสุดวันที่ 30 พฤศจิกายน 2566

	<u>ชนิดสะสม</u> <u>มูลค่า</u>	<u>ชนิดผู้ลงทุน</u> <u>กลุ่ม/บุคคล</u>	<u>ชนิดช่องทาง</u> <u>อิเล็กทรอนิกส์</u>	<u>ชนิดเพื่อการ</u> <u>ออม</u>	(หน่วย : หน่วย) ชนิดเพื่อการออม ผ่านช่องทาง อิเล็กทรอนิกส์
หน่วยลงทุน ณ วันต้นปี	59,408,713.0155	1,484,025.0784	-	-	-
หน่วยลงทุนที่ขายในระหว่างปี	15,158,249.0434	2,224,465.7114	217.7744	20,350.9757	2,203.3924
หน่วยลงทุนที่รับซื้อคืนในระหว่างปี	<u>(27,952,563.5846)</u>	<u>(3,662,386.3144)</u>	<u>-</u>	<u>(105.3985)</u>	<u>-</u>
หน่วยลงทุน ณ วันปลายปี	<u>46,614,398.4743</u>	<u>46,104.4754</u>	<u>217.7744</u>	<u>20,245.5772</u>	<u>2,203.3924</u>
สินทรัพย์สุทธิ (บาท)	428,774,271.40	456,041.14	2,007.17	186,475.51	20,323.99
มูลค่าสินทรัพย์สุทธิต่อหน่วย (บาท)	9.1983	9.8914	9.2167	9.2106	9.2239

สำหรับปีสิ้นสุดวันที่ 30 พฤศจิกายน 2565

	(หน่วย : หน่วย)	
	<u>ชนิดสะสมมูลค่า</u>	<u>ชนิดผู้ลงทุนกลุ่ม/บุคคล</u>
หน่วยลงทุน ณ วันต้นปี	68,939,408.7328	91,529.9026
หน่วยลงทุนที่ขายในระหว่างปี	17,533,379.0945	2,477,475.4129
หน่วยลงทุนที่รับซื้อคืนในระหว่างปี	(27,064,074.8118)	(1,084,980.2371)
หน่วยลงทุน ณ วันปลายปี	<u>59,408,713.0155</u>	<u>1,484,025.0784</u>
สินทรัพย์สุทธิ (บาท)	626,622,721.28	16,652,308.17
มูลค่าสินทรัพย์สุทธิต่อหน่วย (บาท)	10.5476	11.2210

การเพิ่มขึ้น(ลดลง)ในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงานแยกตามประเภทผู้ถือหน่วยลงทุน สำหรับปีสิ้นสุดวันที่ 30 พฤศจิกายน 2566 และ 2565 มีดังนี้

	(หน่วย : บาท)	
	<u>2566</u>	<u>2565</u>
ชนิดสะสมมูลค่า	(69,838,574.28)	46,761,897.15
ชนิดผู้ลงทุนกลุ่ม/บุคคล	(784,603.50)	748,835.74
ชนิดช่องทางอิเล็กทรอนิกส์	(27.83)	-
ชนิดเพื่อการออม	(5,686.91)	-
ชนิดเพื่อการออมผ่านช่องทางอิเล็กทรอนิกส์	(929.01)	-
รวม	<u>(70,629,821.53)</u>	<u>47,510,732.89</u>

7. การเปิดเผยข้อมูลสำหรับเครื่องมือทางการเงิน

7.1 การประมาณมูลค่ายุติธรรม

มูลค่ายุติธรรมเป็นราคาที่จะได้รับจากการขายสินทรัพย์ หรือจะจ่ายเพื่อโอนหนี้สินในรายการที่เกิดขึ้นในสภาพปกติระหว่างผู้ร่วมตลาด ณ วันที่วัดมูลค่า ยกเว้นในกรณีที่ไม่มีตลาดที่มีสภาพคล่องสำหรับสินทรัพย์หรือหนี้สินที่มีลักษณะเดียวกันหรือไม่สามารถหาราคาเสนอซื้อขายในตลาดที่มีสภาพคล่องได้ กองทุนจะประมาณมูลค่ายุติธรรมและพยายามใช้ข้อมูลที่สามารถสังเกตได้ที่เกี่ยวข้องกับสินทรัพย์หรือหนี้สินที่จะวัดมูลค่ายุติธรรมนั้นให้มากที่สุด



กองทุนวัดมูลค่ายุติธรรมโดยแบ่งตามลำดับชั้นของข้อมูลที่สามารถสังเกตได้ และตามระดับความสำคัญของข้อมูลที่ใช้วัดมูลค่ายุติธรรม ซึ่งมีดังต่อไปนี้

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

ณ วันที่ 30 พฤศจิกายน 2566 กองทุนมีสินทรัพย์ที่วัดมูลค่าด้วยมูลค่ายุติธรรมแสดงตามลำดับชั้นของมูลค่ายุติธรรม ดังนี้

	(หน่วย : บาท)			
	<u>ระดับ 1</u>	<u>ระดับ 2</u>	<u>ระดับ 3</u>	<u>รวม</u>
<u>สินทรัพย์</u>				
ตราสารทุน	344,051,808.50	10,304.00	-	344,062,112.50
ตราสารหนี้	-	67,857,461.82	-	67,857,461.82
สัญญาฟิวเจอร์ส	(6,488,759.20)	-	-	(6,488,759.20)

ณ วันที่ 30 พฤศจิกายน 2565 กองทุนมีสินทรัพย์ที่วัดมูลค่าด้วยมูลค่ายุติธรรมแสดงตามลำดับชั้นของมูลค่ายุติธรรม ดังนี้

	(หน่วย : บาท)			
	<u>ระดับ 1</u>	<u>ระดับ 2</u>	<u>ระดับ 3</u>	<u>รวม</u>
<u>สินทรัพย์</u>				
ตราสารทุน	531,251,993.00	3,743,936.00	-	534,995,929.00
ตราสารหนี้	-	71,877,290.22	-	71,877,290.22
สัญญาฟิวเจอร์ส	5,104,830.64	-	-	5,104,830.64

กองทุนมีการประมาณการมูลค่ายุติธรรมของเครื่องมือทางการเงินตามหลักเกณฑ์ดังนี้

- มูลค่ายุติธรรมของตราสารทุนที่มีตลาดซื้อขายคล่องรองรับคำนวณโดยใช้ราคาซื้อขายครั้งล่าสุด ณ สิ้นวันทำการของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย
- มูลค่ายุติธรรมของใบสำคัญแสดงสิทธิที่มีตลาดซื้อขายคล่องรองรับคำนวณโดยใช้ราคาซื้อขายครั้งล่าสุด ณ สิ้นวันทำการของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย
- มูลค่ายุติธรรมของหุ้นสามัญที่อยู่ระหว่างการเสนอขายครั้งแรกที่ไม่มีตลาดซื้อขายคล่องรองรับคำนวณโดยใช้ราคาจองซื้อ

- มูลค่ายุติธรรมมูลค่ายุติธรรมของใบสำคัญแสดงสิทธิที่ไม่มีตลาดซื้อขายคล่องรองรับจำนวน โดยใช้ราคาซื้อขายครั้งล่าสุด ณ สิ้นวันทำการของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยของหุ้นที่จะได้รับจากการใช้สิทธิดังกล่าว หักด้วยราคาใช้สิทธิ ทั้งนี้ราคาจะต้องไม่ต่ำกว่า 0
- มูลค่ายุติธรรมของเงินลงทุนในตราสารหนี้คำนวณโดยใช้อัตราผลตอบแทน ณ สิ้นวันทำการสุดท้ายของรอบระยะเวลารายงาน ที่ประกาศโดยสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย
- มูลค่ายุติธรรมของเงินลงทุนในตราสารหนี้ ซึ่งมีอายุครบกำหนดภายใน 90 วัน นับตั้งแต่วันที่ลงทุนและไม่มีเงื่อนไขการต่ออายุจำนวน โดยใช้วิธีราคาทุนตัดจำหน่าย เมื่อมูลค่ายุติธรรมของตราสารหนี้ไม่แตกต่างจากราคาทุนตัดจำหน่ายอย่างเป็นทางการเป็นสาระสำคัญ
- มูลค่ายุติธรรมของสัญญาฟิวเจอร์สที่มีตลาดซื้อขายคล่องรองรับจำนวน โดยใช้ราคาที่ใช้ชำระราคา ณ สิ้นวันทำการของบริษัท ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)

ในระหว่างปีปัจจุบัน ไม่มีการโอนรายการระหว่างลำดับชั้นของมูลค่ายุติธรรม

## 7.2 ความเสี่ยงด้านเครดิต

ความเสี่ยงด้านเครดิต คือ ความเสี่ยงที่อาจเกิดจากการที่คู่สัญญาไม่สามารถปฏิบัติตามภาระผูกพันที่ระบุไว้ในเครื่องมือทางการเงินได้ กองทุนมีความเสี่ยงด้านการให้เครดิตที่เกี่ยวข้องกับสินทรัพย์ทางการเงิน อย่างไรก็ตาม สินทรัพย์ทางการเงินดังกล่าวจะครบกำหนดในระยะเวลาอันสั้น กองทุนจึงไม่คาดว่าจะได้รับความเสียหายจากการเก็บหนี้

## 7.3 ความเสี่ยงด้านอัตราดอกเบี้ย

ความเสี่ยงจากอัตราดอกเบี้ย คือ ความเสี่ยงที่เกิดจากการเปลี่ยนแปลงของอัตราดอกเบี้ยในตลาด ซึ่งอาจจะส่งผลกระทบต่อมูลค่าของสินทรัพย์ทางการเงินและหนี้สินทางการเงิน อย่างไรก็ตาม เนื่องจากสินทรัพย์และหนี้สินทางการเงินส่วนใหญ่อยู่ในประเภทระยะสั้นและมีอัตราดอกเบี้ยที่ปรับขึ้นลงตามอัตราตลาด หรือมีอัตราดอกเบี้ยคงที่ซึ่งใกล้เคียงกับอัตราดอกเบี้ยในปัจจุบัน

ณ วันที่ 30 พฤศจิกายน 2566 สินทรัพย์และหนี้สินทางการเงินที่สามารถจัดตามประเภทอัตราดอกเบี้ย ได้ดังนี้

(หน่วย : บาท)

	อัตราดอกเบี้ย		รวม
	ปรับขึ้นลงตามราคาตลาด	ไม่มีอัตราดอกเบี้ย	
<b>สินทรัพย์ทางการเงิน</b>			
เงินลงทุนแสดงด้วยมูลค่ายุติธรรม	18,006,068.92	387,424,746.20	405,430,815.12
เงินฝากธนาคาร	14,013,470.51	4,978.83	14,018,449.34
ลูกหนี้จากดอกเบี้ยและเงินปันผล	-	1,154,259.07	1,154,259.07

(หน่วย : บาท)

	อัตราดอกเบี้ย		รวม
	ปรับขึ้นลง	ไม่มี	
	ตามราคาตลาด	อัตราดอกเบี้ย	
<u>สินทรัพย์ทางการเงิน</u>			
ลูกหนี้จากการขายเงินลงทุน	-	4,838,210.45	4,838,210.45
เงินวางประกันตามสัญญาซื้อขายตราสารอนุพันธ์	9,540,101.21	-	9,540,101.21
<u>หนี้สินทางการเงิน</u>			
เจ้าหนี้จากการซื้อเงินลงทุน	-	2,527,371.60	2,527,371.60
เจ้าหนี้จากการรับซื้อคืนหน่วยลงทุน	-	2,472,375.86	2,472,375.86
ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย	-	494,909.17	494,909.17

ณ วันที่ 30 พฤศจิกายน 2565 สินทรัพย์และหนี้สินทางการเงินที่สามารถจัดตามประเภทอัตราดอกเบี้ย ได้ดังนี้

(หน่วย : บาท)

	อัตราดอกเบี้ย		รวม
	ปรับขึ้นลง	ไม่มี	
	ตามราคาตลาด	อัตราดอกเบี้ย	
<u>สินทรัพย์ทางการเงิน</u>			
เงินลงทุนแสดงด้วยมูลค่ายุติธรรม	-	611,978,049.86	611,978,049.86
เงินฝากธนาคาร	15,661,771.46	8,182.57	15,669,954.03
ลูกหนี้จากดอกเบี้ยและเงินปันผล	-	530,953.06	530,953.06
ลูกหนี้จากการขายเงินลงทุน	-	5,021,835.67	5,021,835.67
เงินวางประกันตามสัญญาซื้อขายตราสารอนุพันธ์	22,048,711.52	-	22,048,711.52
<u>หนี้สินทางการเงิน</u>			
เจ้าหนี้จากการซื้อเงินลงทุน	-	10,883,560.69	10,883,560.69
เจ้าหนี้จากการรับซื้อคืนหน่วยลงทุน	-	425,914.28	425,914.28
ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย	-	637,502.55	637,502.55

#### 7.4 ความเสี่ยงจากการเปลี่ยนแปลงราคาตลาดของตราสารทุน

ความเสี่ยงที่เกิดจากการเปลี่ยนแปลงของสภาวะการลงทุนในตลาดหุ้นที่มีผลต่อการเปลี่ยนแปลงของราคาหุ้น โดยปัจจัยที่เข้ามากระทบอาจแบ่งออกได้เป็นความเสี่ยงที่เกิดขึ้นกับตลาดโดยรวม (Market Risk) และความเสี่ยงที่เกิดจากปัจจัยเฉพาะ (Specific Risk) ซึ่งอาจจะทำให้เกิดการเปลี่ยนแปลงต่อมูลค่าของสินทรัพย์ประเภทเงินลงทุน ความผันผวนต่อรายได้หรือมูลค่าของสินทรัพย์ทางการเงิน

กองทุนไม่สามารถที่จะจัดความเสี่ยงให้หมดไปได้ อย่างไรก็ตามแนวทางที่ทางกองทุนใช้เพื่อช่วยลดความเสี่ยงในด้านปัจจัยเฉพาะ (Specific Risk) สามารถทำได้โดยการกระจายน้ำหนักการลงทุนในแต่ละหลักทรัพย์และในแต่ละกลุ่มธุรกิจให้มีความเหมาะสม โดยยังคงมีผลตอบแทนที่ดี และไม่ให้เกิดความเสี่ยงมากกว่าความเสี่ยงของตลาด มากจนเกินไป แต่สำหรับความเสี่ยงของตลาด (Market Risk) นั้น กองทุนไม่สามารถจัดหรือลดลงได้เนื่องจากเป็นความเสี่ยงขั้นพื้นฐานที่อยู่ในตราสารทุนของกองทุนประเภทนี้

#### 7.5 ความเสี่ยงจากการผิดนัดชำระดอกเบี้ยหรือเงินต้นของตราสารทางการเงิน

ความเสี่ยงที่เกิดจากการผิดนัดชำระหนี้เงินต้นและดอกเบี้ยของผู้ออกตราสารและหรือผู้รับรอง ผู้อาวัล ผู้ค้ำประกัน หรือคู่สัญญาในการทำธุรกรรม (Counter Party) เนื่องมาจากผู้ออกตราสารและหรือผู้รับรอง ผู้อาวัล ผู้ค้ำประกัน หรือคู่สัญญาในการทำธุรกรรม มีผลการดำเนินงานและฐานะการเงินที่ด้อยลงจึงขาดสภาพคล่องที่จะจ่ายเงินตามภาระผูกพันเมื่อครบกำหนด ส่งผลให้ผู้ลงทุนไม่ได้รับชำระดอกเบี้ยและเงินต้นตามเวลาที่กำหนดไว้

กองทุนสามารถลดความเสี่ยงดังกล่าวลงได้ โดยพิจารณาลงทุนในตราสารหนี้ที่ผู้ออกมีฐานะการเงินที่มั่นคง เช่น ตราสารหนี้ที่กระทรวงการคลังเป็นผู้ออกหรือรับรอง รับอาวัล ค้ำประกันทั้งเงินต้นและดอกเบี้ย หรือพิจารณาลงทุนในตราสารหนี้ของบริษัทเอกชนที่ผ่านการพิจารณาคัดเลือก เช่น ทำการวิเคราะห์ฐานะทางการเงินของบริษัท รวมถึงการกำหนดนโยบายการลงทุนตลอดจนกำหนดวงเงินในการลงทุนเพื่อลดความเสี่ยงจากการลงทุน

#### 7.6 ความเสี่ยงจากการเปลี่ยนแปลงราคาตลาดของตราสารอนุพันธ์ที่อ้างอิงกับหุ้นสามัญ (Single stock) หรือดัชนีหลักทรัพย์ของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET50 Index)

ในกรณีของความเสี่ยงจากการเปลี่ยนแปลงราคาตลาดของตราสารอนุพันธ์ จะเกิดขึ้นทั้งในกรณีที่เปลี่ยนแปลงไปในทิศทางเดียวกันและเปลี่ยนแปลงในทิศทางตรงกันข้ามกับหุ้นสามัญ (Single stock) หรือดัชนีหลักทรัพย์ของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET50 Index) (ความเสี่ยงของตลาดตราสารทุน) ทั้งนี้ขึ้นกับลักษณะของการลงทุนในตราสารอนุพันธ์ หากเป็นการลงทุนในด้าน Long Futures Position หรือ Long Call Option ก็จะมีการเปลี่ยนแปลงในทิศทางเดียวกับหุ้นสามัญ (Single stock) หรือหรือดัชนีหลักทรัพย์ของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET50 Index) ดังกล่าว และหากเป็นการลงทุนในด้าน Short Futures Position หรือ Long Put Option ก็จะมีการเปลี่ยนแปลงในทิศทางตรงกันข้าม

ในกรณีที่เปลี่ยนแปลงไปในทิศทางเดียวกันกับหุ้นสามัญ (Single stock) หรือดัชนีหลักทรัพย์ของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET50 Index) (ความเสี่ยงตลาดตราสารทุน) กองทุนมีนโยบายการลงทุนโดยให้มีสัดส่วนมูลค่าสัญญาตราสารอนุพันธ์เมื่อรวมกับสัดส่วนตราสารทุนแล้ว จะไม่เกินกว่าสัดส่วนรวมของตราสารทุนที่กองทุนสามารถลงทุนได้ ดังนั้นจึงทำให้ความเสี่ยงโดยรวมของกองทุนไม่เกินกว่าความเสี่ยงของตลาดหุ้น

สำหรับกรณีที่เปลี่ยนแปลงไปในทิศทางตรงกันข้ามกับหุ้นสามัญ (Single stock) หรือดัชนีหลักทรัพย์ของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET50 Index) กองทุนมีนโยบายการลงทุนในลักษณะนี้เพื่อป้องกันหรือลดความเสี่ยง ซึ่งสัดส่วนของมูลค่าตราสารอนุพันธ์จะไม่เกินกว่าสัดส่วนของมูลค่าตราสารทุนที่มีอยู่ในช่วงเวลาเดียวกัน ดังนั้นจึงทำให้ความเสี่ยงโดยรวมของกองทุนไม่เกินกว่าความเสี่ยงของตลาดตราสารทุน

#### 7.7 ความเสี่ยงด้านอัตราแลกเปลี่ยน

กองทุนไม่มีสินทรัพย์ทางการเงินหรือหนี้สินทางการเงินที่เป็นเงินตราต่างประเทศ ดังนั้นจึงไม่มีความเสี่ยงด้านอัตราแลกเปลี่ยน

#### 8. ภาวะผูกพัน

กองทุนมีภาวะผูกพันที่จะต้องจ่ายค่าธรรมเนียมการจัดการ ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ และค่าธรรมเนียมนายทะเบียนตามเกณฑ์ที่ระบุในหนังสือชี้ชวน

#### 9. การอนุมัติงบการเงิน

งบการเงินนี้ได้รับการอนุมัติให้ออกโดยผู้มีอำนาจของกองทุนเมื่อวันที่ 28 ธันวาคม 2566

---



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](http://WWW.SCBAM.COM)