

Mutual Funds Report

กองทุนเปิดไทยพาณิชย์หุ้นยูเอส
(SCBS&P500FUND)

รายงานประจำ 6 เดือน

ตั้งแต่วันที่ 1 ธันวาคม 2565 ถึงวันที่ 31 พฤษภาคม 2566

สารจากบริษัทจัดการ

เรียน ท่านผู้ถือหน่วยลงทุน

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด ในฐานะบริษัทจัดการกองทุนเปิดไทยพาณิชย์หุ้นยูเอส (SCBS&P500FUND) ซึ่งกองทุนนี้เป็นกองทุนที่ลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุน SPDR S&P 500 ETF (กองทุนที่มีนโยบายลงทุนในหุ้นที่เป็นส่วนประกอบของดัชนี S&P500) ที่ซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์นิวยอร์ก โดยที่กองทุนจะลงทุนในหน่วยลงทุนนี้เฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน และทำการปิดความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยนค่าเงินบาทไม่น้อยกว่าร้อยละ 90 ของมูลค่าทรัพย์สินที่ลงทุนในต่างประเทศตลอดเวลา

เศรษฐกิจสหรัฐยังมีแนวโน้มชะลอลงในปีนี้ในแง่นโยบายการเงินที่ตึงตัวขึ้น ประกอบกับเศรษฐกิจที่ชะลอตัวลงเป็นปัจจัยลบสำคัญ ที่โดย Bloomberg Consensusปรับลดคาดการณ์ผลกำไรของบริษัทจดทะเบียนใน S&P500 ปี 2023 เมื่อเทียบกับดัชนีชี้วัดภาคการผลิต ISM Manufacturing ซึ่งเป็นผลสำรวจผู้จัดการฝ่ายจัดซื้อภาคการผลิตรายเดือน ซึ่งสามารถสะท้อนภาวะเศรษฐกิจได้ดี และเป็นดัชนีชี้้นำการเติบโตของกำไรบริษัทที่ค่อนข้างแม่นยำ โดยหากดัชนีอยู่มากกว่า 50 จุด จะสะท้อนภาวะเศรษฐกิจขยายตัว ในทางกลับกันหากต่ำกว่า 50 จุด จะสะท้อนภาวะเศรษฐกิจหด มองไปข้างหน้า ฐานราคาที่สูงจะส่งผลให้อัตราเงินเฟ้อทั่วไปเทียบกับปีก่อน (YoY) ลดลงมาอยู่ที่ระดับ 3% ด้วยแนวโน้มเงินเฟ้อที่อาจกลับมาเพิ่มขึ้นในระยะข้างหน้า ประกอบกับแรงกดดันจากอัตราเงินเฟ้อพื้นฐาน (Core CPI) ที่ยังคงลดค่อนข้างช้า ทำให้ Fed น่าจะส่งสัญญาณหยุดขึ้นดอกเบี้ยเพียงชั่วคราว (Skip) และอาจปรับคาดการณ์ดอกเบี้ยในระยะข้างหน้า (Dot plot) ทั้งนี้ในระยะถัดไปคาดว่าตลาดหุ้นอาจถูกกดดันจากอัตรารายเงินเฟ้อที่เร่งตัวขึ้นอย่างรวดเร็วอาจเป็นปัจจัยที่กดดันให้อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลระยะยาวปรับตัวเพิ่มขึ้น ส่งผลให้ Valuation ของตลาดหุ้นมีความน่าสนใจลดน้อยลงเมื่อเทียบกับช่วงก่อนหน้านี้

ทั้งนี้ ผลการดำเนินงานในช่วง 6 เดือนที่ผ่านมาครอบคลุมระยะเวลาบัญชี 1 ธันวาคม 2565 - 31 พฤษภาคม 2566 ของกองทุนเปิดไทยพาณิชย์หุ้นยูเอส (SCBS&P500FUND) กองทุนให้ผลตอบแทนจากการลงทุนประมาณร้อยละ 0.75

สุดท้ายนี้ บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด ขอขอบพระคุณผู้ถือหน่วยลงทุนทุกท่านที่ได้มอบความไว้วางใจลงทุนในกองทุนรวมของ บลจ. ด้วยดีเสมอมา

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด

ข้อมูลการลงทุน ผลการดำเนินงาน และความผันผวนของผลการดำเนินงานของ
กองทุนเปิดไทยพาณิชย์หุ้นยูเอส (SCBS&P500FUND)

ผลตอบแทนจากการลงทุน	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี	3 ปี	5 ปี	ตั้งแต่จัดตั้ง
SCBS&P500	6.94%	4.34%	0.75%	-1.16%	10.64%	8.51%	10.31%
เกณฑ์มาตรฐาน	9.70%	5.67%	3.27%	3.03%	13.10%	11.11%	11.46%
ความผันผวนของผลการดำเนินงาน	9.12%	7.05%	10.60%	21.45%	18.84%	21.52%	17.61%
ความผันผวนของเกณฑ์มาตรฐาน	9.53%	7.15%	11.19%	21.27%	18.94%	21.88%	17.86%

เกณฑ์มาตรฐาน : ดัชนี S&P 500 สัดส่วน 100% ปรับด้วยต้นทุนการป้องกันความเสี่ยงอัตราแลกเปลี่ยนในช่วงระยะเวลาที่คำนวณผลตอบแทนของตัวชี้วัดเพื่อคำนวณผลตอบแทนเป็นสกุลเงินบาทในอัตราส่วน 95% และปรับด้วยอัตราแลกเปลี่ยนเพื่อคำนวณผลตอบแทนเป็นสกุลเงินบาทในอัตราส่วน 5%

ผลตอบแทนจากการลงทุน	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี	3 ปี	5 ปี	ตั้งแต่จัดตั้ง
SCBS&P500E	7.39%	4.60%	1.25%	-0.24%	11.72%	n.a.	n.a.
เกณฑ์มาตรฐาน	9.70%	5.67%	3.27%	3.03%	13.10%	n.a.	n.a.
ความผันผวนของผลการดำเนินงาน	9.12%	7.05%	10.60%	21.46%	18.85%	n.a.	n.a.
ความผันผวนของเกณฑ์มาตรฐาน	9.53%	7.15%	11.19%	21.27%	18.94%	n.a.	n.a.

เกณฑ์มาตรฐาน : ดัชนี S&P 500 สัดส่วน 100% ปรับด้วยต้นทุนการป้องกันความเสี่ยงอัตราแลกเปลี่ยนในช่วงระยะเวลาที่คำนวณผลตอบแทนของตัวชี้วัดเพื่อคำนวณผลตอบแทนเป็นสกุลเงินบาทในอัตราส่วน 95% และปรับด้วยอัตราแลกเปลี่ยนเพื่อคำนวณผลตอบแทนเป็นสกุลเงินบาทในอัตราส่วน 5%

ผลตอบแทนจากการลงทุน	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี	3 ปี	5 ปี	ตั้งแต่จัดตั้ง
SCBS&P500A	6.95%	4.34%	0.74%	-1.23%	n.a.	n.a.	n.a.
เกณฑ์มาตรฐาน	9.70%	5.67%	3.27%	3.03%	n.a.	n.a.	n.a.
ความผันผวนของผลการดำเนินงาน	9.12%	7.05%	10.60%	21.46%	n.a.	n.a.	n.a.
ความผันผวนของเกณฑ์มาตรฐาน	9.53%	7.15%	11.19%	21.27%	n.a.	n.a.	n.a.

เกณฑ์มาตรฐาน : ดัชนี S&P 500 สัดส่วน 100% ปรับด้วยต้นทุนการป้องกันความเสี่ยงอัตราแลกเปลี่ยนในช่วงระยะเวลาที่คำนวณผลตอบแทนของตัวชี้วัดเพื่อคำนวณผลตอบแทนเป็นสกุลเงินบาทในอัตราส่วน 95% และปรับด้วยอัตราแลกเปลี่ยนเพื่อคำนวณผลตอบแทนเป็นสกุลเงินบาทในอัตราส่วน 5%

ผลตอบแทนจากการลงทุน	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี	3 ปี	5 ปี	ตั้งแต่จัดตั้ง
SCBS&P500P	7.39%	4.60%	1.25%	-0.24%	11.72%	n.a.	n.a.
เกณฑ์มาตรฐาน	9.70%	5.67%	3.27%	3.03%	13.10%	n.a.	n.a.
ความผันผวนของผลการดำเนินงาน	9.12%	7.05%	10.60%	21.46%	18.85%	n.a.	n.a.
ความผันผวนของเกณฑ์มาตรฐาน	9.53%	7.15%	11.19%	21.27%	18.94%	n.a.	n.a.

เกณฑ์มาตรฐาน : ดัชนี S&P 500 สัดส่วน 100% ปรับด้วยต้นทุนการป้องกันความเสี่ยงอัตราแลกเปลี่ยนในช่วงระยะเวลาที่คำนวณผลตอบแทนของตัวชี้วัดเพื่อคำนวณผลตอบแทนเป็นสกุลเงินบาทในอัตราส่วน 95% และปรับด้วยอัตราแลกเปลี่ยน เพื่อคำนวณผลตอบแทนเป็นสกุลเงินบาทในอัตราส่วน 5%

ผลตอบแทนจากการลงทุน	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี	3 ปี	5 ปี	ตั้งแต่จัดตั้ง
SCBS&P500(SSFA)	6.95%	4.34%	0.74%	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.
เกณฑ์มาตรฐาน	9.70%	5.67%	3.27%	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.
ความผันผวนของผลการดำเนินงาน	9.12%	7.05%	10.60%	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.
ความผันผวนของเกณฑ์มาตรฐาน	9.53%	7.15%	11.19%	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.

เกณฑ์มาตรฐาน : ดัชนี S&P 500 สัดส่วน 100% ปรับด้วยต้นทุนการป้องกันความเสี่ยงอัตราแลกเปลี่ยนในช่วงระยะเวลาที่คำนวณผลตอบแทนของตัวชี้วัดเพื่อคำนวณผลตอบแทนเป็นสกุลเงินบาทในอัตราส่วน 95% และปรับด้วยอัตราแลกเปลี่ยน เพื่อคำนวณผลตอบแทนเป็นสกุลเงินบาทในอัตราส่วน 5%

ผลตอบแทนจากการลงทุน	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี	3 ปี	5 ปี	ตั้งแต่จัดตั้ง
SCBS&P500(SSFE)	7.39%	4.60%	1.26%	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.
เกณฑ์มาตรฐาน	9.70%	5.67%	3.27%	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.
ความผันผวนของผลการดำเนินงาน	9.12%	7.05%	10.60%	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.
ความผันผวนของเกณฑ์มาตรฐาน	9.53%	7.15%	11.19%	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.

เกณฑ์มาตรฐาน : ดัชนี S&P 500 สัดส่วน 100% ปรับด้วยต้นทุนการป้องกันความเสี่ยงอัตราแลกเปลี่ยนในช่วงระยะเวลาที่คำนวณผลตอบแทนของตัวชี้วัดเพื่อคำนวณผลตอบแทนเป็นสกุลเงินบาทในอัตราส่วน 95% และปรับด้วยอัตราแลกเปลี่ยน เพื่อคำนวณผลตอบแทนเป็นสกุลเงินบาทในอัตราส่วน 5%

ความเห็นของผู้ดูแลผลประโยชน์

เรียน ผู้ถือหน่วยลงทุน กองทุนเปิดไทยพาณิชย์หุ้นยูเอส

ข้าพเจ้า บมจ.ธนาคารกสิกรไทย ในฐานะผู้ดูแลผลประโยชน์ได้ดูแลการจัดการกองทุนเปิดไทยพาณิชย์หุ้นยูเอส ซึ่งจัดการโดย บริษัท หลักทรัพย์จัดการกองทุนไทยพาณิชย์ จำกัด สำหรับระยะเวลาตั้งแต่วันที่ 1 ธันวาคม พ.ศ. 2565 ถึงวันที่ 31 พฤษภาคม พ.ศ. 2566 แล้ว

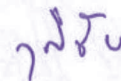
ข้าพเจ้าเห็นว่า บริษัท หลักทรัพย์จัดการกองทุนไทยพาณิชย์ จำกัด ได้ปฏิบัติหน้าที่ในการจัดการ กองทุนเปิดไทยพาณิชย์หุ้นยูเอส เหมาะสมตามสมควรแห่งวัตถุประสงค์ ที่ได้กำหนดไว้ในโครงการและภายใต้พระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535

ขอแสดงความนับถือ
บมจ. ธนาคารกสิกรไทย



(นายวิโรจน์ ลิ้มทองธรรม)

รองผู้อำนวยการฝ่ายบริการธุรกิจหลักทรัพย์



(นายวุฒิชัย รอดภัย)

หัวหน้าส่วนฝ่ายบริการธุรกิจหลักทรัพย์

วันที่ 9 มิถุนายน พ.ศ. 2566

ผลการดำเนินงาน
ข้อมูล ณ วันที่ 31 พฤษภาคม 2566

ผลตอบแทนจากการลงทุน	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี	3 ปี	5 ปี	10 ปี	ตั้งแต่จัดตั้ง
SCBS&P500	6.94%	4.34%	0.75%	-1.16%	10.64%	8.51%	10.31%	11.16%
เกณฑ์มาตรฐาน	9.70%	5.67%	3.27%	3.03%	13.10%	11.11%	11.46%	12.42%
ความผันผวนของผลการดำเนินงาน	9.12%	7.05%	10.60%	21.45%	18.84%	21.52%	17.61%	17.40%
ความผันผวนของเกณฑ์มาตรฐาน	9.53%	7.15%	11.19%	21.27%	18.94%	21.88%	17.86%	17.64%

เกณฑ์มาตรฐาน : ดัชนี S&P 500 สัดส่วน 100%

ปรับด้วยต้นทุนการป้องกันความเสี่ยงอัตราแลกเปลี่ยนในช่วงระยะเวลาที่คำนวณผลตอบแทนของตัวชี้วัดเพื่อคำนวณผลตอบแทนเป็นสกุลเงินบาทในอัตราส่วน 95% และปรับด้วยอัตราแลกเปลี่ยน เพื่อคำนวณผลตอบแทนเป็นสกุลเงินบาทในอัตราส่วน 5%

ผลตอบแทนจากการลงทุน	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี	3 ปี	5 ปี	10 ปี	ตั้งแต่จัดตั้ง
SCBS&P500A	6.95%	4.34%	0.74%	-1.23%	n.a.	n.a.	n.a.	-4.17%
เกณฑ์มาตรฐาน	9.70%	5.67%	3.27%	3.03%	n.a.	n.a.	n.a.	-1.55%
ความผันผวนของผลการดำเนินงาน	9.12%	7.05%	10.60%	21.46%	n.a.	n.a.	n.a.	20.49%
ความผันผวนของเกณฑ์มาตรฐาน	9.53%	7.15%	11.19%	21.27%	n.a.	n.a.	n.a.	20.38%

เกณฑ์มาตรฐาน : ดัชนี S&P 500 สัดส่วน 100%

ปรับด้วยต้นทุนการป้องกันความเสี่ยงอัตราแลกเปลี่ยนในช่วงระยะเวลาที่คำนวณผลตอบแทนของตัวชี้วัดเพื่อคำนวณผลตอบแทนเป็นสกุลเงินบาทในอัตราส่วน 95% และปรับด้วยอัตราแลกเปลี่ยน เพื่อคำนวณผลตอบแทนเป็นสกุลเงินบาทในอัตราส่วน 5%

ผลตอบแทนจากการลงทุน	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี	3 ปี	5 ปี	10 ปี	ตั้งแต่จัดตั้ง
SCBS&P500E	7.39%	4.60%	1.25%	-0.24%	11.72%	n.a.	n.a.	10.42%
เกณฑ์มาตรฐาน	9.70%	5.67%	3.27%	3.03%	13.10%	n.a.	n.a.	11.90%
ความผันผวนของผลการดำเนินงาน	9.12%	7.05%	10.60%	21.46%	18.85%	n.a.	n.a.	22.90%
ความผันผวนของเกณฑ์มาตรฐาน	9.53%	7.15%	11.19%	21.27%	18.94%	n.a.	n.a.	23.26%

เกณฑ์มาตรฐาน : ดัชนี S&P 500 สัดส่วน 100%

ปรับด้วยต้นทุนการป้องกันความเสี่ยงอัตราแลกเปลี่ยนในช่วงระยะเวลาที่คำนวณผลตอบแทนของตัวชี้วัดเพื่อคำนวณผลตอบแทนเป็นสกุลเงินบาทในอัตราส่วน 95% และปรับด้วยอัตราแลกเปลี่ยน เพื่อคำนวณผลตอบแทนเป็นสกุลเงินบาทในอัตราส่วน 5%

ผลตอบแทนจากการลงทุน	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี	3 ปี	5 ปี	10 ปี	ตั้งแต่จัดตั้ง
SCBS&P500P	7.39%	4.60%	1.25%	-0.24%	11.72%	n.a.	n.a.	8.89%
เกณฑ์มาตรฐาน	9.70%	5.67%	3.27%	3.03%	13.10%	n.a.	n.a.	11.12%
ความผันผวนของผลการดำเนินงาน	9.12%	7.05%	10.60%	21.46%	18.85%	n.a.	n.a.	22.27%
ความผันผวนของเกณฑ์มาตรฐาน	9.53%	7.15%	11.19%	21.27%	18.94%	n.a.	n.a.	22.59%

เกณฑ์มาตรฐาน : ดัชนี S&P 500 สัดส่วน 100%

ปรับด้วยต้นทุนการป้องกันความเสี่ยงอัตราแลกเปลี่ยนในช่วงระยะเวลาที่คำนวณผลตอบแทนของตัวชี้วัดเพื่อคำนวณผลตอบแทนเป็นสกุลเงินบาทในอัตราส่วน 95% และปรับด้วยอัตราแลกเปลี่ยน เพื่อคำนวณผลตอบแทนเป็นสกุลเงินบาทในอัตราส่วน 5%

ผลตอบแทนจากการลงทุน	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี	3 ปี	5 ปี	10 ปี	ตั้งแต่จัดตั้ง
SCBS&P500(SSFA)	6.95%	4.34%	0.74%	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.	11.63%
เกณฑ์มาตรฐาน	9.70%	5.67%	3.27%	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.	14.74%
ความผันผวนของผลการดำเนินงาน	9.12%	7.05%	10.60%	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.	13.98%
ความผันผวนของเกณฑ์มาตรฐาน	9.53%	7.15%	11.19%	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.	14.47%

เกณฑ์มาตรฐาน : ดัชนี S&P 500 สัดส่วน 100%

ปรับด้วยต้นทุนการป้องกันความเสี่ยงอัตราแลกเปลี่ยนในช่วงระยะเวลาที่คำนวณผลตอบแทนของตัวชี้วัดเพื่อคำนวณผลตอบแทนเป็นสกุลเงินบาทในอัตราส่วน 95% และปรับด้วยอัตราแลกเปลี่ยน เพื่อคำนวณผลตอบแทนเป็นสกุลเงินบาทในอัตราส่วน 5%

ผลตอบแทนจากการลงทุน	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี	3 ปี	5 ปี	10 ปี	ตั้งแต่จัดตั้ง
SCBS&P500(SSFE)	7.39%	4.60%	1.26%	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.	1.72%
เกณฑ์มาตรฐาน	9.70%	5.67%	3.27%	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.	5.87%
ความผันผวนของผลการดำเนินงาน	9.12%	7.05%	10.60%	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.	20.93%
ความผันผวนของเกณฑ์มาตรฐาน	9.53%	7.15%	11.19%	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.	20.56%

เกณฑ์มาตรฐาน : ดัชนี S&P 500 สัดส่วน 100%

ปรับด้วยต้นทุนการป้องกันความเสี่ยงอัตราแลกเปลี่ยนในช่วงระยะเวลาที่คำนวณผลตอบแทนของตัวชี้วัดเพื่อคำนวณผลตอบแทนเป็นสกุลเงินบาทในอัตราส่วน 95% และปรับด้วยอัตราแลกเปลี่ยน เพื่อคำนวณผลตอบแทนเป็นสกุลเงินบาทในอัตราส่วน 5%

ผลตอบแทนจากการลงทุน	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี	3 ปี	5 ปี	10 ปี	ตั้งแต่จัดตั้ง
SCBS&P500-SSF	6.94%	4.34%	0.74%	-1.23%	n.a.	n.a.	n.a.	10.36%
เกณฑ์มาตรฐาน	9.70%	5.67%	3.27%	3.03%	n.a.	n.a.	n.a.	12.79%
ความผันผวนของผลการดำเนินงาน	9.12%	7.05%	10.60%	21.46%	n.a.	n.a.	n.a.	18.52%
ความผันผวนของเกณฑ์มาตรฐาน	9.53%	7.15%	11.19%	21.27%	n.a.	n.a.	n.a.	18.54%

เกณฑ์มาตรฐาน : ดัชนี S&P 500 สัดส่วน 100%

ปรับด้วยต้นทุนการป้องกันความเสี่ยงอัตราแลกเปลี่ยนในช่วงระยะเวลาที่คำนวณผลตอบแทนของตัวชี้วัดเพื่อคำนวณผลตอบแทนเป็นสกุลเงินบาทในอัตราส่วน 95% และปรับด้วยอัตราแลกเปลี่ยน เพื่อคำนวณผลตอบแทนเป็นสกุลเงินบาทในอัตราส่วน 5%

หมายเหตุ : เอกสารการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวมฉบับนี้ ได้จัดทำขึ้นตามมาตรฐานการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวมของสมาคมบริษัทจัดการลงทุน

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด
 กองทุนเปิดไทยพาณิชย์หุ้นยูเอส
 รายละเอียดหลักทรัพย์ และสัดส่วนการลงทุน
 ณ วันที่ 31 พฤษภาคม 2566

ชื่อหลักทรัพย์	ราคา ณ 31 พ.ค. 2566 (บาท)	จำนวนหุ้น (หุ้น)	มูลค่า ตามราคาตลาด (บาท)	ร้อยละของมูลค่า ทรัพย์สินสุทธิ (%)	ค่าประกัน/รับรอง/รับอวัล หรือสลิปหลังโอน แบบมีสิทธิไต่เบี่ย
หน่วยลงทุน			6,398,857,085.37	100.34%	
หน่วยลงทุนต่างประเทศ			6,398,857,085.37	100.34%	
ISHARES CORE S&P 500 ETF(IVVUP)	14,586.52	438,683.00	6,398,857,085.37	100.34%	
เงินฝากธนาคาร			239,379,541.64	3.75%	
บมจ.ธนาคารกรุงไทย(KBANK)	0.00	0.00	239,379,541.64	3.75%	
สัญญาซื้อขายล่วงหน้า / FORWARD			(224,548,576.35)	(3.52%)	
สัญญาซื้อขายล่วงหน้า/ FORWARD(FWTHBUSD23609AL)	0.00	1.00	13,047,845.30	0.20%	
สัญญาซื้อขายล่วงหน้า/ FORWARD(FWTHBUSD23616BR)	0.00	1.00	9,030,823.05	0.14%	
สัญญาซื้อขายล่วงหน้า/ FORWARD(FWUSDTHB23915BY)	0.00	1.00	51,993.20	0.00%	
สัญญาซื้อขายล่วงหน้า/ FORWARD(FWUSDTHB23922AN)	0.00	1.00	(1,623,292.59)	(0.03%)	
สัญญาซื้อขายล่วงหน้า/ FORWARD(FWUSDTHB23922GH)	0.00	1.00	(1,897,792.90)	(0.03%)	
สัญญาซื้อขายล่วงหน้า/ FORWARD(FWUSDTHB23915E)	0.00	1.00	(1,920,208.50)	(0.03%)	
สัญญาซื้อขายล่วงหน้า/ FORWARD(FWUSDTHB23609BI)	0.00	1.00	(2,880,705.30)	(0.05%)	
สัญญาซื้อขายล่วงหน้า/ FORWARD(FWUSDTHB23721JB)	0.00	1.00	(5,686,509.31)	(0.09%)	
สัญญาซื้อขายล่วงหน้า/ FORWARD(FWUSDTHB23818P)	0.00	1.00	(7,017,200.00)	(0.11%)	
สัญญาซื้อขายล่วงหน้า/ FORWARD(FWUSDTHB23804C)	0.00	1.00	(7,122,000.00)	(0.11%)	
สัญญาซื้อขายล่วงหน้า/ FORWARD(FWUSDTHB23915Y)	0.00	1.00	(7,129,379.20)	(0.11%)	
สัญญาซื้อขายล่วงหน้า/ FORWARD(FWUSDTHB23825E)	0.00	1.00	(8,731,000.00)	(0.14%)	
สัญญาซื้อขายล่วงหน้า/ FORWARD(FWUSDTHB23616BP)	0.00	1.00	(9,188,135.00)	(0.14%)	
สัญญาซื้อขายล่วงหน้า/ FORWARD(FWUSDTHB23616JR)	0.00	1.00	(10,712,338.05)	(0.17%)	
สัญญาซื้อขายล่วงหน้า/ FORWARD(FWUSDTHB23922EC)	0.00	1.00	(11,615,836.55)	(0.18%)	
สัญญาซื้อขายล่วงหน้า/ FORWARD(FWUSDTHB23N17A)	0.00	1.00	(22,673,016.00)	(0.36%)	
สัญญาซื้อขายล่วงหน้า/ FORWARD(FWUSDTHB23915N)	0.00	1.00	(73,758,619.50)	(1.16%)	
สัญญาซื้อขายล่วงหน้า/ FORWARD(FWUSDTHB23609BZ)	0.00	1.00	(74,723,205.00)	(1.17%)	
หนี้สินอื่น			(36,605,241.88)	(0.57%)	
มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ			6,377,082,808.78	100.00%	
มูลค่าหน่วยลงทุน (บาท)			23.0792		

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด
กองทุนเปิดไทยพาณิชย์หุ้นยูเอส
รายงานสรุปเงินลงทุน
ณ วันที่ 31 พฤษภาคม 2566

กลุ่มของตราสาร	มูลค่าตามราคาตลาด	%NAV
(ก) ตราสารภาครัฐ ได้แก่ ตัวแลกเงิน พันธบัตรรัฐบาล พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย พันธบัตร หรือตราสารแห่งหนึ่งที่กองทุนเพื่อการฟื้นฟูและพัฒนาระบบสถาบันการเงิน หรือกระทรวงการคลัง เป็นผู้ออก ผู้รับรอง ผู้รับอวัล หรือผู้ค้ำประกัน	-	-
(ข) ตราสารที่ธนาคารที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้น ธนาคารพาณิชย์ หรือบริษัทเงินทุนเป็นผู้ออก ผู้รับรอง ผู้รับอวัล ผู้สลับหลัง หรือผู้ค้ำประกัน	239,379,541.64	3.75
(ค) ตราสารที่มีบริษัทที่ได้รับ rating ในระดับ investment grade เป็นผู้ออก ผู้รับรอง ผู้รับอวัล ผู้สลับหลัง หรือผู้ค้ำประกัน	-	-
(ง) ตราสารที่มีบริษัทที่ไม่ได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือในระดับที่ต่ำกว่า investment grade หรือไม่มี rating เป็นผู้ออก ผู้รับรอง ผู้รับอวัล ผู้สลับหลัง หรือผู้ค้ำประกัน	-	-

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

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด
 กองทุนเปิดไทยพาณิชย์หุ้นยูเอส
 รายละเอียดตัวตราสารและอันดับความน่าเชื่อถือของตราสารทุกตัวใน Port
 ณ วันที่ 31 พฤษภาคม 2566

ประเภท	ผู้ออก	ผู้ค้ำ/ผู้รับรอง/ผู้หลักหลัง	วันครบกำหนด	อันดับความน่าเชื่อถือของผู้ออกตราสาร		มูลค่าหน้าตั๋ว	มูลค่าตามราคาตลาด
				TRIS Rating	FITCH Rating		
เงินฝากธนาคาร	บมจ.ธนาคารกสิกรไทย				AA+(tha)	-	239,379,541.64

กองทุนเปิดไทยพาณิชย์หุ้นยูเอส

SCB US EQUITY FUND

แบบค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม

FUND'S DIRECT EXPENSES REPORT

ตั้งแต่วันที่ 01 ธันวาคม 2565 ถึงวันที่ 31 พฤษภาคม 2566

Period from 01 December 2022 to 31 May 2023

ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม * Fund's direct expenses	จำนวนเงิน หน่วย : พันบาท	ร้อยละต่อปีของ มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ
ค่าธรรมเนียมการจัดการ (Management fee)		
- ชนิดผู้ลงทุนกลุ่ม/บุคคล (S&P500P)	-	-
- ชนิดจ่ายเงินปันผล (S&P500)	13,949	1.00
- ชนิดช่องทางอิเล็กทรอนิกส์ (S&P500E)	-	-
- ชนิดเพื่อการออม (S&P500-SSF)	8,308	1.00
- ชนิดเพื่อสะสมมูลค่า (S&P500A)	3,678	1.00
- ชนิดเพื่อการออมผ่านช่องทางอิเล็กทรอนิกส์ (S&P500(SSFE))	-	-
- ชนิดเพื่อการออมสะสมมูลค่า (S&P500(SSFA))	287	1.00
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ (Trustee fee)	1,112	0.04
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน (Registrar fee)	1,938	0.07
ค่าที่ปรึกษาการลงทุน (Advisory fee)	-	-
ค่าใช้จ่ายอื่น ๆ (Other expenses)	41	-
รวมค่าใช้จ่ายทั้งหมด (Total Expense) **	29,314	0.99

* ค่าใช้จ่ายดังกล่าวได้รวมภาษีมูลค่าเพิ่มแล้ว / Including VAT

** ไม่รวมค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์และค่าธรรมเนียมต่าง 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

กองทุนเปิดไทยพาณิชย์หุ้นยูเอส (SCBS&P500FUND)

งบแสดงฐานะการเงิน

ณ วันที่ 31 พฤษภาคม 2566

"ยังไม่ได้ตรวจสอบ"

"ยังไม่ได้สอบทาน"

บาท

สินทรัพย์

เงินลงทุนตามราคายุติธรรม	6,429,635,813.67
เงินฝากธนาคาร	208,296,693.04
ลูกหนี้จากเงินปันผลและดอกเบี้ย	304,120.30
ลูกหนี้จากตราสารอนุพันธ์	22,130,661.55
รวมสินทรัพย์	6,660,367,288.56

หนี้สิน

เจ้าหนี้จากการรับซื้อคืนหน่วยลงทุน	31,058,631.11
เจ้าหนี้จากตราสารอนุพันธ์	246,679,237.90
ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย	5,319,093.75
หนี้สินอื่น	227,517.02
รวมหนี้สิน	283,284,479.78

สินทรัพย์สุทธิ

6,377,082,808.78

สินทรัพย์สุทธิ :-

ทุนที่ได้รับจากผู้ถือหน่วยลงทุน	2,763,124,244.53
บัญชีปรับสมดุล	3,009,726,097.03
กำไร(ขาดทุน)สะสมจากการดำเนินงาน	604,232,467.22
สินทรัพย์สุทธิ	6,377,082,808.78

จำนวนหน่วยลงทุนที่จำหน่ายแล้ว (หน่วย)

276,312,424.4526

สินทรัพย์สุทธิต่อหน่วยลงทุน

23.0792

สินทรัพย์สุทธิต่อหน่วยที่คำนวณแยกตามประเภทผู้ถือหน่วยลงทุน มีดังนี้

ชนิดหรือประเภทผู้ถือหน่วยลงทุน	ต่อหน่วย (บาท)	จำนวนหน่วยลงทุน (หน่วย)
ชนิดผู้ลงทุนกลุ่ม/บุคคล	26.4148	8,398,891.3026
ชนิดจ่ายปันผล	21.8845	128,617,163.3405
ชนิดช่องทางอิเล็กทรอนิกส์	26.2736	17,593,699.1184
ชนิดเพื่อการออม	23.6991	75,450,009.9607
ชนิดสะสมมูลค่า	23.6470	39,567,013.7677
ชนิดเพื่อการออมผ่านช่องทางอิเล็กทรอนิกส์	23.0261	3,435,110.4013
ชนิดเพื่อการออมสะสมมูลค่า	23.1973	3,250,536.5614
รวม		276,312,424.4526

กองทุนเปิดไทยพาณิชย์หุ้นยูเอส (SCBS&P500FUND)

งบกำไรขาดทุนเบ็ดเสร็จ

รอบระยะเวลาตั้งแต่วันที่ 1 ธันวาคม 2565 ถึงวันที่ 31 พฤษภาคม 2566

"ยังไม่ได้ตรวจสอบ"

"ยังไม่ได้สอบทาน"

บาท

รายได้จากการลงทุน	
รายได้เงินปันผล	46,164,927.08
รายได้ดอกเบี้ย	321,584.78
รายได้ค่าธรรมเนียมการซื้อขายหน่วยลงทุน	3,044,795.88
รายได้ทั้งสิ้น	49,531,307.74
ค่าใช้จ่าย	
ค่าธรรมเนียมจัดการ	26,222,629.14
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์	1,111,994.59
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน	1,938,047.97
ค่าสอบบัญชี	37,397.36
ค่าใช้จ่ายอื่น	7,017,742.88
ค่าใช้จ่ายทั้งสิ้น	36,327,811.94
รายได้จากการลงทุนสุทธิ	13,203,495.80
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิจากเงินลงทุน	
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิที่เกิดขึ้นจริง	437,806,749.32
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิที่ยังไม่เกิดขึ้นจริง	(380,526,351.13)
รวมรายการกำไร(ขาดทุน)จากการลงทุนที่เกิดขึ้นและที่ยังไม่เกิดขึ้น	57,280,398.19
การเพิ่มขึ้น(ลดลง)ในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงานก่อนภาษีเงินได้	70,483,893.99
หัก ค่าใช้จ่ายภาษีเงินได้	48,237.89
การเพิ่มขึ้น(ลดลง)ในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงาน หลังหักภาษีเงินได้	70,435,656.10

การเพิ่มขึ้น(ลดลง)ในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงานแยกตามประเภทผู้ถือหน่วยลงทุน มีดังนี้

ชนิดหรือประเภทผู้ถือหน่วยลงทุน	ต่อหน่วย (บาท)	จำนวนเงิน
ชนิดผู้ลงทุนกลุ่ม/บุคคล	(0.2300)	(1,932,216.53)
ชนิดจ่ายปันผล	0.1432	18,427,796.75
ชนิดช่องทางอิเล็กทรอนิกส์	0.3650	6,422,715.31
ชนิดเพื่อการออม	0.3885	29,315,870.74
ชนิดสะสมมูลค่า	0.2834	11,216,938.99
ชนิดเพื่อการออมผ่านช่องทางอิเล็กทรอนิกส์	0.9269	3,184,310.39
ชนิดเพื่อการออมสะสมมูลค่า	1.1691	3,800,240.45
รวม		70,435,656.10

รายงานการซื้อขายหลักทรัพย์และค่าใช้จ่ายต่าง ๆ

VOLUME TRADE AND EXPENSES REPORT

ตั้งแต่วันที่ 1 ธันวาคม 2565 ถึง วันที่ 31 พฤษภาคม 2566

Period from 1 December 2022 to 31 May 2023

	(พันบาท) / (Thousand Baht)
มูลค่าทรัพย์สินสุทธิเฉลี่ย / Average Net Assets Value	5,954,521
การซื้อขายหลักทรัพย์รวม / Volume Trade	
มูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์รวม	1,100,054
Total Volume Trade	
ค่าธรรมเนียมหน้าในการซื้อขายหลักทรัพย์รวม	85
Total Brokerage Fee	
ค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายอื่น ๆ รวม / Fee and other Expenses	29,314
	(ร้อยละ) / (Percentage)
<ul style="list-style-type: none"> สัดส่วนค่าธรรมเนียมหน้าในการซื้อขายหลักทรัพย์รวมคิดเป็นร้อยละของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์รวม 	0.01
<ul style="list-style-type: none"> Brokerage Fee as Percentage of Total Trading Volume 	
<ul style="list-style-type: none"> สัดส่วนค่าธรรมเนียมหน้าในการซื้อขายหลักทรัพย์รวมคิดเป็นร้อยละของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิเฉลี่ย 	0.00
<ul style="list-style-type: none"> Brokerage Fee as Percentage of Average Net Assets Value 	
<ul style="list-style-type: none"> สัดส่วนค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายอื่น ๆ รวมคิดเป็นร้อยละของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิเฉลี่ย 	0.99
<ul style="list-style-type: none"> Fee and other Expenses as Percentage of Average Net Assets Value 	
<ul style="list-style-type: none"> อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุนของกองทุนรวม (PTR) 	0.03
<ul style="list-style-type: none"> Portfolio Turnover Ratio (PTR) 	

รายงานรายชื่อบริษัทนายหน้า และค่าธรรมเนียม ซื้อ-ขาย หลักทรัพย์
 ของกองทุนเปิดไทยพาณิชย์หุ้นยูเอส
 ระหว่างวันที่ 1 ธันวาคม 2565 ถึงวันที่ 31 พฤษภาคม 2566

ลำดับที่	ชื่อบริษัทนายหน้า	ค่านายหน้า (พันบาท)	อัตราส่วนค่านายหน้าแต่ละราย ต่อค่านายหน้าทั้งหมด
1	UOB Kay Hian Pte Ltd	70.23	82.30%
2	Maybank Kim Eng Securities Pte Ltd	9.19	10.77%
3	Credit Suisse Securities (Europe) Limited	5.91	6.93%
	รวม	85.33	100.00%

การรับผลประโยชน์ตอบแทนเนื่องจากการที่กองทุนใช้บริการบุคคลอื่น ประจำเดือน พฤษภาคม 2566

BENEFIT FROM BROKERAGE SERVICES AS OF MAY 2023

บริษัทที่ผลประโยชน์	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 แอส เอช เอ (ประเทศไทย) จำกัด	CLSA SECURITIES (THAILAND) LIMITED	✓	✓	✓		✓	
บริษัทหลักทรัพย์ กรุงศรี พัฒนสิน 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 กสิกรไทย จำกัด (มหาชน)	KASIKORN SECURITIES PUBLIC COMPANY LIMITED	✓	✓	✓		✓	✓
บริษัทหลักทรัพย์ กรุงศรี จำกัด (มหาชน)	KRUNGSRI SECURITIES PUBLIC COMPANY LIMITED	✓	✓	✓		✓	
บริษัทหลักทรัพย์ เกียตตินาทินัทธ จำกัด (มหาชน)	KIATNAKIN PHATRA SECURITIES PUBLIC COMPANY LIMITED	✓	✓	✓	✓	✓	
บริษัทหลักทรัพย์ อินโนเวสต์ เอกซ์ จำกัด	INNOVESTX SECURITIES COMPANY LIMITED	✓	✓	✓		✓	
บริษัทหลักทรัพย์ ธนชาด จำกัด (มหาชน)	THANACHART SECURITIES PUBLIC COMPANY LIMITED	✓	✓	✓		✓	
บริษัทหลักทรัพย์ ทีเอสไอ จำกัด	TISCO SECURITIES COMPANY LIMITED	✓	✓	✓	✓	✓	
บริษัทหลักทรัพย์ ซีจีเอส-ซีไอเอมบี (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 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	✓	✓	✓		✓	
บริษัทหลักทรัพย์ ซิตี้คอร์ป (ประเทศไทย) จำกัด	CITICORP SECURITIES (THAILAND) LIMITED	✓	✓	✓		✓	✓
บริษัทหลักทรัพย์ เจพีมอร์แกน (ประเทศไทย) จำกัด	JPMORGAN SECURITIES (THAILAND) LIMITED	✓	✓	✓		✓	✓
บริษัทหลักทรัพย์ ยูแอนต้า (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, จบการเงิน 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)

ข้อมูลการดำเนินการ ใช้สิทธิออกเสียงในที่ประชุมผู้ถือหุ้นในนามกองทุนรวมของรอบปีปฏิทินล่าสุด

สามารถตรวจสอบข้อมูลได้จาก Website : www.scbam.com



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

SCBAM Call Center 0 2777 7777 กด 0 กด 6 หรือ WWW.SCBAM.COM