

# ดัชนี SET50FF และดัชนี SET100FF

ดัชนี SET50FF (SET50 Free Float Adjusted Market Capitalization Weighted Index) และ ดัชนี SET100FF (SET100 Free Float Adjusted Market Capitalization Weighted Index) เป็นดัชนีที่สะท้อนความเคลื่อนไหวของราคากลุ่มหลักทรัพย์ขนาดใหญ่ที่มีสภาพคล่องสูงที่จดทะเบียนซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ จำนวน 50 หลักทรัพย์ และ 100 หลักทรัพย์ ตามลำดับ และยังให้น้ำหนักหลักทรัพย์ในดัชนีโดยคำนึงถึงสัดส่วนผู้ถือหลักทรัพย์รายย่อย (Free Float) ด้วย ซึ่งช่วยสะท้อนถึงความสามารถในการเข้าถึงหุ้นหลักทรัพย์ที่เป็นองค์ประกอบในดัชนีได้ ดังนั้น ดัชนี SET50FF และดัชนี SET100FF จึงเป็นอีกหนึ่งทางเลือกเพื่อใช้เป็น Benchmark สำหรับการลงทุนหรือนำไปใช้อ้างอิงเพื่อออกผลิตภัณฑ์การเงิน

## การคัดเลือกหลักทรัพย์และการคำนวณน้ำหนักหลักทรัพย์ในดัชนี

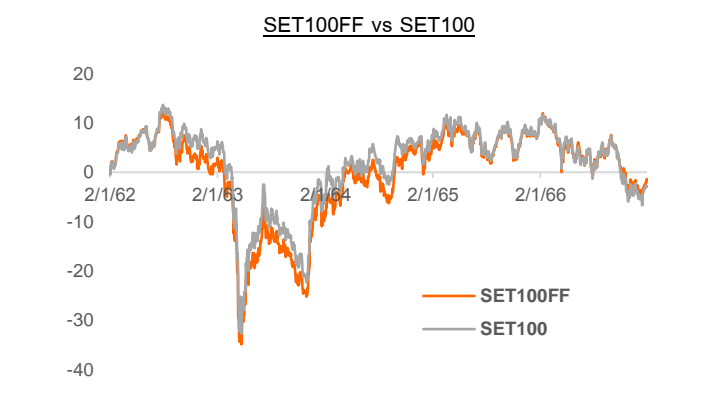
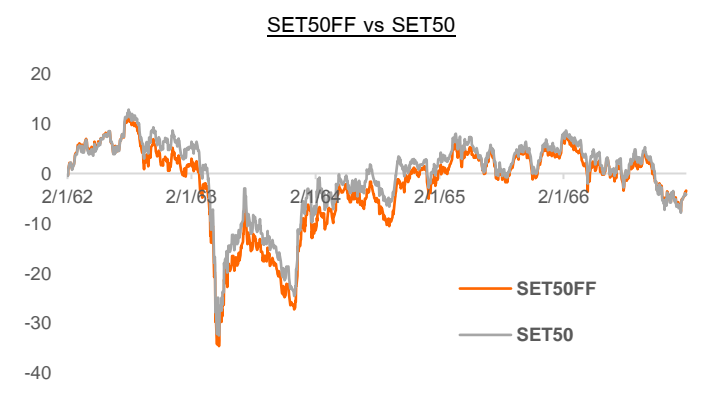
เกณฑ์คัดเลือกหลักทรัพย์ใน ดัชนี SET50FF ดัชนี SET50 ดัชนี SET100FF ดัชนี SET100 ใช้เกณฑ์คัดเลือกเดียวกัน หรือกล่าวได้ว่า รายชื่อหลักทรัพย์ในดัชนี SET50FF เป็นรายชื่อเดียวกันกับดัชนี SET50 และรายชื่อหลักทรัพย์ในดัชนี SET100FF เป็นรายชื่อเดียวกันกับดัชนี SET100

น้ำหนักหลักทรัพย์ในดัชนี SET50FF และดัชนี SET100FF คำนวณจากมูลค่าหลักทรัพย์ตามราคาตลาดและถ่วงน้ำหนักด้วยสัดส่วนผู้ถือหุ้นรายย่อย (Free Float) ในขณะที่ดัชนี SET50 และดัชนี SET100 คำนวณน้ำหนักหลักทรัพย์ในดัชนีจากมูลค่าหลักทรัพย์ตามราคาตลาดเพียงปัจจัยเดียว จึงส่งผลให้น้ำหนักของหลักทรัพย์ในดัชนีไม่เท่ากัน และอาจส่งผลให้ผลตอบแทนของดัชนีแตกต่างกัน

	SET50FF	SET100FF	SET50	SET100
ค่าดัชนีเริ่มต้น	875.25 จุด	1938.83 จุด	1000 จุด	1000 จุด
วันฐาน	28 ธ.ค. 66		16 ส.ค. 38	30 เม.ย. 48
เริ่มเผยแพร่	2 ม.ค. 67		17 ส.ค. 38	3 พ.ค. 48
การคำนวณ	Free Float Adjusted		Market Cap. Weight	Market Cap. Weight
รอบทบทวน	ปีละ 2 ครั้ง เดือนมิถุนายน / เดือนธันวาคมของทุกปี			

## ผลจำลองผลตอบแทนย้อนหลัง (Back Testing)\*

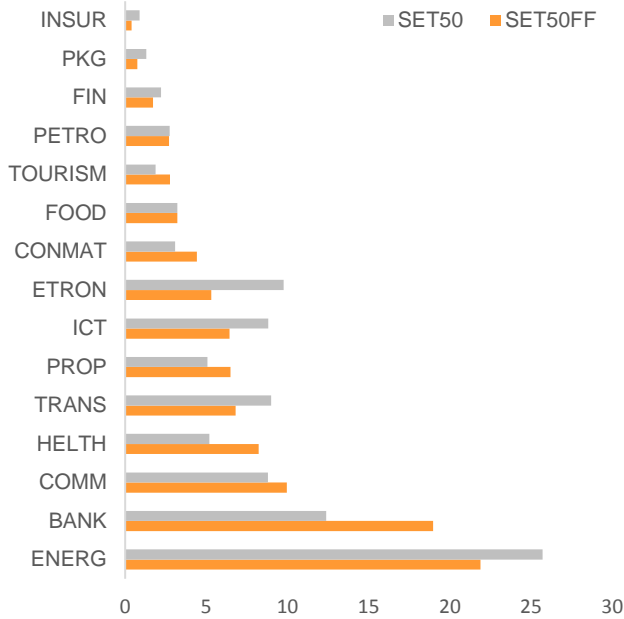
Cumulative Index Total Return (%) - (ม.ค. 62 - ธ.ค. 66)



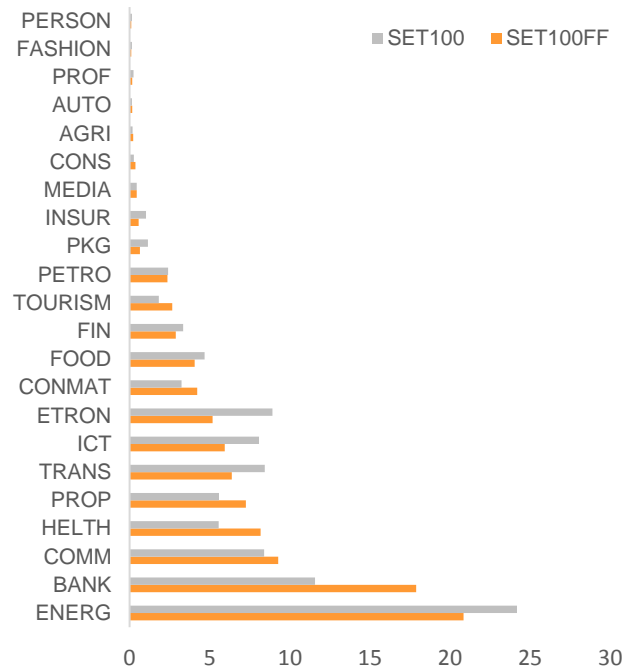
	Return (%)			Annualized Return (%)			Annualized SD. (%)			Fundamentals	
	1Y	3Y	5Y	1Y	3Y	5Y	1Y	3Y	5Y	Annualized Div. Yield (%) 5Y	Annualized P/E 5Y (เท่า)
SET50FF	-9.25	7.91	-3.08	-9.25	2.57	-0.62	11.00	11.32	17.16	2.65	17.03
SET50	-10.64	2.51	-3.67	-10.64	0.83	-0.75	11.99	11.90	17.78	2.46	19.24
SET100FF	-10.54	7.53	-1.03	-10.54	2.45	-0.21	11.24	11.28	17.01	2.73	16.71
SET100	-11.85	1.69	-2.36	-11.85	0.56	-0.48	12.02	11.75	17.51	2.50	18.93

**Sector Breakdown (ณ 28 ธ.ค. 66)**

**SET50FF vs SET50: Sector Weight (%)**



**SET100FF vs SET100: Sector Weight (%)**



**รายชื่อ 10 อันดับแรกตามน้ำหนักหลักทรัพย์ในดัชนี (ณ 28 ธ.ค. 66)**

**SET50 Index**

Stock	Company	Sector	%Weight
DELTA	Delta Electronics (Thailand) Pcl	ETRON	9.21
PTT	PTT Pcl	ENERG	8.57
AOT	Airports of Thailand Pcl	TRANS	7.16
ADVANC	Advanced Info Service Pcl	ICT	5.42
PTTEP	PTT Exploration and Production Pcl	ENERG	4.98
GULF	Gulf Energy Development Pcl	ENERG	4.38
CPALL	CP All Pcl	COMM	4.22
BDMS	Bangkok Dusit Medical Services Pcl	HELTH	3.70
SCC	The Siam Cement Pcl	CONMAT	3.08
SCB	SCB X Pcl	BANK	3.00

**SET50FF Index**

Stock	Company	Sector	%Weight
PTT	PTT Pcl	ETRON	9.19
BDMS	Bangkok Dusit Medical Services Pcl	TRANS	8.02
CPALL	CP All Pcl	ENERG	7.93
BBL	Bangkok Bank Pcl	ICT	5.39
SCB	SCB X Pcl	ENERG	5.38
AOT	Airports of Thailand Pcl	ENERG	4.35
KBANK	Kasikornbank Pcl	COMM	4.34
DELTA	Delta Electronics (Thailand) Pcl	HELTH	3.50
SCC	The Siam Cement Pcl	CONMAT	2.94
ADVANC	Advanced Info Service Pcl	BANK	2.87

**SET100 Index**

Stock	Company	Sector	%Weight
DELTA	Delta Electronics (Thailand) Pcl	ETRON	8.10
PTT	PTT Pcl	ENERG	7.53
AOT	Airports of Thailand Pcl	TRANS	6.30
ADVANC	Advanced Info Service Pcl	ICT	4.76
PTTEP	PTT Exploration and Production Pcl	ENERG	4.38
GULF	Gulf Energy Development Pcl	ENERG	3.85
CPALL	CP All Pcl	COMM	3.71
BDMS	Bangkok Dusit Medical Services Pcl	HELTH	3.25
SCC	The Siam Cement Pcl	CONMAT	2.71
SCB	SCB X Pcl	BANK	2.63

**SET100FF Index**

Stock	Company	Sector	%Weight
PTT	PTT Pcl	ENERG	7.95
BDMS	Bangkok Dusit Medical Services Pcl	HELTH	5.38
CPALL	CP All Pcl	COMM	4.73
BBL	Bangkok Bank Pcl	BANK	4.69
SCB	SCB X Pcl	BANK	4.34
AOT	Airports of Thailand Pcl	TRANS	4.08
KBANK	Kasikornbank Pcl	BANK	4.06
DELTA	Delta Electronics (Thailand) Pcl	ETRON	4.04
SCC	The Siam Cement Pcl	CONMAT	3.87
ADVANC	Advanced Info Service Pcl	ICT	3.73

#### \* หมายเหตุ ผลการจำลองผลตอบแทนย้อนหลัง (Back Testing)

ผลการจำลองผลตอบแทนย้อนหลัง (Back Testing) เป็นการคำนวณโดยใช้ข้อมูลรายชื้อหลักทรัพย์และราคาหลักทรัพย์ย้อนหลังซึ่งเป็นข้อมูลก่อนเริ่มคำนวณดัชนี SET50FF และ ดัชนี SET100FF จริง ไม่รวมการปรับราคาและจำนวนหุ้นจาก corporate action หรืออัตราส่วนทางการเงินอื่นๆ ที่อาจจะมี โดยข้อมูลรายชื้อหลักทรัพย์ในดัชนี SET50 และ ดัชนี SET100 เป็นข้อมูลย้อนหลังตามรอบดัชนี และข้อมูล Free Float เป็นข้อมูลในอดีต จาก SETSMART การคำนวณ ผลตอบแทนที่ได้นี้จึงต่างจากผลตอบแทนในอนาคตที่จะเกิดขึ้นจริง และไม่สามารถนำไปใช้อ้างอิงถึงผลตอบแทนในอนาคตได้

#### ข้อตกลงและขอบเขตความรับผิดชอบ

ดัชนีหลักทรัพย์ SET INDEX, SET50 INDEX, SET100 INDEX รวมถึงดัชนีอื่นๆที่ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยเป็นผู้คำนวณ (รวมเรียกว่า "กลุ่มดัชนีหลักทรัพย์ของตลาดหลักทรัพย์") เป็นเครื่องหมายการค้า/เครื่องหมายบริการจดทะเบียนที่ตลาดหลักทรัพย์ฯ เป็นเจ้าของแต่เพียงผู้เดียวการใช้กลุ่มดัชนีหลักทรัพย์ของตลาดหลักทรัพย์ฯ โดยมีได้รับอนุญาตจากตลาดหลักทรัพย์ฯ ถือเป็นภาระละเมิด อนึ่ง การนำเสนอข้อมูลกลุ่มดัชนีหลักทรัพย์ของตลาดหลักทรัพย์บนเว็บไซต์นี้ เพื่อวัตถุประสงค์ในการให้ข้อมูลเท่านั้น โดยไม่สามารถรับรองในเรื่องของการใช้งานที่ตอบสนองวัตถุประสงค์เฉพาะอื่นใด หรือการรับประกันคุณภาพของข้อมูลแต่อย่างใดตลาดหลักทรัพย์ฯ จะใช้ความพยายามอย่างดีที่สุดที่จะนำเสนอข้อมูลที่ถูกต้อง ทั้งนี้ ตลาดหลักทรัพย์ฯ จะไม่รับผิดชอบต่อความรับผิดชอบใด(รวมถึงกรณีประมาท) สำหรับข้อผิดพลาดหรือข้อละเว้น หรือความเสียหายใดๆ อันอาจจะเกิดขึ้นจากการใช้ข้อมูลที่ได้นำเสนอนี้

#### ข้อมูลเพิ่มเติม

SET50/ SET50FF <https://www.set.or.th/th/market/index/set50/profile>

SET100 / SET100FF <https://www.set.or.th/th/market/index/set100/profile>

ติดต่อ : SET Contact Center | Email: SETContactCenter@set.or.th | โทร 0 2009 9999