

กองทุนเปิด วรรณ อัลติเมท ยิลด์ 6M
ห้ามขายผู้ลงทุนรายย่อย (ONE-UY6M)

รายงานของรอบระยะเวลา 6 เดือน
กองทุนเปิด วรรณ อัลติเมท ยิลด์ 6M ห้ามขายผู้ลงทุนรายย่อย (ONE-UY6M)
 ตั้งแต่วันที่ 31 ตุลาคม 2561 ถึง 31 มีนาคม 2562

กองทุนรวมนี้เน้นลงทุนในตราสารที่มีความเสี่ยงด้านเครดิต และสภาพคล่องมากกว่ากองทุนรวมทั่วไป ซึ่งตราสารดังกล่าวอาจไม่สามารถชำระคืนเงินต้นและดอกเบี้ยตามจำนวนหรือเวลาที่กำหนด ดังนั้น จึงเหมาะกับผู้ลงทุนที่มีฐานะการเงินที่สามารถรับความเสี่ยงจากผลขาดทุนได้ กองทุนผสม กองทุนรวมที่ลงทุนแบบมีความเสี่ยงทั้งในและต่างประเทศ ผู้ลงทุนไม่สามารถขายคืนหน่วยลงทุนนี้ในช่วงเวลา 6 เดือนได้ และกองทุนนี้ลงทุนกระจุกตัวในผู้ออก และตราสารที่มีความเสี่ยงด้านเครดิตและสภาพคล่อง ดังนั้น หากมีปัจจัยลบที่ส่งผลกระทบต่อการลงทุนดังกล่าว ผู้ลงทุนอาจสูญเสียเงินลงทุนจำนวนมาก

ประเภทของกองทุน :	กองทุนรวมผสม	กองทุนรวมสำหรับผู้ลงทุนที่มีรายย่อยเท่านั้น
อายุโครงการ :	ไม่กำหนดอายุโครงการ	
จำนวนเงินลงทุนของโครงการ :	1,000 ล้านบาท	
วันเริ่มต้นโครงการ :	31 ตุลาคม 2561	
ระดับความเสี่ยงของกองทุน :	ระดับ 6 : ความเสี่ยงสูง	
นโยบายการลงทุน :	กองทุนมีนโยบายลงทุนในพันธบัตรหรือตราสารแห่งหนึ่งที่มีคุณภาพและให้ผลตอบแทนที่เหมาะสมที่เสนอขายในประเทศและ/หรือต่างประเทศ กองทุนจะลงทุนในตราสารหนี้ที่มีอันดับความน่าเชื่อถือต่ำกว่าที่สามารถลงทุนได้ (Non-Investment Grade) และตราสารหนี้ที่ไม่ได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือ (Unrated Securities) นอกจากนี้ กองทุนอาจลงทุนในหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินอื่นหรือการขาดทุนโดยวิธีอื่นอย่างใดอย่างหนึ่งหรือหลายอย่างที่ไม่ขัดต่อกฎหมาย ก.ล.ต. และกองทุนอาจพิจารณาการลงทุนในพันธบัตรหรือตราสารแห่งหนึ่งเสนอขายในต่างประเทศ ไม่เกินร้อยละ 79 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน ทั้งนี้ ในกรณีที่กองทุนมีการลงทุนในพันธบัตรหรือตราสารแห่งหนึ่งเสนอขายในต่างประเทศ กองทุนจะลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเพื่อลดหรือป้องกันความเสี่ยงด้านอัตราแลกเปลี่ยนเงินบาท (Fully Hedge) กองทุนอาจลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) เพื่อลดความเสี่ยง (Hedging) ด้านอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ แต่กองทุนจะไม่ลงทุนในตราสารหนี้ที่มีลักษณะของสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแบบ (Structured Note) แต่อาจพิจารณาการลงทุนในตราสารที่ได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือของตราสารหรือของผู้ออกตราสารจากสถาบันจัดอันดับความน่าเชื่อถือที่ได้รับการยอมรับจากสำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ต. อยู่ในอันดับที่สามารถลงทุนได้ (Investment Grade) โดยในกรณีที่ตราสารดังกล่าวเป็นหุ้นกู้ด้อยสิทธิ (Subordinated Debt) ตัวตราสารนั้นจะต้องได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือของตราสาร (Issue Rating) อยู่ในอันดับที่สามารถลงทุนได้ (Investment Grade) เท่านั้น ฯลฯ	
มูลค่าขั้นต่ำของการสั่งซื้อ :	500,000 บาท	
นโยบายการจ่ายเงินปันผล :	ไม่มีนโยบายในการจ่ายเงินปันผล	
ผู้ดูแลผลประโยชน์ :	ธนาคาร กรุงเทพ จำกัด (มหาชน)	
ชื่อบริษัทจัดการกองทุนรวม :	บลจ.วรรณ จำกัด ได้รับการรับรอง CAC	
วันทำการซื้อ / ขายคืน / สับเปลี่ยนหน่วยลงทุน :	ทุกวันระยะเวลาประมาณ 6 เดือน ถัดจากวันทำการซื้อขายหน่วยลงทุนครั้งล่าสุด โดยบริษัทจัดการจะแจ้งวันทำการซื้อขายหน่วยลงทุนรอบถัดไปให้ผู้ถือหน่วยลงทุนทราบภายใน 15 วัน หลังจากวันจดทะเบียนกองทรัสต์เป็นกองทุนรวมต่อสำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ต. และ/หรือ ภายใน 15 วัน หลังจากวันทำการซื้อขายหน่วยลงทุนครั้งล่าสุด โดยจะปิดประกาศ ณ สำนักงานของบริษัทจัดการ สถานที่ติดต่อของผู้สนับสนุนการขายหรือรับซื้อคืนหน่วยลงทุน และประกาศผ่านทางเว็บไซต์ของบริษัทจัดการ ฯลฯ	
การรับซื้อคืนหน่วยลงทุนโดยอัตโนมัติ :	บริษัทจัดการอาจดำเนินการรับซื้อคืนหน่วยลงทุนโดยอัตโนมัติหรือไม่รับซื้อคืนหน่วยลงทุนโดยอัตโนมัติ ทั้งนี้ ในกรณีที่มีการรับซื้อคืนหน่วยลงทุนโดยอัตโนมัติ บริษัทจัดการจะดำเนินการรับซื้อคืนหน่วยลงทุนโดยอัตโนมัติ ณ สิ้นรอบการลงทุนแต่ละรอบจากจำนวนเงินที่จัดสรรจากเงินสดรับที่ได้ออกดอกเบี้ย ของพันธบัตรหรือหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินอื่นตามหัวข้อ "ประเภทของหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินอื่น หรือการขาดทุนโดยวิธีอื่นที่จะลงทุน" ของโครงการ หรือจากส่วนเกินมูลค่าเงินลงทุน (Capital Gain) ในอัตราไม่เกินร้อยละ 100 หลังหักเงินสำรองสำหรับค่าใช้จ่ายของกองทุน (ถ้ามี) ให้แก่ผู้ถือหน่วยลงทุนที่มีชื่อปรากฏอยู่ในทะเบียนผู้ถือหน่วยลงทุนของวันทำการรับซื้อคืนหน่วยลงทุนโดยอัตโนมัติ โดยถือว่าได้รับความยินยอมจากผู้ถือหน่วยลงทุนแล้ว ฯลฯ	
ค่าธรรมเนียมการจัดการ :	ไม่เกิน 2.10% ต่อปีของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุนรวม (รวม VAT)	
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ :	ไม่เกิน 0.10% ต่อปีของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุนรวม (รวม VAT)	
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน :	ไม่เกิน 1.10% ต่อปีของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุนรวม (รวม VAT)	
ค่าธรรมเนียมการขาย :	ไม่มี	
ค่าธรรมเนียมการรับซื้อคืน :	ไม่มี	
ค่าธรรมเนียมการสับเปลี่ยนหน่วยลงทุน :	ไม่มี	
หมายเหตุ :	ค่าธรรมเนียม และค่าใช้จ่ายดังกล่าวข้างต้น เป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่มแล้ว NAV หมายถึง มูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน สอบถามข้อมูลเพิ่มเติมพร้อมรับหนังสือชี้ชวนได้ที่ : บลจ.วรรณ จำกัด ชั้น 9, 24 อาคารสยามพิวรรณ์ทาวเวอร์ โทร. 0-2659-8888 กด 1 ฝ่ายลูกค้าสัมพันธ์และสนับสนุนธุรกิจ หรือที่ผู้สนับสนุนการขายหรือรับซื้อคืนหน่วยลงทุนที่ได้รับการแต่งตั้งจากบลจ.วรรณ	



ความเห็นของผู้ดูแลผลประโยชน์

วันที่ 24 เมษายน 2562

เรียน ผู้ถือหน่วยลงทุนกองทุนเปิด วรรณ อัลติเมท ยิลด์ 6M ห้ามขายผู้ลงทุนรายย่อย

ธนาคารกรุงเทพ จำกัด (มหาชน) ในฐานะผู้ดูแลผลประโยชน์ ได้ดูแลการจัดการกองทุนเปิด วรรณ อัลติเมท ยิลด์ 6M ห้ามขายผู้ลงทุนรายย่อย ซึ่งจัดการโดยบริษัท หลักทรัพย์จัดการกองทุน วรรณ จำกัด สำหรับระยะเวลาดังแต่วันที่ 31 ตุลาคม 2561 ถึงวันที่ 31 มีนาคม 2562 แล้วนั้น

ธนาคารฯ เห็นว่าบริษัท หลักทรัพย์จัดการกองทุน วรรณ จำกัด ได้ปฏิบัติตามหน้าที่ในการจัดการ กองทุนเปิด วรรณ อัลติเมท ยิลด์ 6M ห้ามขายผู้ลงทุนรายย่อย เหมาะสมตามสมควรแห่ง วัตถุประสงค์ที่ได้กำหนดไว้ในโครงการ และภายใต้พระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535

กช

(นางฤดี สีโทสวัสดิ์)

ธนาคารกรุงเทพ จำกัด (มหาชน)

ผู้ดูแลผลประโยชน์

ธนาคารกรุงเทพ จำกัด (มหาชน) ทะเบียนเลขที่ 0107536000374
333 ถนนสีลม เขตบางรัก กรุงเทพฯ 10500 โทรศัพท์ 0-2626-4538 โทรสาร 0-2626-4545 www.bangkokbank.com
Bangkok Bank Public Company Limited Registration No. 0107536000374
333 Silom Road Bangkok Bangkok 10500 Thailand Tel. (662) 626-4538 Fax (662) 626-4545 www.bangkokbank.com

ข้อมูลอื่น ๆ ที่ผู้ถือหน่วยลงทุนควรทราบ

รายงานบุคคลที่เกี่ยวข้องที่มีการทำธุรกรรมรอบระยะเวลา 6 เดือนแรก (31 ตุลาคม 2561 - 31 มีนาคม 2562)

-ไม่มี-

ผู้ลงทุนสามารถตรวจสอบการทำธุรกรรมกับบุคคลที่เกี่ยวข้องกับกองทุนรวมได้ที่บลจ. วรรณ จำกัด โดยตรงหรือที่ website ของบลจ. วรรณ จำกัด (<http://www.one-asset.com>) และสำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ด. (<http://www.sec.or.th>)

ผู้จัดการกองทุน

- | | | | |
|--------------------------|-----------------------------|----------------------------------|--------------------------------|
| 1. นายมงคล จันทะกุล | 2. นายวิญญู ศรีวิริยานนท์ | 3. นายสันธาน เสงสกุล | 4. นายบัญชา จึงวัฒนกิจ |
| 5. น.ส.บุณยนาถ คุลีเมฆิน | 6. น.ส.จันทร์เพ็ญ ชูวงษ์ | 7. น.ส.พรอมา เทวาทูดี | 8. น.ส.ประภาภรณ์ ชื้อเจริญกิจ |
| 9. น.ส.กวิศา เหมเวช | 10. น.ส.จารุภัทร์ ศรีจำเริญ | 11. นายสุทธิโรจน์ สิทธิพัฒนานนท์ | 12. นายชยุตม์ ฉัตรศิริวิชัยกุล |
| 13. นายสิทธิ จ่างตระกูล | 14. นายรัชชธรรม วิจารณ์กรณ | | |

- กรณีที่กองทุนฯ ลงทุนไม่เป็นไปตามนโยบายการลงทุนเฉลี่ยในรอบระยะเวลาที่กำหนดให้แสดงข้อมูลดังกล่าวพร้อมทั้งเหตุผล : -ไม่มี-
- ข้อมูลการบันทึกมูลค่าตราสารแห่งหนึ่งหรือสิทธิเรียกร้องดังกล่าวเป็นศูนย์ในกรณีที่ถูกตราสารแห่งหนึ่งหรือลูกหนี้แห่งสิทธิเรียกร้องผิดนัดชำระหนี้ หรือมีพฤติการณ์ว่าจะไม่สามารถชำระหนี้ได้ (ถ้ามี) : -ไม่มี-
- ข้อมูลการรับชำระหนี้ด้วยทรัพย์สินอื่น (ถ้ามี) : -ไม่มี-
- รายงานข้อมูลการถือหน่วยลงทุนเกินข้อจำกัดการถือหน่วยลงทุน (ถ้ามี) : -ไม่มี-
- ข้อมูลการดำเนินการใช้สิทธิออกเสียงในที่ประชุมผู้ถือหุ้นในนามกองทุนรวมของรอบปีปฏิทินล่าสุด :

ผู้ลงทุนสามารถตรวจสอบแนวทางการใช้สิทธิออกเสียงและการดำเนินการใช้สิทธิออกเสียงได้ทางเว็บไซต์ของบริษัทจัดการที่ <http://www.one-asset.com>

การรับผลประโยชน์ตอบแทนเนื่องจากการที่กองทุนเปิด วรรณ อัลติเมท ยิลด์ 6M ห้ามขายผู้ลงทุนรายย่อย (ONE-UY6M) ใช้บริการบุคคลอื่น ๆ (Soft Commission)

	บริษัทที่ให้ผลประโยชน์	ผลประโยชน์ที่ได้รับ	เหตุผลในการรับผลประโยชน์
1	บล.บัวหลวง จำกัด (มหาชน)	ข่าวสาร และบทวิเคราะห์ ฯลฯ	เพื่อประโยชน์ในการลงทุนของกองทุน
2	บล.ทิสโก้ จำกัด	ข่าวสาร และบทวิเคราะห์ ฯลฯ	เพื่อประโยชน์ในการลงทุนของกองทุน
3	บล.เอไอซี จำกัด (มหาชน)	ข่าวสาร และบทวิเคราะห์ ฯลฯ	เพื่อประโยชน์ในการลงทุนของกองทุน
4	บล.ดีปีส โอเคเคอร์ส (ประเทศไทย) จำกัด	ข่าวสาร และบทวิเคราะห์ ฯลฯ	เพื่อประโยชน์ในการลงทุนของกองทุน
5	บล.ซีจีเอส-ซีไอเอ็มบี (ประเทศไทย) จำกัด	ข่าวสาร และบทวิเคราะห์ ฯลฯ	เพื่อประโยชน์ในการลงทุนของกองทุน
6	บล.ภัทร จำกัด (มหาชน)	ข่าวสาร และบทวิเคราะห์ ฯลฯ	เพื่อประโยชน์ในการลงทุนของกองทุน
7	บล.เอเชีย พลัส จำกัด	ข่าวสาร และบทวิเคราะห์ ฯลฯ	เพื่อประโยชน์ในการลงทุนของกองทุน
8	บล.เครดิต สวิส (ประเทศไทย) จำกัด	ข่าวสาร และบทวิเคราะห์ ฯลฯ	เพื่อประโยชน์ในการลงทุนของกองทุน
9	บล.กลีกรไทย จำกัด (มหาชน)	ข่าวสาร และบทวิเคราะห์ ฯลฯ	เพื่อประโยชน์ในการลงทุนของกองทุน
10	บล.เคจีไอ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)	ข่าวสาร และบทวิเคราะห์ ฯลฯ	เพื่อประโยชน์ในการลงทุนของกองทุน
11	บล.โนมูระ พัฒนสิน จำกัด (มหาชน)	ข่าวสาร และบทวิเคราะห์ ฯลฯ	เพื่อประโยชน์ในการลงทุนของกองทุน
12	บล.กรุงศรี จำกัด (มหาชน)	ข่าวสาร และบทวิเคราะห์ ฯลฯ	เพื่อประโยชน์ในการลงทุนของกองทุน
13	บล.ธนาชาต จำกัด (มหาชน)	ข่าวสาร และบทวิเคราะห์ ฯลฯ	เพื่อประโยชน์ในการลงทุนของกองทุน
14	บล.ทรีนิตี้ จำกัด	ข่าวสาร และบทวิเคราะห์ ฯลฯ	เพื่อประโยชน์ในการลงทุนของกองทุน
15	บล.ไทยพาณิชย์ จำกัด	ข่าวสาร และบทวิเคราะห์ ฯลฯ	เพื่อประโยชน์ในการลงทุนของกองทุน
16	บล.ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)	ข่าวสาร และบทวิเคราะห์ ฯลฯ	เพื่อประโยชน์ในการลงทุนของกองทุน
17	บล.ยูโอบี เคย์เฮียน (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)	ข่าวสาร และบทวิเคราะห์ ฯลฯ	เพื่อประโยชน์ในการลงทุนของกองทุน
18	บล.อาร์ เอช บี (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)	ข่าวสาร และบทวิเคราะห์ ฯลฯ	เพื่อประโยชน์ในการลงทุนของกองทุน
19	บล.เจพี มอร์แกน (ประเทศไทย) จำกัด	ข่าวสาร และบทวิเคราะห์ ฯลฯ	เพื่อประโยชน์ในการลงทุนของกองทุน
20	บล.เมย์แบงก์ กิมเอ็ง (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)	ข่าวสาร และบทวิเคราะห์ ฯลฯ	เพื่อประโยชน์ในการลงทุนของกองทุน
21	บล.ซี แอล เอส เอ (ประเทศไทย) จำกัด	ข่าวสาร และบทวิเคราะห์ ฯลฯ	เพื่อประโยชน์ในการลงทุนของกองทุน
22	บล.เคที ซีมิโก้ จำกัด	ข่าวสาร และบทวิเคราะห์ ฯลฯ	เพื่อประโยชน์ในการลงทุนของกองทุน
23	บล.โกลเบล็ก จำกัด	ข่าวสาร และบทวิเคราะห์ ฯลฯ	เพื่อประโยชน์ในการลงทุนของกองทุน
24	บล.เคทีบี (ประเทศไทย) จำกัด	ข่าวสาร และบทวิเคราะห์ ฯลฯ	เพื่อประโยชน์ในการลงทุนของกองทุน

แบบ 117-5

แบบแสดงค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจาก

กองทุนเปิด วรรณ อัลติเมท ยิลด์ 6M ห้ามขายผู้ลงทุนรายย่อย (ONE-UY6M)

ของรอบระยะเวลา 6 เดือน ตั้งแต่วันที่ 31 ตุลาคม 2561 ถึงวันที่ 31 มีนาคม 2562

ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (Fund's Direct Expenses)	จำนวนเงิน หน่วย : พันบาท	ร้อยละของ มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ (รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม)
ค่าธรรมเนียมการจัดการ (management fee)	501.29	0.16
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ (trustee fee)	41.20	0.01
ค่าธรรมเนียมที่ปรึกษาการลงทุน (advisory fee)	ไม่มี	ไม่มี
ค่านายทะเบียน (registrar fee)	137.32	0.05
ค่าใช้จ่ายในการสอบบัญชี	25.06	0.01
ค่าใช้จ่ายอื่นๆ	40.72	0.01
รวมค่าใช้จ่ายทั้งหมด*	745.59	0.24

*ไม่รวมค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์และค่าธรรมเนียมต่างๆ ที่เกิดขึ้นจากการซื้อขายหลักทรัพย์

ค่าเฉลี่ยของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน 308,174,826.16 บาท

รายละเอียดการลงทุน
กองทุนเปิด วรรณ อัลติเมท ยิลด์ 6M ห้ามขายผู้ลงทุนรายย่อย (ONE-UY6M)
ณ วันที่ 31 มีนาคม 2562

หลักทรัพย์ หรือทรัพย์สินในประเทศ	มูลค่าตาม ราคาตลาด (บาท)	% NAV
ตัวเงินคลัง	-	-
พันธบัตรรัฐบาล		
อายุคงเหลือน้อยกว่า 1ปี	-	-
อายุคงเหลือ 1-3 ปี	-	-
อายุคงเหลือมากกว่า 3 ปี	-	-
พันธบัตร ธนาคารแห่งประเทศไทย/ รัฐวิสาหกิจ / กองทุนเพื่อการฟื้นฟูฯ		
อายุคงเหลือน้อยกว่า 1ปี	-	-
อายุคงเหลือ 1-3 ปี	-	-
อายุคงเหลือมากกว่า 3 ปี	-	-
หุ้นกู้		
Rate AAA	-	-
Rate AA	-	-
Rate AA-	-	-
Rate A+	-	-
Rate A	-	-
Rate A-	-	-
Rate BBB+	50,419,385.50	16.28%
Rate T1+	-	-
Non-rated	-	-
ตัวแลกเงิน/ตัวสัญญาใช้เงิน	249,164,709.00	80.47%
เงินฝากบมจ.ธ.กรุงเทพ	10,209,070.77	3.30%
สินทรัพย์อื่น ๆ	7,936.88	0.00%
หนี้สินอื่น ๆ	(167,738.07)	-0.05%
รวมทรัพย์สินสุทธิของกองทุน	309,633,364.08	100.00%

กองทุนเปิด วรรณ อัลติเมท ยิลด์ 6M ห้ามขายผู้ลงทุนรายย่อย (ONE-UY6M)
ณ วันที่ 31 มีนาคม 2562
มูลค่าทรัพย์สินต่อหน่วยลงทุน 10.0966 บาท

รายละเอียดการลงทุนในตราสารหนี้ที่ออกโดยนิติบุคคลไทยหรือตราสารที่เสนอขายในประเทศไทย
กองทุนเปิด วรรณ อัลติเมท ยิลด์ 6M ห้ามขายผู้ลงทุนรายย่อย (ONE-UY6M) ณ วันที่ 31 มีนาคม 2562

ประเภท	ผู้ออก	ผู้ค้า/ผู้รับรอง ผู้สลับหลัง	วันครบ กำหนด	อันดับ ความน่าเชื่อถือ	จำนวนหน่วย/ มูลค่าหน้าตัว	มูลค่าตาม ราคาตลาด	% NAV
1. หุ้นกู้	บริษัท เอเซียเสริมกิจลีสซิ่ง จำกัด (มหาชน)	ASK19502A	02/05/2019	BBB+	50,000.00	50,419,385.50	16.28%
2. ตัวแลกเปลี่ยน	บริษัท กันกุลเอ็นจิเนียริ่ง จำกัด (มหาชน)	GUNKUL1950	08/05/2019	BBB	50,000.00	49,878,683.50	16.11%
	บริษัท ไทยฟูดส์ กรุ๊ป จำกัด(มหาชน)	TFG19508A	08/05/2019	BBB-	50,000.00	49,790,995.00	16.08%
	บริษัท พร็อพเพอร์ตี้ เพอร์เฟก จำกัด (มหาชน)	PF19508A	08/05/2019	BB+	50,000.00	49,788,865.00	16.08%
	บริษัท เอส 11 กรุ๊ป จำกัด (มหาชน)	SG19508A	08/05/2019	BBB-	50,000.00	49,831,189.00	16.09%
	บริษัทหลักทรัพย์ เพื่อธุรกิจหลักทรัพย์ จำกัด	TSFC19508A	08/05/2019	BBB-	50,000.00	49,874,976.50	16.11%
3. เงินฝาก	บมจ.ธ.กรุงเทพ			AA+(tha)		10,209,070.77	3.30%
4. สินทรัพย์อื่นๆ						7,936.88	0.00%
5. หนี้สินอื่นๆ						(167,738.07)	-0.05%
รวมมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน						309,633,364.08	100.00%

คำอธิบายการจัดอันดับความน่าเชื่อถือของตราสาร

ตราสารหนี้ระยะยาว

AAA	อันดับเครดิตสูงสุด มีความเสี่ยงต่ำที่สุด บริษัทมีความสามารถในการชำระดอกเบี้ยและคืนเงินต้นในเกณฑ์สูงสุด และได้รับผลกระทบน้อยมากจากการเปลี่ยนแปลงทางธุรกิจ เศรษฐกิจ และสิ่งแวดล้อมอื่นๆ
AA	มีความเสี่ยงต่ำมาก บริษัทมีความสามารถในการชำระดอกเบี้ยและคืนเงินต้นในเกณฑ์สูงมาก แต่อาจได้รับผลกระทบจากการเปลี่ยนแปลงทางธุรกิจ เศรษฐกิจ และสิ่งแวดล้อม
อื่นๆ	มากกว่าอันดับเครดิตที่อยู่ในระดับ AAA
A	มีความเสี่ยงในระดับต่ำ บริษัทมีความสามารถในการชำระดอกเบี้ยและคืนเงินต้นในเกณฑ์สูง แต่อาจได้รับผลกระทบจากการเปลี่ยนแปลงทางธุรกิจ เศรษฐกิจ และสิ่งแวดล้อม
อื่นๆ	มากกว่าอันดับเครดิตที่อยู่ในระดับสูงกว่า
BBB	มีความเสี่ยงในระดับปานกลาง บริษัทมีความสามารถในการชำระดอกเบี้ยและคืนเงินต้นในเกณฑ์ที่เพียงพอ แต่มีความอ่อนไหวต่อการเปลี่ยนแปลงทางธุรกิจ เศรษฐกิจ และสิ่งแวดล้อมอื่นๆ มากกว่า และอาจมีความสามารถในการชำระหนี้ที่อ่อนแอลงเมื่อเทียบกับอันดับเครดิตที่อยู่ในระดับสูงกว่า
BB	มีความเสี่ยงในระดับสูง บริษัทมีความสามารถในการชำระดอกเบี้ยและคืนเงินต้นในเกณฑ์ต่ำกว่าระดับปานกลาง และจะได้รับผลกระทบจากการเปลี่ยนแปลงทางธุรกิจ และสิ่งแวดล้อมอื่นๆ ค่อนข้างชัดเจน ซึ่งอาจส่งผลให้ความสามารถในการชำระหนี้ในเกณฑ์ที่ไม่เพียงพอ
B	มีความเสี่ยงในระดับสูงมาก บริษัทมีความสามารถในการชำระดอกเบี้ยและคืนเงินต้นในเกณฑ์ต่ำ และอาจจะหมดความสามารถหรือความตั้งใจในการชำระหนี้ได้ตามการเปลี่ยนแปลงของสถานการณ์ทางธุรกิจ เศรษฐกิจ และสิ่งแวดล้อมอื่นๆ
C	มีความเสี่ยงในการผิดนัดชำระหนี้สูงที่สุด บริษัทไม่มีความสามารถในการชำระดอกเบี้ยและคืนเงินต้นตามกำหนดอย่างชัดเจน โดยต้องอาศัยเงื่อนไขที่เอื้ออำนวยทางธุรกิจ เศรษฐกิจ และสิ่งแวดล้อมอื่นๆ อย่างมากจึงจะสามารถชำระหนี้ได้
D	เป็นระดับที่อยู่ในสถานะผิดนัดชำระหนี้ โดยผู้ออกตราสารหนี้ไม่สามารถชำระดอกเบี้ยและคืนเงินต้นได้ตามกำหนด
อันดับเครดิตจาก AA ถึง C อาจมีเครื่องหมายบวก (+) หรือลบ (-) ต่อท้าย เพื่อจำแนกความแตกต่างของคุณภาพของอันดับเครดิตภายในระดับเดียวกัน	

ตราสารหนี้ระยะสั้นที่มีอายุต่ำกว่า 1 ปี

T1/F1	ผู้ออกตราสารหนี้มีสถานะทั้งทางด้านการตลาดและการเงินที่แข็งแกร่งในระดับดีมาก มีสภาพคล่องที่ดีมาก และนักลงทุนจะได้รับความคุ้มครองจากการผิดนัดชำระหนี้ที่ต่ำกว่าอันดับเครดิตในระดับอื่น ผู้ออกตราสารที่ได้รับอันดับเครดิตในระดับดังกล่าวซึ่งมีเครื่องหมาย "+" ด้วยจะได้รับความคุ้มครองด้านการผิดนัดชำระหนี้ที่สูงยิ่งขึ้น
T2/F2	ผู้ออกตราสารหนี้มีสถานะทั้งทางด้านการตลาดและการเงินที่แข็งแกร่งในระดับดี และมีความสามารถในการชำระหนี้ระยะสั้นในระดับที่น่าพอใจ
T3/F3	ผู้ออกตราสารหนี้มีความสามารถในการชำระหนี้ระยะสั้นในระดับที่ยอมรับได้
T4	ผู้ออกตราสารหนี้มีความสามารถในการชำระหนี้ระยะสั้นที่ค่อนข้างอ่อนแอ

รายงานสรุปเงินลงทุน เฉพาะการลงทุนในตราสารหนี้ที่เสนอขายในประเทศไทย

ONE ULTIMATE YIELD FUND 6M NOT FOR RETAIL INVESTORS : ONE-UY6M

ณ วันที่ 31 มีนาคม 2562

กลุ่มของตราสาร	มูลค่าตามราคา ตลาด (บาท)	% NAV
(ก) ตราสารภาครัฐไทย และตราสารภาครัฐต่างประเทศ	-	0.00%
(ข) ตราสารที่ธนาคารที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้น ธนาคารพาณิชย์ หรือบริษัทเงินทุน เป็นผู้ออก ผู้รับรอง ผู้รับอาวัล ผู้สลับหลัง หรือผู้ค้ำประกัน	10,209,070.77	3.30%
(ค) ตราสารที่มีอันดับความน่าเชื่อถืออยู่ในอันดับที่สามารถลงทุนได้ (Investment grade)	249,795,229.50	80.67%
(ง) ตราสารที่มีอันดับความน่าเชื่อถืออยู่ในอันดับต่ำกว่าที่สามารถลงทุนได้ (Investment grade) หรือตราสารที่ไม่ได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือ	49,788,865.00	16.08%

สัดส่วนสูงสุดที่บริษัทจัดการคาดว่าจะลงทุนในกลุ่ม (ง) คือไม่เกิน 15% ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุนรวม (NAV)

NET ASSET VALUE

309,633,364.08

BAHT

กองทุนเปิด วรรณ อัลติเมท ยิลด์ 6M ห้ามขายผู้ลงทุนรายย่อย (ONE-UY6M)

งบดุล

ณ วันที่ 31 มีนาคม 2562

	31 ต.ค.61-31 มี.ค.62
สินทรัพย์	
เงินลงทุนตามมูลค่ายุติธรรม (ราคาทุน 299,189,797.00 บาท)	299,157,245.00
เงินฝากธนาคาร	10,207,261.25
ลูกหนี้	
จากดอกเบี้ย	428,659.02
ค่าใช้จ่ายรอการตัดบัญชีตัดจ่าย	7,936.88
รวมสินทรัพย์	309,801,102.15
หนี้สิน	
เจ้าหนี้	
ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย	164,220.86
หนี้สินอื่น	3,517.21
รวมหนี้สิน	167,738.07
สินทรัพย์สุทธิ	309,633,364.08
สินทรัพย์สุทธิ:	
ทุนที่ได้รับจากผู้ถือหน่วยลงทุน	306,670,042.49
กำไร(ขาดทุน)สะสม	
กำไรสะสมจากการดำเนินงาน	2,963,321.59
สินทรัพย์สุทธิ	309,633,364.08
	-
สินทรัพย์สุทธิต่อหน่วย	10.0966
จำนวนหน่วยลงทุนที่จำหน่ายแล้วทั้งหมด ณ วันสิ้นปี (หน่วย)	30,667,004.2490

หมายเหตุ: *งบการเงินนี้ยังไม่ได้ผ่านการสอบทานหรือรับรองจากผู้สอบบัญชี

กองทุนเปิด วรรณ อัลติเมท ยิลด์ 6M ห้ามขายผู้ลงทุนรายย่อย (ONE-UY6M)

งบกำไรขาดทุน

สำหรับระยะเวลาตั้งแต่วันที่ 31 ตุลาคม 2561(วันจดทะเบียนตั้งกองทุน) ถึงวันที่ 31 มีนาคม 2562

	31 ต.ค.61-31 มี.ค.62
รายได้จากการลงทุน	
รายได้ดอกเบี้ย	3,741,467.18
รวมรายได้	3,741,467.18
ค่าใช้จ่าย	
ค่าธรรมเนียมการจัดการ	501,293.69
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์	41,196.87
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน	137,323.19
ค่าธรรมเนียมวิชาชีพ	25,055.68
ค่าใช้จ่ายในการดำเนินงาน	40,724.16
รวมค่าใช้จ่าย	745,593.59
รายได้จากการลงทุนสุทธิ	2,995,873.59
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิจากเงินลงทุน	
รายการขาดทุนสุทธิที่ยังไม่เกิดขึ้นจากเงินลงทุน	(32,552.00)
รวมรายการขาดทุนสุทธิจากเงินลงทุนที่เกิดขึ้นและที่ยังไม่เกิดขึ้น	(32,552.00)
การเพิ่มขึ้นในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงาน	2,963,321.59

หมายเหตุ: *งบการเงินนี้ยังไม่ได้ผ่านการสอบทานหรือรับรองจากผู้สอบบัญชี

กองทุนเปิด วรรณ อัลติเมท ยิลด์ 6M ห้ามขายผู้ลงทุนรายย่อย (ONE-UY6M)
งบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน
ณ วันที่ 31 มีนาคม 2562

การแสดงรายละเอียดเงินลงทุนใช้การจัดกลุ่มตามประเภทของเงินลงทุน

	วันครบกำหนด	อัตราดอกเบี้ย ร้อยละ	เงินต้น / จำนวนหน่วย	มูลค่ายุติธรรม (บาท)	ร้อยละของ มูลค่าเงินลงทุน
ตัวแลกเปลี่ยน				249,164,709.00	83.29
บริษัท กันกุลเอ็นจิเนียริง จำกัด (มหาชน)	08/05/2562	-	50,000,000.00	49,878,683.50	16.67
บริษัท ไทยฟูดส์ กรุ๊ป จำกัด(มหาชน)	08/05/2562	-	50,000,000.00	49,790,995.00	16.65
บริษัท พร็อพเพอร์ตี้ เพอร์เฟค จำกัด (มหาชน)	08/05/2562	-	50,000,000.00	49,788,865.00	16.64
บริษัท เอส 11 กรุ๊ป จำกัด (มหาชน)	08/05/2562	-	50,000,000.00	49,831,189.00	16.66
บริษัทหลักทรัพย์ เพื่อธุรกิจหลักทรัพย์ จำกัด	08/05/2562	-	50,000,000.00	49,874,976.50	16.67
หุ้นกู้				49,992,536.00	16.71
บริษัท เอเซียเสริมกิจลีสซิ่ง จำกัด (มหาชน)	02/05/2562	2.0500	50,000,000.00	49,992,536.00	16.71
รวมเงินลงทุน (ราคาทุน 299,189,797.00 บาท)				299,157,245.00	100.00

หมายเหตุ : *งบการเงินนี้ยังไม่ได้ผ่านการสอบทานหรือรับรองจากผู้สอบบัญชี

รายงานความเห็นของบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน วรรณ จำกัด
ในฐานะบริษัทจัดการของกองทุนเปิด วรรณ อัลติเมท ยิลด์ 6M ห้ามขายผู้ลงทุนรายย่อย (ONE-UY6M)

เรียน ท่านผู้ถือหน่วยลงทุนกองทุนเปิด วรรณ อัลติเมท ยิลด์ 6M ห้ามขายผู้ลงทุนรายย่อย (ONE-UY6M)

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน วรรณ จำกัด (บลจ. วรรณ) ขอส่งรายงานรอบระยะเวลา 6 เดือนแรก ตั้งแต่วันที่ 31 ตุลาคม 2561 ถึงวันที่ 31 มีนาคม 2562 ของกองทุนเปิด วรรณ อัลติเมท ยิลด์ 6M ห้ามขายผู้ลงทุนรายย่อย (ONE-UY6M)

ในรอบระยะเวลาที่ผ่านมากองทุนเปิด วรรณ อัลติเมท ยิลด์ 6M ห้ามขายผู้ลงทุนรายย่อย (ONE-UY6M) มีผลการดำเนินงานย้อนหลังอยู่ที่ 0.95% โดยดัชนีชี้วัด คือ กองทุนไม่สามารถเปิดเผยดัชนีเทียบผลตอบแทนกองทุนได้เนื่องจากไม่มีดัชนีเทียบวัดที่เหมาะสมสำหรับพันธบัตรของประเทศที่ลงทุน ซึ่งการไม่เปิดเผยดัชนีเทียบวัดดังกล่าวไม่ได้ส่งผลกระทบต่อการวัดผลการดำเนินงานของกองทุน เนื่องจากกองทุนถือครองตราสารจนครบกำหนดอายุโครงการ (Buy and Hold)

กองทุนเปิด วรรณ อัลติเมท ยิลด์ 6M ห้ามขายผู้ลงทุนรายย่อย (ONE-UY6M) กองทุนมีนโยบายลงทุนในพันธบัตรหรือตราสารแห่งหนึ่งที่มีคุณภาพและให้ผลตอบแทนที่เหมาะสมที่เสนอขายในประเทศและ/หรือต่างประเทศกองทุนจะลงทุนในตราสารหนี้ที่มีอันดับความน่าเชื่อถือต่ำกว่าที่สามารถลงทุนได้(Non-Investment Grade) และตราสารหนี้ที่ไม่ได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือ (Unrated Securities) นอกจากนี้ กองทุนอาจลงทุนในหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินอื่นหรือการหาดอกผลโดยวิธีอื่นอย่างใดอย่างหนึ่งหรือหลายอย่างที่ไม่ขัดต่อกฎหมาย ก.ล.ต.และกองทุนอาจพิจารณาลงทุนในพันธบัตรหรือตราสารแห่งหนึ่งเสนอขายในต่างประเทศ ไม่เกินร้อยละ 79 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน ทั้งนี้ ในกรณีที่กองทุนมีการลงทุนในพันธบัตรหรือตราสารแห่งหนึ่งเสนอขายในต่างประเทศ กองทุนจะลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเพื่อลดหรือป้องกันความเสี่ยงด้านอัตราแลกเปลี่ยนทั้งหมด (Fully Hedge)

กองทุนอาจลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) เพื่อลดความเสี่ยง (Hedging) ด้านอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ แต่กองทุนจะไม่ลงทุนในตราสารหนี้ที่มีลักษณะของสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแบ่ง (Structured Note) แต่อาจพิจารณาลงทุนในตราสารที่ได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือของตราสารหรือของผู้ออกตราสารจากสถาบันจัดอันดับความน่าเชื่อถือที่ได้รับการยอมรับจากสำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ต.อยู่ในอันดับที่สามารถลงทุนได้ (Investment Grade)โดยในกรณีที่ตราสารดังกล่าวเป็นหุ้นกู้ด้อยสิทธิ (Subordinated Debt) ตั๋วตราสารหนี้จะต้องได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือของตราสาร (Issue Rating) อยู่ในอันดับที่สามารถลงทุนได้ (Investment Grade) เท่านั้น ฯลฯ

โดยในรอบระยะเวลา 6 เดือนที่ผ่านมาตั้งแต่เดือนตุลาคม 2561 ถึงเดือนมีนาคม 2562 คณะกรรมการนโยบายการเงินของธนาคารแห่งประเทศไทย มีการประชุมจำนวน 4 ครั้ง โดย กนง. มีมติปรับขึ้นอัตราดอกเบี้ยตลาดซื้อคืนพันธบัตรระยะ 1 วัน 1 ครั้งในการประชุมรอบเดือนธันวาคม 2561 โดยเป็นการปรับเพิ่มอัตราดอกเบี้ยธุรกรรมตลาดซื้อคืนจากร้อยละ 1.50 เป็นร้อยละ 1.75 สำหรับอัตราดอกเบี้ยเงินฝากและอัตราดอกเบี้ยเงินกู้ของธนาคารพาณิชย์ ตั้งแต่เดือนตุลาคม 2561 ถึงเดือนมีนาคม 2562 อยู่ในระดับทรงตัว โดย ณ สิ้นเดือนมีนาคม 2562 อัตราดอกเบี้ยเงินฝากออมทรัพย์ อยู่ที่ระดับร้อยละ 0.500-0.625 อัตราดอกเบี้ยเงินฝากประจำ 3 เดือนอยู่ที่ระดับร้อยละ 0.900-1.150 อัตราดอกเบี้ยเงินฝากประจำ 6 เดือนอยู่ที่ระดับร้อยละ 1.150-1.400 อัตราดอกเบี้ยเงินฝากประจำ 1 ปี อยู่ที่ระดับร้อยละ 1.300-1.6500 และอัตราดอกเบี้ยเงินกู้ยืมแบบมีระยะเวลา (MLR) อยู่ที่ระดับ 6.025-6.275%

สำหรับภาวะตลาดตราสารหนี้ไทย ในช่วงตั้งแต่เดือนตุลาคม 2561 ถึงเดือนมีนาคม 2562 อัตราผลตอบแทนของพันธบัตรปรับโดยรวมปรับตัวเพิ่มขึ้นในช่วงอายุไม่เกิน 2 ปี และปรับตัวลดลงในช่วงอายุมากกว่า 2 ปี ขึ้นไป โดยอัตราผลตอบแทนของพันธบัตรรัฐบาลช่วงอายุไม่เกิน 2 ปี ปรับตัวเพิ่มขึ้นโดยเฉลี่ย 6-43 Bps (Basis Point) ช่วงอายุ 2 - 10 ปี ปรับตัวลดลงโดยเฉลี่ย 18-31 bps ช่วงอายุ 10 - 30 ปี ปรับตัวลดลงโดยเฉลี่ย 17-39 bps ช่วงอายุมากกว่า 30 ปี ปรับตัวลดลงโดยเฉลี่ย 10-17 bps

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน วรรณ จำกัด ขอขอบพระคุณท่านผู้ถือหน่วยลงทุนทุกท่านที่ได้มอบหมายความไว้วางใจให้บริษัทดูแลเงินลงทุนของท่าน ทั้งนี้ บริษัทฯ จะยังคงมุ่งมั่นบริหารเงินลงทุนของผู้ลงทุนด้วยความรอบคอบระมัดระวังและมีประสิทธิภาพเพื่อประโยชน์สูงสุดของท่านผู้ถือหน่วยลงทุน

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน วรรณ จำกัด

ข้อมูล ณ วันที่ 29/03/2019	3 เดือน	Since Inception Return1
ONE-UY6M	0.57%	0.95%
N/A	-	-
Information Ratio	-	-
ความผันผวนของผลการดำเนินงาน	0.66%	0.66%
ความผันผวนของ N/A	-	-
หมายเหตุ 1หน่วย: % ต่อปี		
* Information Ratio : แสดงความสามารถของผู้จัดการกองทุนในการสร้างผลตอบแทนเมื่อเทียบกับความเสี่ยง		
หมายเหตุ *การวัดผลการดำเนินงานนี้ ได้จัดทำขึ้นตามมาตรฐานการวัดผลการดำเนินงานของสมาคมบริษัทจัดการลงทุน (AIMC)		
Portfolio Turnover Ratio	(31/10/2018 - 31/03/2019)	0.00