

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

รายงานของรอบระยะเวลา 6 เดือน
กองทุนเปิด วรณ อัลติเมท ยิลด์ 6M ห้ามขายผู้ลงทุนรายย่อย (ONE-UY6M)
 ตั้งแต่วันที่ 1 ตุลาคม 2562 ถึง 31 มีนาคม 2563

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

ประเภทของกองทุน :	กองทุนรวมผสม	กองทุนรวมสำหรับ ผู้ลงทุนที่มีใช้รายย่อยเท่านั้น
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. และกองทุนอาจพิจารณาลงทุนในพันธบัตรหรือตราสารแห่งหนึ่งเสนอขายในต่างประเทศ ไม่เกินร้อยละ 79 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน ทั้งนี้ ในกรณีที่กองทุนมีการลงทุนในพันธบัตรหรือตราสารแห่งหนึ่งเสนอขายในต่างประเทศ กองทุนจะลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเพื่อลดหรือป้องกันความเสี่ยงด้านอัตราแลกเปลี่ยนทั้งหมด (Fully Hedge) กองทุนอาจลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) เพื่อลดความเสี่ยง (Hedging) ด้านอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ แต่กองทุนจะไม่ลงทุนในตราสารหนี้ที่มีลักษณะของสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแปง (Structured Note) แต่อาจพิจารณาลงทุนในตราสารที่ได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือของตราสารหรือของผู้ออกตราสารจากสถาบันจัดอันดับความน่าเชื่อถือที่ได้รับการยอมรับจากสำนักงานคณะกรรมการ 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.วรณ จำกัด ได้รับการรับรอง CAC	
วันทำการซื้อ / ขายคืน / สับเปลี่ยนหน่วยลงทุน : ทุกรอบระยะเวลาประมาณ 6 เดือน ถัดจากวันทำการซื้อขายหน่วยลงทุนครั้งล่าสุด โดยบริษัทจัดการจะแจ้งวันทำการซื้อขายหน่วยลงทุนรอบถัดไปให้ผู้ถือหน่วยลงทุนทราบภายใน 15 วัน หลังจากวันจดทะเบียนกองทรัสต์เป็นกองทุนรวม ต่อสำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ต. และ/หรือ ภายใน 15 วัน หลังจากวันทำการซื้อขายหน่วยลงทุนครั้งล่าสุด โดยจะปิดประกาศ ณ สำนักงานของบริษัทจัดการ สถานที่ติดต่อของผู้สนับสนุนการขายหรือรับซื้อคืนหน่วยลงทุน และประกาศผ่านทางเว็บไซต์ของบริษัทจัดการ ฯลฯ การรับซื้อคืนหน่วยลงทุนโดยอัตโนมัติ : บริษัทจัดการอาจดำเนินการรับซื้อคืนหน่วยลงทุนโดยอัตโนมัติหรือไม่รับซื้อคืนหน่วยลงทุนโดยอัตโนมัติ ทั้งนี้ ในกรณีที่มีการรับซื้อคืนหน่วยลงทุนโดยอัตโนมัติ บริษัทจัดการจะดำเนินการรับซื้อคืนหน่วยลงทุนโดยอัตโนมัติ ณ สิ้นรอบการลงทุนแต่ละรอบจากจำนวนเงินที่จัดสรรจากเงินสดรับที่ได้จากดอกเบี้ย 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	
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุนของกองทุนรวม (Portfolio Turnover Ratio) (01/10/2019 - 31/03/2020) : 0.18		

หมายเหตุ : ค่าธรรมเนียม และค่าใช้จ่ายดังกล่าวข้างต้น เป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่มแล้ว

NAV หมายถึง มูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน

สอบถามข้อมูลเพิ่มเติมพร้อมรับหนังสือชี้ชวนได้ที่ :

บลจ.วรณ จำกัด ชั้น 9, 24 อาคารสยามพวรวรรณทาวเวอร์ โทร. 0-2659-8888 กด 1 ฝ่ายลูกค้าสัมพันธ์และสนับสนุนธุรกิจ หรือที่ผู้สนับสนุนการขายหรือรับซื้อคืนหน่วยลงทุนที่ได้รับการแต่งตั้งจากบลจ.วรณ



ความเห็นของผู้ดูแลผลประโยชน์

วันที่ 20 เมษายน 2563

เรียน ผู้ถือหน่วยลงทุนกองทุนเปิด วรรณ อัลติเมท ยิลด์ 6M ห้ามขายผู้ลงทุนรายย่อย

ธนาคารกรุงเทพ จำกัด (มหาชน) ในฐานะผู้ดูแลผลประโยชน์ ได้ดูแลการจัดการกองทุนเปิด วรรณ อัลติเมท ยิลด์ 6M ห้ามขายผู้ลงทุนรายย่อย ซึ่งจัดการโดยบริษัท หลักทรัพย์จัดการกองทุน วรรณ จำกัด สำหรับระยะเวลาดังตั้งแต่วันที่ 1 ตุลาคม 2562 ถึงวันที่ 31 มีนาคม 2563 แล้วนั้น

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

(นายฤดี สิทธิชลิต)
ธนาคารกรุงเทพ จำกัด (มหาชน)
ในฐานะผู้ดูแลผลประโยชน์

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 (1 ตุลาคม 2562 - 31 มีนาคม 2563)

-ไม่มี-

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

ผู้จัดการกองทุน

- | | | | |
|-------------------------------|----------------------------|----------------------------------|-------------------------|
| 1. นายมงคล จันทะ | 2. นายวิญญู ศรีวิริยานนท์ | 3. นายสันธาน เสงสกุล | 4. นายบัญชา จึงวัฒนกิจ |
| 5. นายเกรียงไกร ทำนุทัศน์ | 6. น.ส.จารุภัทร์ ศรีจำเริญ | 7. น.ส.จันทร์เพ็ญ ชวงษ์ | 8. น.ส.พรอมา เทวาทูดี |
| 9. น.ส.ประภาภรณ์ ชื้อเจริญกิจ | 10. น.ส.กวิศา เหมเวช | 11. นายสุทธิโรจน์ สิทธิพัฒนานนท์ | 12. นายสิทธิ จ่างตระกูล |
| 13. นายธีรธรรม 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.ทีเอสโก้ จำกัด	ข่าวสาร และบทวิเคราะห์ ฯลฯ	เพื่อประโยชน์ในการลงทุนของกองทุน
3	บล.เออีซี จำกัด (มหาชน)	ข่าวสาร และบทวิเคราะห์ ฯลฯ	เพื่อประโยชน์ในการลงทุนของกองทุน
4	บล.ดีบีเอส วิกเคอร์ส (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.ธนชาต จำกัด (มหาชน)	ข่าวสาร และบทวิเคราะห์ ฯลฯ	เพื่อประโยชน์ในการลงทุนของกองทุน
14	บล.ทรินิตี้ 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 เคียเอ็น (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 (มหาชน)	ข่าวสาร และบทวิเคราะห์ ฯลฯ	เพื่อประโยชน์ในการลงทุนของกองทุน

แบบ 117-5

แบบแสดงค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจาก

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

ของรอบระยะเวลา 6 เดือน ตั้งแต่วันที่ 1 ตุลาคม 2562 ถึงวันที่ 31 มีนาคม 2563

ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (Fund's Direct Expenses)	จำนวนเงิน หน่วย : พันบาท	ร้อยละของ มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ (รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม)
ค่าธรรมเนียมการจัดการ (management fee)	569.62	0.29
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ (trustee fee)	31.31	0.02
ค่าธรรมเนียมที่ปรึกษาการลงทุน (advisory fee)	ไม่มี	ไม่มี
ค่านายทะเบียน (registrar fee)	136.25	0.07
ค่าใช้จ่ายในการสอบบัญชี	15.00	0.01
ค่าใช้จ่ายอื่นๆ	0.75	0.00
รวมค่าใช้จ่ายทั้งหมด*	752.93	0.39

*ไม่รวมค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์และค่าธรรมเนียมต่าง ๆ ที่เกิดขึ้นจากการซื้อขายหลักทรัพย์

ค่าเฉลี่ยของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน	194,774,889.44	บาท
---	----------------	-----

รายละเอียดการลงทุน
กองทุนเปิด วรรณ อัลติเมท ยิลด์ 6M ห้ามขายผู้ลงทุนรายย่อย (ONE-UY6M)
ณ วันที่ 31 มีนาคม 2563

หลักทรัพย์ หรือทรัพย์สินในประเทศ	มูลค่าตาม ราคาตลาด (บาท)	% NAV
ตัวเงินคลัง	-	-
<u>พันธบัตรรัฐบาล</u>		
อายุคงเหลือน้อยกว่า 1ปี	-	-
อายุคงเหลือ 1-3 ปี	-	-
อายุคงเหลือมากกว่า 3 ปี	-	-
<u>พันธบัตร ธนาคารแห่งประเทศไทย / รัฐวิสาหกิจ / กองทุนเพื่อการฟื้นฟูฯ</u>		
อายุคงเหลือน้อยกว่า 1ปี	999,031.90	0.54%
อายุคงเหลือ 1-3 ปี	-	-
อายุคงเหลือมากกว่า 3 ปี	-	-
<u>หุ้นกู้</u>		
Rate AAA	-	-
Rate AA	-	-
Rate AA-	-	-
Rate A+	-	-
Rate A	-	-
Rate A-	-	-
Rate BBB+	-	-
Rate T1+	-	-
Non-rated	-	-
ตัวแลกเงิน/ตัวสัญญาใช้เงิน	184,506,960.00	99.25%
เงินฝากบมจ.ธ.กรุงเทพ	529,330.30	0.28%
สินทรัพย์อื่น ๆ	0.00	0.00%
หนี้สินอื่น ๆ	(131,708.85)	-0.07%
รวมทรัพย์สินสุทธิของกองทุน	185,903,613.35	100.00%

กองทุนเปิด วรรณ อัลติเมท ยิลด์ 6M ห้ามขายผู้ลงทุนรายย่อย (ONE-UY6M)
ณ วันที่ 31 มีนาคม 2563
มูลค่าทรัพย์สินต่อหน่วยลงทุน 10.3331 บาท

รายละเอียดการลงทุนในตราสารหนี้ที่ออกโดยนิติบุคคลไทยหรือตราสารที่เสนอขายในประเทศไทย
กองทุนเปิด วรรณ อัลติเมท ยิลด์ 6M ห้ามขายผู้ลงทุนรายย่อย (ONE-UY6M) ณ วันที่ 31 มีนาคม 2563

	ประเภท	ผู้ออก	ผู้ค้า/ผู้รับรอง ผู้สลับหลัง	วันครบ กำหนด	อันดับ ความน่าเชื่อถือ	จำนวนหน่วย/ มูลค่าหน้าตัว	มูลค่าตาม ราคาตลาด	% NAV
1.	พันธบัตร	ธนาคารแห่งประเทศไทย CB20507A		07/05/2020		1,000.00	999,031.90	0.54%
2.	ตัวแลกเงิน	บริษัท เจ เอ็ม ที เนท์เวอร์ค เซอร์วิสเชส จำกัด (มหาชน) บริษัท ไทยฟุตส์ กรุ๊ป จำกัด(มหาชน) บริษัท แสนสิริ จำกัด (มหาชน) บริษัท เอส 11 กรุ๊ป จำกัด (มหาชน) บริษัท เอสซี แอสเสท คอร์ปอเรชั่น จำกัด (มหาชน) บริษัทหลักทรัพย์ เพื่อธุรกิจหลักทรัพย์ จำกัด		07/05/2020 07/05/2020 07/05/2020 07/05/2020 07/05/2020 07/05/2020	BBB BBB- BBB+ BBB- BBB+ BBB	35,000.00 30,000.00 30,000.00 30,000.00 35,000.00 25,000.00	34,876,621.50 29,887,613.70 29,937,069.90 29,914,450.50 34,940,102.40 24,951,102.00	18.76% 16.08% 16.10% 16.09% 18.79% 13.42%
3.	เงินฝาก	บมจ.ธ.กรุงเทพ			AA+(tha)		529,330.30	0.28%
4.	สินทรัพย์อื่นๆ						-	0.00%
5.	หนี้สินอื่นๆ						(131,708.85)	-0.07%
	รวมมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน						185,903,613.35	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 ก่อนอาจส่งผลให้ความสามารถในการชำระหนี้ที่อยู่ในเกณฑ์ที่ไม่เพียงพอ
เศรษฐกิจ	
B	มีความเสี่ยงในระดับสูงมาก บริษัทมีความสามารถในการชำระดอกเบี้ยและคืนเงินต้นในเกณฑ์ต่ำ และอาจจะหมดความสามารถหรือความตั้งใจในการชำระหนี้ได้ตามการเปลี่ยนแปลงของสถานการณ์ทางธุรกิจ เศรษฐกิจ และสิ่งแวดล้อมอื่นๆ
C	มีความเสี่ยงในการผิดนัดชำระหนี้สูงที่สุด บริษัทไม่มีความสามารถในการชำระดอกเบี้ยและคืนเงินต้นตามกำหนดอย่างชัดเจน โดยต้องอาศัยเงื่อนไขที่เอื้ออำนวยทางธุรกิจ เศรษฐกิจ และสิ่งแวดล้อมอื่นๆ อย่างมากจึงจะสามารถในการชำระหนี้ได้
D	เป็นระดับที่อยู่ในสภาวะผิดนัดชำระหนี้ โดยผู้ออกตราสารหนี้ไม่สามารถชำระดอกเบี้ยและคืนเงินต้นได้ตามกำหนด
อันดับเครดิตจาก AA ถึง C อาจมีเครื่องหมายบวก (+) หรือลบ (-) ต่อท้าย เพื่อจำแนกความแตกต่างของคุณภาพของอันดับเครดิตภายในระดับเดียวกัน	

ตราสารหนี้ระยะสั้นที่มีอายุต่ำกว่า 1 ปี

T1/F1	ผู้ออกตราสารหนี้มีสถานะทั้งทางด้านการตลาดและการเงินที่แข็งแกร่งในระดับดีมาก มีสภาพคล่องที่ดีมาก และนักลงทุนจะได้รับความคุ้มครองจากการผิดนัดชำระหนี้ที่ต่ำกว่าอันดับเครดิตในระดับอื่น ผู้ออกตราสารหนี้ได้รับอันดับเครดิตในระดับดังกล่าวซึ่งมีเครื่องหมาย "+" 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 2563

กลุ่มของตราสาร	มูลค่าตามราคา ตลาด (บาท)	% NAV
(ก) ตราสารภาครัฐไทย และตราสารภาครัฐต่างประเทศ	999,031.90	0.54%
(ข) ตราสารที่ธนาคารที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้น ธนาคารพาณิชย์ หรือบริษัทเงินทุน เป็นผู้ออก ผู้รับรอง ผู้รับอาวัล ผู้สลับหลัง หรือผู้ค้ำประกัน	529,330.30	0.28%
(ค) ตราสารที่มีอันดับความน่าเชื่อถืออยู่ในอันดับที่สามารถลงทุนได้ (Investment grade)	184,506,960.00	99.25%
(ง) ตราสารที่มีอันดับความน่าเชื่อถืออยู่ในอันดับต่ำกว่าที่สามารถลงทุนได้ (Investment grade) หรือตราสารที่ไม่ได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือ	-	0.00%

สัดส่วนสูงสุดที่บริษัทจัดการคาดว่าจะลงทุนในกลุ่ม (ง) คือไม่เกิน 15% ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุนรวม (NAV)

NET ASSET VALUE

185,903,613.35

BAHT

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

งบดุล

ณ วันที่ 31 มีนาคม 2563

1 ต.ค. 62 - 31 มี.ค. 63	
สินทรัพย์	
เงินลงทุนตามมูลค่ายุติธรรม (ราคาทุน 185,447,411.42 บาท)	185,505,991.90
เงินฝากธนาคาร	528,771.97
ลูกหนี้	
จากดอกเบี้ย	558.33
รวมสินทรัพย์	186,035,322.20
หนี้สิน	
ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย	128,649.09
หนี้สินอื่น	3,059.76
รวมหนี้สิน	131,708.85
สินทรัพย์สุทธิ	185,903,613.35
สินทรัพย์สุทธิ:	
ทุนที่ได้รับจากผู้ถือหน่วยลงทุน	179,910,083.79
กำไร(ขาดทุน)สะสม	
บัญชีปรับสมดุล	(2,089,501.66)
กำไรสะสมจากการดำเนินงาน	8,083,031.22
สินทรัพย์สุทธิ	185,903,613.35
สินทรัพย์สุทธิต่อหน่วย	10.3331
จำนวนหน่วยลงทุนที่จำหน่ายแล้วทั้งหมด ณ วันสิ้นปี (หน่วย)	17,991,008.3805

หมายเหตุ: *งบการเงินนี้ยังไม่ได้ผ่านการสอบทานหรือรับรองจากผู้สอบบัญชี

กองทุนเปิด วรรณ อัลติเมท ยิลด์ 6M ห้ามขายผู้ลงทุนรายย่อย (ONE-UY6M)
งบกำไรขาดทุน
สำหรับระยะเวลา 6 เดือน สิ้นสุดวันที่ 31 มีนาคม 2563

	1 ต.ค. 62 - 31 มี.ค. 63
รายได้จากการลงทุน	
รายได้ดอกเบี้ย	2,871,783.58
รวมรายได้	2,871,783.58
ค่าใช้จ่าย	
ค่าธรรมเนียมการจัดการ	569,616.95
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์	31,307.67
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน	136,251.76
ค่าธรรมเนียมวิชาชีพ	15,000.51
ค่าใช้จ่ายในการดำเนินงาน	754.84
รวมค่าใช้จ่าย	752,931.73
รายได้จากการลงทุนสุทธิ	2,118,851.85
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิจากเงินลงทุน	
รายการกำไรสุทธิที่เกิดขึ้นจากเงินลงทุน	17,654.11
รายการขาดทุนสุทธิที่ยังไม่เกิดขึ้นจริงจากเงินลงทุน	(14,002.74)
รวมรายการกำไรจากเงินลงทุนที่เกิดขึ้นและที่ยังไม่เกิดขึ้น	3,651.37
การเพิ่มขึ้นในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงาน	2,122,503.22

หมายเหตุ : *งบการเงินนี้ยังไม่ได้ผ่านการสอบทานหรือรับรองจากผู้สอบบัญชี

กองทุนเปิด วรรณ อัลติเมท ยิลด์ 6M ห้ามขายผู้ลงทุนรายย่อย (ONE-UY6M)
งบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน
ณ วันที่ 31 มีนาคม 2563

การแสดงรายละเอียดเงินลงทุนใช้การจัดกลุ่มตามประเภทของเงินลงทุน

	วันครบ กำหนด	เงินต้น / จำนวนหน่วย	มูลค่ายุติธรรม (บาท)	ร้อยละของ มูลค่าเงินลงทุน
เงินลงทุนในประเทศ			185,505,991.90	100.00
พันธบัตร			999,031.90	0.54
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย			999,031.90	0.54
ธนาคารแห่งประเทศไทย CB20507A	7/05/2563	1,000,000.00	999,031.90	0.54
ตัวแลกเงิน			184,506,960.00	99.46
บริษัท เจ เอ็ม ที เนท์เวอร์ค เซอร์วิสเช็ส จำกัด (มหาชน)	7/05/2563	35,000,000.00	34,876,621.50	18.80
บริษัท ไทยฟูดส์ กรุ๊ป จำกัด(มหาชน)	7/05/2563	30,000,000.00	29,887,613.70	16.11
บริษัท แสตนลิริ จำกัด (มหาชน)	7/05/2563	30,000,000.00	29,937,069.90	16.14
บริษัท เอส 11 กรุ๊ป จำกัด (มหาชน)	7/05/2563	30,000,000.00	29,914,450.50	16.13
บริษัท เอสซี แอสเสท คอร์ปอเรชั่น จำกัด (มหาชน)	7/05/2563	35,000,000.00	34,940,102.40	18.83
บริษัทหลักทรัพย์ เพื่อธุรกิจหลักทรัพย์ จำกัด	7/05/2563	25,000,000.00	24,951,102.00	13.45
รวมเงินลงทุน (ราคาทุน 185,447,411.42 บาท)			185,505,991.90	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 1 ตุลาคม 2562 ถึงวันที่ 31 มีนาคม 2563 ของกองทุนเปิด วรรณ อัลติเมท ยิลด์ 6M ห้ามขายผู้ลงทุนรายย่อย (ONE-UY6M)

ในรอบระยะเวลาที่ผ่านมาของกองทุนเปิด วรรณ อัลติเมท ยิลด์ 6M ห้ามขายผู้ลงทุนรายย่อย (ONE-UY6M) มีผลการดำเนินงานย้อนหลังอยู่ที่ 1.11% โดยดัชนีชี้วัด คือ กองทุนไม่สามารถเปิดเผยดัชนีเทียบผลตอบแทนกองทุนได้เนื่องจากไม่มีดัชนีเทียบวัดที่เหมาะสมสำหรับพันธบัตรของประเทศที่ลงทุน ซึ่งการไม่เปิดเผยดัชนีเทียบวัดดังกล่าวไม่ได้ส่งผลกระทบต่อผลการดำเนินงานของกองทุน 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 2562 ถึงเดือนมีนาคม 2563 คณะกรรมการนโยบายการเงินของธนาคารแห่งประเทศไทย มีการประชุมตามตารางจำนวน 4 ครั้ง และการประชุมแบบฉุกเฉิน 1 ครั้งในวันที่ 20 มีนาคม 2563 โดย กนง. มีมติปรับลดอัตราดอกเบี้ยตลาดซื้อคืนพันธบัตรระยะ 1 วัน 3 ครั้ง จากร้อยละ 1.25 เป็นร้อยละ 0.75 สำหรับอัตราดอกเบี้ยเงินฝากและอัตราดอกเบี้ยเงินกู้ของธนาคารพาณิชย์ ตั้งแต่เดือนตุลาคม 2562 ถึงเดือนมีนาคม 2563 ปรับตัวลดลงตามอัตราดอกเบี้ยนโยบาย โดย ณ สิ้นเดือนมีนาคม 2563 อัตราดอกเบี้ยเงินฝากออมทรัพย์ อยู่ที่ระดับร้อยละ 0.375-0.500 อัตราดอกเบี้ยเงินฝากประจำ 3 เดือนอยู่ที่ระดับร้อยละ 0.500-0.700 อัตราดอกเบี้ยเงินฝากประจำ 6 เดือนอยู่ที่ระดับร้อยละ 0.600-0.900 อัตราดอกเบี้ยเงินฝากประจำ 1 ปี อยู่ที่ระดับร้อยละ 0.650-1.000 และอัตราดอกเบี้ยเงินกู้ยืมแบบมีระยะเวลา (MLR) อยู่ที่ระดับ 5.775-6.000%

สำหรับภาวะตลาดตราสารหนี้ไทย ในช่วงตั้งแต่เดือนตุลาคม 2562 ถึงเดือนมีนาคม 2563 อัตราผลตอบแทนของพันธบัตรปรับโดยรวมปรับตัวลดลงในช่วงอายุไม่เกิน 10 ปี และปรับตัวเพิ่มขึ้นในช่วงอายุมากกว่า 10 ปี ขึ้นไป โดยอัตราผลตอบแทนของพันธบัตรรัฐบาลช่วงอายุไม่เกิน 1 ปี ปรับตัวลดลงโดยเฉลี่ย 63-65 Bps (Basis Point) ช่วงอายุ 1 - 3 ปี ปรับตัวลดลงโดยเฉลี่ย 45 -64 bps ช่วงอายุ 3 - 7 ปี ปรับตัวลดลงโดยเฉลี่ย 12-45 bps ช่วงอายุ 7 - 10 ปี ปรับตัวลดลงโดยเฉลี่ย 2-12 bps ช่วงอายุ 10 - 20 ปี ปรับตัวเพิ่มขึ้นโดยเฉลี่ย 16-45 bps ช่วงอายุมากกว่า 20 ปี ปรับตัวเพิ่มขึ้นโดยเฉลี่ย 32-59 bps

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน วรรณ จำกัด ขอขอบพระคุณท่านผู้ถือหน่วยลงทุนทุกท่านที่ได้มอบหมายความไว้วางใจให้บริษัทดูแลเงินลงทุนของท่าน ทั้งนี้ บริษัทฯ จะยังคงมุ่งมั่นบริหารเงินลงทุนของผู้ลงทุนด้วยความรอบคอบระมัดระวังและมีประสิทธิภาพเพื่อประโยชน์สูงสุดของท่านผู้ถือหน่วยลงทุน

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน วรรณ จำกัด

Portfolio	Fund Size		NAV/Unit	YTD	1W	1M	3M	6M	1Y	3Y (A)	5Y (A)	10Y (A)	Inception (A)
	THB	THB											
ONE-UY6M	185,903,613.35	10.3331		0.54%	0.17%	0.17%	0.54%	1.11%	2.36%	-	-	-	2.34%
#N/A	-	-		-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Volatility p.a.				0.62%	1.21%	0.58%	0.62%	0.64%	0.67%	-	-	-	0.66%
Benchmark Volatility p.a.				-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Information Ratio				0.22	0.45	21.32%	0.22	0.22	0.23	-	-	-	0.23

Notes: (A) = Annualized Return | Volatility is a standard deviation per annum

As of 31/03/2020