

กองทุนเปิด ไทยเด็กซ์ FTSE SET Large Cap ETF (TFTSE)

รายงานของรอบระยะเวลา 6 เดือน
กองทุนเปิด ไทยเด็กซ์ FTSE SET Large Cap ETF (TFTSE)
ตั้งแต่วันที่ 1 มกราคม 2553 ถึงวันที่ 30 มิถุนายน 2553

ประเภทกองทุนรวม :	กองทุนรวมอีทีเอฟที่ลงทุนในตราสารแห่งทุน
อายุโครงการ :	ไม่กำหนด
จำนวนเงินทุนและจำนวนหน่วยลงทุนของโครงการ :	5,000 ล้านบาท
มูลค่าขั้นต่ำของการสั่งซื้อ :	5,000 บาท และเพิ่มขึ้นเป็นทวีคูณของ 1,000 บาท
นโยบายการลงทุน :	<p>กองทุนเปิดไทยเด็กซ์ FTSE SET Large Cap ETF จะใช้กลยุทธ์การบริหารกองทุนเชิงรับ (passive management strategy) โดยลงทุนในตราสารแห่งทุนโดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 65 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน ทั้งนี้ จะเน้นลงทุนในหลักทรัพย์ที่เป็นส่วนประกอบของดัชนีอ้างอิง (FTSE SET Large Cap Index) ซึ่งรวมถึงหลักทรัพย์ที่อยู่ในระหว่างการเข้าหรือออกจากการเป็นหลักทรัพย์ที่เป็นส่วนประกอบของดัชนีอ้างอิงด้วย และส่วนที่เหลือจะลงทุนในตราสารแห่งหนี้ ตราสารทางการเงิน หรือเงินฝาก เพื่อเป็นค่าใช้จ่ายในการดำเนินงาน เพื่อชำระราคาหลักทรัพย์เพื่อรอการลงทุน หรือเพื่อเป็นสภาพคล่องของกองทุน ทั้งนี้ กองทุนอาจลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) เพื่อลดความเสี่ยง (Hedging) หรือเพื่อเป็นการเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน (Efficient Portfolio Management) โดยมีวัตถุประสงค์เพื่อสร้างผลตอบแทนให้ใกล้เคียงกับดัชนีอ้างอิง แต่กองทุนจะไม่ลงทุนในตราสารหนี้ที่มีลักษณะของสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแฝง (Structured Note)</p>
ดัชนีอ้างอิง หมายถึง :	<p>ดัชนี FTSE SET Large Cap (FTSE SET Large Cap Index) หรือดัชนีอื่นใดที่บริษัทจัดการกำหนด ทั้งนี้ บริษัทจัดการขอสงวนสิทธิในการเปลี่ยนแปลงดัชนีอ้างอิงเป็นดัชนีอื่นใด โดยดัชนีอื่นใดที่จะใช้แทนดัชนี FTSE SET Large Cap จะมีลักษณะที่เหมาะสมหรือใกล้เคียงกับดัชนี FTSE SET Large Cap โดยให้ถือว่าได้รับความเห็นชอบจากผู้ถือหน่วยลงทุนแล้ว และไม่ถือว่าการแก้ไขเพิ่มเติมโครงการทุกวันทำการของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย</p>
วันทำการซื้อขายหน่วยลงทุน :	โครงการมีนโยบายที่จะจ่ายเงินปันผลให้แก่ผู้ถือหน่วยลงทุนจากกำไรสะสมหรือกำไรสุทธิ เมื่อกองทุนมีกำไรสะสมหรือกำไรสุทธิในงวดบัญชีที่จ่ายเงินปันผล และการจ่ายเงินปันผลดังกล่าวจะไม่ทำให้กองทุนมีผลขาดทุนสะสมเพิ่มขึ้นในงวดบัญชีที่มีการจ่ายเงินปันผลนั้น ทั้งนี้ การจ่ายเงินปันผลดังกล่าวจะไม่เกินปีละ 4 ครั้ง โดยจะพิจารณาจ่ายในอัตราไม่เกินร้อยละ 100 ของกำไรสะสม หรือกำไรสุทธินั้นๆ ทั้งนี้ ตามที่บริษัทจัดการพิจารณาเห็นสมควร
นโยบายการจ่ายเงินปันผล :	<p>บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนรวม วรณ จำกัด ธนาคารซีทีแบงก์ เอ็น เอ สาขากรุงเทพมหานคร บริษัทศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ (ประเทศไทย) จำกัด</p>
บริษัทจัดการ	
ผู้ดูแลผลประโยชน์	
นายทะเบียนหน่วยลงทุน	
ค่าธรรมเนียมการจัดการ :	ไม่เกินร้อยละ 0.055 ต่อปีของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน*
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ :	ไม่เกินร้อยละ 0.025 ต่อปีของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน*
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน :	ไม่เกินร้อยละ 0.01 ต่อปีของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน*
ผู้สอบบัญชี :	บริษัท เอเอ็นเอส ออดิท จำกัด
รอบระยะเวลาบัญชีประจำปีของกองทุนรวม	ทุกวันที่ 31 ธันวาคม ของทุกปี
ผู้ดูแลสภาพคล่อง :	บริษัทหลักทรัพย์ เคจีไอ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)
ผู้ร่วมค้าหน่วยลงทุน - บริษัทหลักทรัพย์ กิมเอ็ง (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) - บริษัทหลักทรัพย์ เคจีไอ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)	
- บริษัทหลักทรัพย์ ซิตีคอร์ป (ประเทศไทย) จำกัด - บริษัทหลักทรัพย์ ทิสโก้ จำกัด - บริษัทหลักทรัพย์ ธนชาติ จำกัด (มหาชน)	
- บริษัทหลักทรัพย์ บัวหลวง จำกัด (มหาชน)	
- สอบถามรายละเอียดเพิ่มเติมได้ที่ บลจ.วรณ จำกัด โทร. 0-2659-8888 กต 1 ฝ่ายการตลาด หรือติดต่อซื้อขายได้ที่บริษัทหลักทรัพย์ทุกแห่ง	

ผลตอบแทนจากการลงทุนย้อนหลัง (%)	3 เดือน	6 เดือน	นับจากวันจดทะเบียน (3 ส.ค. 52)
ข้อมูล ณ วันที่ 25 มิถุนายน 2553			
กองทุนเปิดไทยเด็กซ์ FTSE SET Large Cap ETF (TFTSE)	-1.93%	6.03%	22.45%
เกณฑ์มาตรฐาน (1)	-2.52%	6.08%	19.84%

(1) ค่าเฉลี่ยของดัชนี FTSE SET Large Cap

หมายเหตุ *การวัดผลการดำเนินงานนี้ ได้จัดทำขึ้นตามมาตรฐานการวัดผลการดำเนินงานของสมาคมบริษัทจัดการลงทุน (AIMC)

399 Sukhumvit Road,
Interchange 21 Building,
Klongtoey Nua Sub-district,
Wattana District, Bangkok 10110

Tel (662) 788 2000
www.citibank.co.th



รายงานผู้ดูแลผลประโยชน์

เสนอ ผู้อื่นหน่วยลงทุนกองทุนเปิดไทยเดีเค็กซ์ FTSE SET Large Cap ETF

ธนาคารซิตี้แบงก์ เอ็น เอ สาขากรุงเทพฯ ในฐานะผู้ดูแลผลประโยชน์ กองทุนเปิดไทยเดีเค็กซ์ FTSE SET Large Cap ETF อันมี บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนรวม วรณ จำกัด เป็นผู้จัดตั้งและจัดการกองทุน ได้ปฏิบัติหน้าที่ดูแลผลประโยชน์ กองทุนรวมดังกล่าว สำหรับระยะเวลาดังแต่วันที่ 1 มกราคม 2553 ถึงวันที่ 30 มิถุนายน 2553 แล้วนั้น

ธนาคารฯ เห็นว่าบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนรวม วรณ จำกัด ได้ปฏิบัติตามหน้าที่ในการจัดการ กองทุนเปิด ไทยเดีเค็กซ์ FTSE SET Large Cap ETF โดยถูกต้องตามที่ควรตามวัตถุประสงค์ที่ได้กำหนดไว้ในโครงการจัดการ ที่ได้รับอนุมัติจากสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ และภายใต้พระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535

ธนาคารซิตี้แบงก์ เอ็น เอ สาขากรุงเทพฯ

(ณิชน ขจิตสุวรรณ)
Vice President
ผู้ดูแลผลประโยชน์

ธนาคารซิตี้แบงก์ เอ็น เอ
กรุงเทพฯ 23 กรกฎาคม 2553

Citibank, N.A.

ข้อมูลอื่นๆ ที่ผู้อื่นหน่วยลงทุนควรทราบ

รายงานบุคคลที่เกี่ยวข้องที่มีการทำธุรกรรมรอบระยะเวลา 6 เดือนแรก (1 มกราคม 2553 - 30 มิถุนายน 2553)
-ไม่มี-

ผู้ลงทุนสามารถตรวจสอบการทำธุรกรรมกับบุคคลที่เกี่ยวข้องกับกองทุนรวมได้ที่บลจ.วรณ จำกัดโดยตรง
หรือที่ website ของบลจ.วรณ จำกัด (<http://www.one-asset.com>) และสำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ต. (<http://www.sec.or.th>)

ผู้จัดการกองทุน

- | | | |
|---------------------------|-------------------------------------|---------------------------------|
| 1. นายมนรัฐ ผดุงสิทธิ์ | 2. นางสาวทิวารัตน์ เตชะมีเกียรติชัย | 3. นางสาวสหทยา สรรค์ประสิทธิ์ |
| 4. นายชัยพฤกษ์ กุลกาญจนาร | 5. นายสันธาน เฮงสกุล | 6. นางสาวอรรณว เกียรติพิศาลสกุล |

การรับผลประโยชน์ตอบแทนเนื่องจากการที่กองทุนเปิด ไทยเด็กซ์ FTSE SET Large Cap ETF (TFTSE) ใช้บริการบุคคลอื่นๆ (Soft Commission)

	บริษัทที่ให้ผลประโยชน์	ผลประโยชน์ที่ได้รับ	เหตุผลในการรับผลประโยชน์
1	บล.บัวหลวง จำกัด (มหาชน)	ข่าวสาร และบทวิเคราะห์ ฯลฯ	เพื่อประโยชน์ในการลงทุนของกองทุน
2	บล.ทิสโก้ จำกัด	ข่าวสาร และบทวิเคราะห์ ฯลฯ	เพื่อประโยชน์ในการลงทุนของกองทุน
3	บล.คันทรี กรุ๊ป จำกัด (มหาชน)	ข่าวสาร และบทวิเคราะห์ ฯลฯ	เพื่อประโยชน์ในการลงทุนของกองทุน
4	บล.ดีบีเอส วิคเคอรัส (ประเทศไทย) จำกัด	ข่าวสาร และบทวิเคราะห์ ฯลฯ	เพื่อประโยชน์ในการลงทุนของกองทุน
5	บล.ซีจีไอ จำกัด (มหาชน)	ข่าวสาร และบทวิเคราะห์ ฯลฯ	เพื่อประโยชน์ในการลงทุนของกองทุน
6	บล.ภัทร จำกัด (มหาชน)	ข่าวสาร และบทวิเคราะห์ ฯลฯ	เพื่อประโยชน์ในการลงทุนของกองทุน
7	บล.เอเชีย พลัส จำกัด (มหาชน)	ข่าวสาร และบทวิเคราะห์ ฯลฯ	เพื่อประโยชน์ในการลงทุนของกองทุน
8	บล.เครดิต สุวิส (ประเทศไทย) จำกัด	ข่าวสาร และบทวิเคราะห์ ฯลฯ	เพื่อประโยชน์ในการลงทุนของกองทุน
9	บล.กลีกรไทย จำกัด (มหาชน)	ข่าวสาร และบทวิเคราะห์ ฯลฯ	เพื่อประโยชน์ในการลงทุนของกองทุน
10	บล.นครหลวงไทย จำกัด	ข่าวสาร และบทวิเคราะห์ ฯลฯ	เพื่อประโยชน์ในการลงทุนของกองทุน
11	บล.เคจีไอ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)	ข่าวสาร และบทวิเคราะห์ ฯลฯ	เพื่อประโยชน์ในการลงทุนของกองทุน
12	บล.พัฒนสิน จำกัด (มหาชน)	ข่าวสาร และบทวิเคราะห์ ฯลฯ	เพื่อประโยชน์ในการลงทุนของกองทุน
13	บล.ธนาชาต จำกัด (มหาชน)	ข่าวสาร และบทวิเคราะห์ ฯลฯ	เพื่อประโยชน์ในการลงทุนของกองทุน
14	บล.เกียรตินาคิน จำกัด	ข่าวสาร และบทวิเคราะห์ ฯลฯ	เพื่อประโยชน์ในการลงทุนของกองทุน
15	บล.ทีรนีดี จำกัด	ข่าวสาร และบทวิเคราะห์ ฯลฯ	เพื่อประโยชน์ในการลงทุนของกองทุน
16	บล.ไทยพาณิชย์ จำกัด	ข่าวสาร และบทวิเคราะห์ ฯลฯ	เพื่อประโยชน์ในการลงทุนของกองทุน
17	บล.ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)	ข่าวสาร และบทวิเคราะห์ ฯลฯ	เพื่อประโยชน์ในการลงทุนของกองทุน
18	บล.ทีเอ็มบี แมคควอรี (ประเทศไทย) จำกัด	ข่าวสาร และบทวิเคราะห์ ฯลฯ	เพื่อประโยชน์ในการลงทุนของกองทุน
19	บล.ฟินันซ่า จำกัด	ข่าวสาร และบทวิเคราะห์ ฯลฯ	เพื่อประโยชน์ในการลงทุนของกองทุน
20	บล.เจพี มอร์แกน (ประเทศไทย) จำกัด	ข่าวสาร และบทวิเคราะห์ ฯลฯ	เพื่อประโยชน์ในการลงทุนของกองทุน
21	บล.กิมเอ็ง (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)	ข่าวสาร และบทวิเคราะห์ ฯลฯ	เพื่อประโยชน์ในการลงทุนของกองทุน
22	บล.ซี แอล เอส เอ (ประเทศไทย) จำกัด	ข่าวสาร และบทวิเคราะห์ ฯลฯ	เพื่อประโยชน์ในการลงทุนของกองทุน
23	บล.เคที ซีมิโก้ จำกัด	ข่าวสาร และบทวิเคราะห์ ฯลฯ	เพื่อประโยชน์ในการลงทุนของกองทุน
24	บล.ยูบีเอส (ประเทศไทย) จำกัด	ข่าวสาร และบทวิเคราะห์ ฯลฯ	เพื่อประโยชน์ในการลงทุนของกองทุน

กองทุนเปิด ไทยเด็กซ์ FTSE SET Large Cap ETF			
รายชื่อบริษัทนายหน้าที่ได้รับค่านายหน้าจากการซื้อขายหลักทรัพย์			
ของรอบระยะเวลา 6 เดือน ตั้งแต่วันที่ 1 มกราคม 2553 ถึงวันที่ 30 มิถุนายน 2553			
อันดับ	รายชื่อบริษัทนายหน้า	ค่านายหน้าจากการ ซื้อขายหลักทรัพย์ (หน่วย : บาท)	ร้อยละของ ค่านายหน้า ทั้งหมด
1	บล.ภัทร จำกัด (มหาชน)	10,043.81	42.31
2	บล.กลีกรไทย จำกัด (มหาชน)	8,418.90	35.46
3	บล.ธนาชาต จำกัด (มหาชน)	3,676.52	15.49
4	บล.ยูบีเอส (ประเทศไทย) จำกัด	890.34	3.75
5	บล.ทิสโก้ จำกัด	709.62	2.99
6	บริษัทนายหน้าอื่นๆ	-	0.00
รวมค่านายหน้าทั้งหมด		23,739.19	100.00

แบบ 117-5		
แบบแสดงค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนเปิด ไทยเด็กซ์ FTSE SET Large Cap ETF		
ของรอบระยะเวลา 6 เดือน ตั้งแต่วันที่ 1 มกราคม 2553 ถึงวันที่ 30 มิถุนายน 2553		
ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (Fund's Direct Expenses)	จำนวนเงิน หน่วย : พันบาท	ร้อยละของ มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ
ค่าธรรมเนียมการจัดการ (management fee)	349.43	0.29
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ (trustee fee)	15.88	0.01
ค่าธรรมเนียมที่ปรึกษาการลงทุน (advisory fee)	ไม่มี	ไม่มี
ค่านายทะเบียน (registrar fee)	6.35	0.01
ค่าไปรษณียากร	-	-
ค่าประกาศหนังสือพิมพ์	38.78	0.03
ค่าสิ่งพิมพ์	-	-
ค่าจัดทำรายงานประจำปี	0.59	0.00
ค่าใช้จ่ายในการจัดตั้งกองทุน	18.77	0.02
ค่าใช้จ่ายในการจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ฯ	93.93	0.08
ค่าใช้จ่ายในการโฆษณา		
ในช่วงเสนอขายหน่วยลงทุนครั้งแรก	196.03	0.16
ค่าใช้จ่ายในการสอบบัญชี	107.88	0.09
ค่าใช้จ่ายอื่นๆ	30.79	0.03
รวมค่าใช้จ่ายทั้งหมด*	858.43	0.71
*ไม่รวมค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์และค่าธรรมเนียมต่างๆ ที่เกิดขึ้นจากการซื้อขายหลักทรัพย์		
ค่าเฉลี่ยของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน	120,427,873.98	บาท

รายละเอียดการลงทุน
กองทุนเปิด ไทยเดีเก้ซ FTSE SET Large Cap ETF
ณ วันที่ 30 มิถุนายน 2553

หลักทรัพย์ หรือทรัพย์สินในประเทศ	มูลค่าตาม ราคาตลาด (บาท)	% NAV
หุ้นสามัญ		
จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ฯ		
ธุรกิจการเกษตร	-	-
อาหารและเครื่องดื่ม	5,547,190.00	5.34%
ธนาคาร	35,438,458.00	34.09%
เงินทุนและหลักทรัพย์	-	-
บรรจุกัมมันท์	-	-
ปิโตรเคมีและเคมีภัณฑ์	2,845,700.00	2.74%
วัสดุอุตสาหกรรมและเครื่องจักร	-	-
วัสดุก่อสร้าง	9,405,000.00	9.05%
พัฒนาอสังหาริมทรัพย์	2,793,120.00	2.69%
พลังงานและสาธารณูปโภค	35,221,934.00	33.88%
เหมืองแร่	-	-
พาณิชย์	3,731,750.00	3.59%
การแพทย์	1,029,600.00	0.99%
สื่อและสิ่งพิมพ์	1,058,750.00	1.02%
การท่องเที่ยวและสันทนาการ	-	-
ขนส่งและโลจิสติกส์	1,410,750.00	1.36%
เทคโนโลยีสารสนเทศและการสื่อสาร	4,923,050.00	4.74%
ชิ้นส่วนอิเล็กทรอนิกส์	-	-
รวมจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ฯ	103,405,302.00	99.46%
เงินฝากธ.ชาติแบงก์ เอ็น เอ สาขากรุงเทพมหานคร	999,953.55	0.96%
สินทรัพย์อื่น ๆ	287,460.51	0.28%
หนี้สินอื่น ๆ	(727,491.04)	-0.70%
รวมทรัพย์สินสุทธิของกองทุน	103,965,225.02	100.00%

กองทุนเปิด ไทยเดีเก้ซ FTSE SET Large Cap ETF (TFTSE)
ณ วันที่ 30 มิถุนายน 2553
มูลค่าทรัพย์สินต่อหน่วยลงทุน 9.4513 บาท

กองทุนเปิดไทยเดีเค็กซ์ FTSE SET Large Cap ETF
งบดุล
ณ วันที่ 30 มิถุนายน 2553 และ วันที่ 31 ธันวาคม 2552

	บาท	
	30 มิถุนายน 2553	31 ธันวาคม 2552
	"ยังไม่ได้ตรวจสอบ"	"ยังไม่ได้สอบทาน"
		"ตรวจสอบแล้ว"
สินทรัพย์		
เงินลงทุนตามมูลค่าสุทธิธรรม (ราคาทุน 90,587,491.82 บาท		
ในปี 2553 และ 172,931,598.19 บาทในปี 2552)	103,405,302.00	196,433,710.00
เงินฝากธนาคาร	999,930.99	807,971.21
ลูกหนี้จากดอกเบี้ยและเงินปันผล	422.35	12,299.97
ค่าใช้จ่ายรอการตัดบัญชี	287,038.16	569,396.35
ค่าใช้จ่ายจ่ายล่วงหน้า	-	26,369.89
สินทรัพย์อื่น	22.56	-
รวมสินทรัพย์	104,692,716.06	197,849,747.42
หนี้สิน		
ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย	727,491.04	364,084.03
รวมหนี้สิน	727,491.04	364,084.03
สินทรัพย์สุทธิ	103,965,225.02	197,485,663.39
สินทรัพย์สุทธิ:		
ทุนที่ได้รับจากผู้ถือหน่วยลงทุน	83,327,200.00	166,654,400.00
กำไร(ขาดทุน)สะสม		
บัญชีปรับสมดุล	(12,983,606.00)	(336,954.00)
กำไร(ขาดทุน)สะสมจากการดำเนินงาน	33,621,631.02	31,168,217.39
สินทรัพย์สุทธิ	103,965,225.02	197,485,663.39
สินทรัพย์สุทธิต่อหน่วย	9.4513	8.9766
จำนวนหน่วยลงทุนที่จำหน่ายแล้วทั้งหมด ณ วันสิ้นงวด (หน่วย)	11,000,000.00	22,000,000.00

หมายเหตุ : *งบการเงินนี้ยังไม่ได้ผ่านการสอบทานหรือรับรองจากผู้สอบบัญชี

กองทุนเปิดไทยเดีทซ์ FTSE SET Large Cap ETF
งบกำไรขาดทุน
สำหรับงวด 6 เดือนสิ้นสุดวันที่ 30 มิถุนายน 2553

	"ยังไม่ได้ตรวจสอบ"
	"ยังไม่ได้สอบทาน"
	บาท
	2553
รายได้จากการลงทุน	
รายได้เงินปันผล	2,644,005.30
รายได้ดอกเบี้ย	817.91
รายได้จากการให้ยืมหลักทรัพย์	17,582.18
รายได้อื่น	167.58
รวมรายได้	2,662,572.97
ค่าใช้จ่าย	
ค่าธรรมเนียมการจัดการ	349,428.62
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์	15,883.08
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียนหน่วยลงทุน	6,353.25
ค่าธรรมเนียมวิชาชีพ	107,881.43
ค่าใช้จ่ายรอกการตัดบัญชีตัดจ่าย	308,728.08
ค่าใช้จ่ายในการดำเนินงาน	70,157.74
รวมค่าใช้จ่าย	858,432.20
รายได้จากการลงทุนสุทธิ	1,804,140.77
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิจากเงินลงทุน	
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิที่เกิดขึ้นจากเงินลงทุน	12,983,574.50
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิที่ยังไม่เกิดขึ้นจากเงินลงทุน	(10,684,301.63)
รวมรายการกำไร(ขาดทุน)จากเงินลงทุนที่เกิดขึ้นและที่ยังไม่เกิดขึ้น	2,299,272.87
การเพิ่มขึ้น(ลดลง)ในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงาน	4,103,413.64

หมายเหตุ : *งบการเงินนี้ยังไม่ได้ผ่านการสอบทานหรือรับรองจากผู้สอบบัญชี

กองทุนเปิดไทยเดีเค็กซ์ FTSE SET Large Cap ETF
งบประมาณรายละเอียดเงินลงทุน
ณ วันที่ 30 มิถุนายน 2553 และวันที่ 31 ธันวาคม 2552

การแสดงรายละเอียดเงินลงทุนใช้การจัดกลุ่มตามประเภทของเงินลงทุนและตามประเภทของอุตสาหกรรม

	ณ วันที่ 30 มิถุนายน 2553			ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2552		
	"ยังไม่ได้ตรวจสอบ"			"ตรวจสอบแล้ว"		
	"ยังไม่ได้สอบทาน"			"ตรวจสอบแล้ว"		
	เงินต้น/ จำนวนหน่วย	ราคายุติธรรม (บาท)	ร้อยละของ มูลค่าเงินลงทุน	เงินต้น/ จำนวนหน่วย	ราคายุติธรรม (บาท)	ร้อยละของ มูลค่าเงินลงทุน
หลักทรัพย์จดทะเบียน						
หุ้นสามัญ						
ธุรกิจการเกษตร						
บริษัท เจริญโภคภัณฑ์อาหาร จำกัด (มหาชน)	217,800	4,421,340.00	4.28	446,600	5,091,240.00	2.59
อาหารและเครื่องดื่ม						
บริษัท ไมเนอร์ อินเตอร์เนชั่นแนล จำกัด (มหาชน)	-	-	-	191,400	2,162,820.00	1.10
บริษัท ไทยยูเนี่ยน โฟรเซ่น โปรดักส์ จำกัด (มหาชน)	25,300	1,125,850.00	1.09	-	-	-
ธนาคาร						
ธนาคารกรุงศรีอยุธยา จำกัด (มหาชน)	176,000	3,449,600.00	3.34	360,800	8,118,000.00	4.13
ธนาคารกรุงเทพ จำกัด (มหาชน)	73,700	9,212,500.00	8.91	149,600	17,353,600.00	8.83
ธนาคารกสิกรไทย จำกัด (มหาชน)	91,300	8,285,475.00	8.01	187,000	15,895,000.00	8.09
ธนาคารกรุงไทย จำกัด (มหาชน)	215,600	2,716,560.00	2.63	442,200	4,355,670.00	2.22
ธนาคารไทยพาณิชย์ จำกัด (มหาชน)	130,900	10,635,625.00	10.28	268,400	23,283,700.00	11.85
ธนาคารนครหลวงไทย จำกัด (มหาชน)	-	-	-	83,600	2,445,300.00	1.24
ธนาคารทหารไทย จำกัด (มหาชน)	801,900	1,138,698.00	1.10	1,643,400	2,037,816.00	1.04
ปิโตรเคมีและเคมีภัณฑ์						
บริษัท อินโดรามา เวนเจอร์ส จำกัด (มหาชน)	50,600	1,113,200.00	1.08	-	-	-
บริษัท ปตท.เคมีคอล จำกัด (มหาชน)	16,500	1,732,500.00	1.67	35,200	2,604,800.00	1.33
วัสดุก่อสร้าง						
บริษัท ปูนซิเมนต์ไทย จำกัด (มหาชน)	34,100	8,934,200.00	8.64	70,400	16,544,000.00	8.42
บริษัท ปูนซิเมนต์นครหลวง จำกัด (มหาชน)	2,200	470,800.00	0.46	4,400	1,034,000.00	0.53
พัฒนาอสังหาริมทรัพย์						
บริษัท เซ็นทรัลพัฒนา จำกัด (มหาชน)	62,700	1,254,000.00	1.21	127,600	2,590,280.00	1.32
บริษัท แลนด์แอนด์เฮ้าส์ จำกัด (มหาชน)	290,400	1,539,120.00	1.49	594,000	3,742,200.00	1.91
พลังงานและสาธารณูปโภค						
บริษัท บ้านปู จำกัด (มหาชน)	10,450	6,332,700.00	6.12	22,000	12,672,000.00	6.45
บริษัท ผลิตไฟฟ้า จำกัด (มหาชน)	15,400	1,262,800.00	1.22	30,800	2,440,900.00	1.24
บริษัท โกลว์ พลังงาน จำกัด (มหาชน)	22,000	819,500.00	0.79	46,200	1,524,600.00	0.78
บริษัท ไออาร์พีซี จำกัด (มหาชน)	380,600	1,575,684.00	1.52	778,800	3,411,144.00	1.74
บริษัท ปตท. จำกัด (มหาชน)	53,900	13,259,400.00	12.83	88,000	21,648,000.00	11.02
บริษัท ปตท.อะโรแมติกส์และการกลั่น จำกัด (มหาชน)	85,800	2,166,450.00	2.10	176,000	4,488,000.00	2.28
บริษัท ปตท.สำรวจและผลิตปิโตรเลียม จำกัด (มหาชน)	50,600	7,261,100.00	7.02	103,400	15,199,800.00	7.74
บริษัท ผลิตไฟฟ้าราชบุรีโฮลดิ้ง จำกัด (มหาชน)	22,000	792,000.00	0.77	46,200	1,628,550.00	0.83
บริษัท ไทยออยล์ จำกัด (มหาชน)	39,600	1,752,300.00	1.69	79,200	3,385,800.00	1.72

หมายเหตุ : *งบการเงินนี้ยังไม่ได้ผ่านการสอบทานหรือรับรองจากผู้สอบบัญชี

รายงานรอบระยะเวลา 6 เดือนแรกของ
กองทุนเปิด ไทยเดีเค็กซ์ FTSE SET Large Cap ETF (TFTSE)

กองทุนเปิดไทยเดีเค็กซ์ FTSE SET Large Cap ETF
งบประมาณรายละเอียดเงินลงทุน
ณ วันที่ 30 มิถุนายน 2553 และวันที่ 31 ธันวาคม 2552

การแสดงรายละเอียดเงินลงทุนใช้การจัดกลุ่มตามประเภทของเงินลงทุนและตามประเภทของอุตสาหกรรม

	ณ วันที่ 30 มิถุนายน 2553			ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2552		
	"ยังไม่ได้ตรวจสอบ"			"ตรวจสอบแล้ว"		
	"ยังไม่ได้สอบทาน"			"ตรวจสอบแล้ว"		
	เงินต้น/ จำนวนหน่วย	ราคายุติธรรม (บาท)	ร้อยละของ มูลค่าเงินลงทุน	เงินต้น/ จำนวนหน่วย	ราคายุติธรรม (บาท)	ร้อยละของ มูลค่าเงินลงทุน
หลักทรัพย์จดทะเบียน						
หุ้นสามัญ						
พาณิชย์		3,731,750.00	3.61		6,601,760.00	3.36
บริษัท ซีพี ออลล์ จำกัด (มหาชน)	129,800	3,731,750.00	3.61	266,200	6,601,760.00	3.36
การแพทย์		1,029,600.00	1.00		1,752,960.00	0.89
บริษัท กรุงเทพดุสิตเวชการ จำกัด (มหาชน)	35,200	1,029,600.00	1.00	70,400	1,752,960.00	0.89
สื่อและสิ่งพิมพ์		1,058,750.00	1.02		1,948,320.00	0.99
บริษัท บีอีซี เวิลด์ จำกัด (มหาชน)	38,500	1,058,750.00	1.02	79,200	1,948,320.00	0.99
ขนส่งและโลจิสติกส์		1,410,750.00	1.36		2,514,600.00	1.28
บริษัท ท่าอากาศยานไทย จำกัด (มหาชน)	16,500	561,000.00	0.54	33,000	1,287,000.00	0.66
บริษัท การบินไทย จำกัด (มหาชน)	33,000	849,750.00	0.82	66,000	1,227,600.00	0.62
เทคโนโลยีสารสนเทศและการสื่อสาร		4,923,050.00	4.76		9,958,850.00	5.08
บริษัท แอดวานซ์ อินโฟร์ เซอร์วิส จำกัด (มหาชน)	45,100	3,912,425.00	3.78	92,400	7,992,600.00	4.08
บริษัท โทเทิล แอ็กเซส คอมมูนิเคชั่น จำกัด (มหาชน)	27,500	1,010,625.00	0.98	55,000	1,966,250.00	1.00
รวมหุ้นสามัญ		103,405,302.00	100.00		196,433,710.00	100.00
รวมหลักทรัพย์จดทะเบียน		103,405,302.00	100.00		196,433,710.00	100.00
รวมเงินลงทุนทั้งสิ้น (ราคาทุน 90,587,491.82 บาท						
ในปี 2553 และ 172,931,598.19 บาทในปี 2552)		103,405,302.00	100.00		196,433,710.00	100.00

หมายเหตุ : *งบการเงินนี้ยังไม่ได้ผ่านการสอบทานหรือรับรองจากผู้สอบบัญชี

รายงานความเห็นของบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนรวม วรรณ จำกัด
ในฐานะบริษัทจัดการของกองทุนเปิด ไทยเดีทซ์ FTSE SET Large Cap ETF (TFTSE)

เรียน ท่านผู้ถือหน่วยลงทุนกองทุนเปิด ไทยเดีทซ์ FTSE SET Large Cap ETF (TFTSE)

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนรวม วรรณ จำกัด (บลจ. วรรณ) ขอนำเสนอรายงานรอบระยะเวลา 6 เดือนแรกตั้งแต่วันที่ 1 มกราคม 2553 ถึงวันที่ 30 มิถุนายน 2553 ของกองทุนเปิด ไทยเดีทซ์ FTSE SET Large Cap ETF (TFTSE)

กองทุนเปิด ไทยเดีทซ์ FTSE SET Large Cap ETF (TFTSE) สร้างผลตอบแทนได้ร้อยละ 6.03 เปรียบเทียบกับเกณฑ์มาตรฐานอยู่ที่ร้อยละ 6.08 ซึ่งคำนวณจากค่าเฉลี่ยของดัชนี FTSE SET Large Cap Index (รายละเอียดจากตารางผลตอบแทนของกองทุน)

ทั้งนี้ในรอบระยะเวลาดังกล่าว ดัชนีตลาดหลักทรัพย์ฯ มีการเคลื่อนไหวค่อนข้างผันผวน โดยในเดือนมกราคม ตลาดหลักทรัพย์ฯปรับตัวลงค่อนข้างแรง โดยมีการปรับตัวลดลงร้อยละ 5.17 จากความกังวลในเรื่องภาวะเงินเฟ้อ และการยกเลิกนโยบายผ่อนคลายนโยบาย (Exit Strategy) ของสหรัฐฯ นอกจากนี้การที่รัฐบาลจีนพยายามที่จะลดความร้อนแรงทางเศรษฐกิจลงด้วยการคุมเข้มสินเชื่อทำให้ตลาดหุ้นทั่วโลกปรับตัวลง อย่างไรก็ตามตลาดหลักทรัพย์ฯได้กลับมาปรับตัวขึ้นแรงในช่วงเดือนกุมภาพันธ์ถึงมีนาคม เนื่องจากนักลงทุนคลายความกังวลจากสถานการณ์ทางการเมืองหลังจากที่มีคำตัดสินของศาลฎีกาออกมาให้ยึดทรัพย์สินของอดีตนายกฯทักษิณบางส่วนเท่านั้นซึ่งคิดเป็นมูลค่าประมาณ 3 หมื่นล้านบาท จากทั้งหมด 7.6 หมื่นล้านบาท รวมไปถึงการที่บริษัทขนาดใหญ่ได้ประกาศผลการดำเนินงานออกมาดีและยังมีข่าวดีจากการที่ศาลปกครองอนุญาตให้ 7 โครงการในมาบตาพุดสามารถเดินหน้าก่อสร้างและทดลองเครื่องจักรได้ตามคำขอแม้ว่าจะยังเริ่มการผลิตไม่ได้ นอกจากนี้เงินทุนไหลเข้าจากนักลงทุนต่างชาติที่มองว่าการเมืองมีผลกระทบระยะสั้นและมองว่าเงินดอลลาร์สหรัฐฯมีแนวโน้มอ่อนค่าลงเรื่อยๆ ทำให้มีการโยกเงินเข้ามาลงทุนในสินทรัพย์เสี่ยงในเอเชียที่ให้ผลตอบแทนสูงกว่าอย่างสินค้าโภคภัณฑ์และหุ้นนั้นก็เป็นปัจจัยสำคัญที่ผลักดันตลาดหลักทรัพย์ฯไทยอีกด้วย ในเดือนเมษายนถึงพฤษภาคม ตลาดหลักทรัพย์ฯได้กลับมาปรับตัวลดลงอีกครั้งหนึ่ง จากการชุมนุมทางการเมืองที่มีความรุนแรงมากขึ้นจนเกิดการปะทะกันระหว่างผู้ชุมนุมและเจ้าหน้าที่ของรัฐ และจากการเทขายหุ้นของนักลงทุนต่างชาติซึ่งมีความกังวลต่อปัญหาขาดดุลงบประมาณและหนี้สาธารณะในยุโรปโดยเฉพาะประเทศในกลุ่ม PIIGS (โปรตุเกส อิตาลี ไอร์แลนด์ กรีซ และสเปน) หลังจากปรับตัวลดลงสองเดือนติดต่อกัน ตลาดหลักทรัพย์ฯมีการปรับตัวขึ้นค่อนข้างแรงในเดือนมิถุนายน แม้ว่าปัจจัยภายนอกประเทศยังคงมีความไม่แน่นอน แต่ที่ว่าแนวโน้มเศรษฐกิจในประเทศเป็นไปในทิศทางบวกมากขึ้น โดยในเดือนมิถุนายน ดัชนีความเชื่อมั่นทั้งของผู้บริโภคและของภาคธุรกิจมีการปรับตัวเพิ่มขึ้น และกระทรวงการคลังมีการปรับเพิ่มประมาณการอัตราการเติบโตทางเศรษฐกิจของประเทศไทยขึ้นจากเดิม 4-5% เป็น 5-6% ส่งผลให้ดัชนีตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยปิดที่ระดับ 797.31 จุด ในวันที่ 30 มิถุนายน 2553

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนรวม วรรณ จำกัด ขอขอบพระคุณท่านผู้ถือหน่วยลงทุนทุกท่านที่ได้มอบหมายความไว้วางใจให้บริษัทดูแลเงินลงทุนของท่าน ทั้งนี้ บริษัทฯ จะยังคงมุ่งมั่นบริหารเงินลงทุนของผู้ลงทุนด้วยความรอบคอบระมัดระวังและมีประสิทธิภาพ เพื่อประโยชน์สูงสุดของท่านผู้ถือหน่วยลงทุน

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนรวม วรรณ จำกัด

รายงานของรอบระยะเวลา 6 เดือน
กองทุนเปิด ไทยดีทีเอส FTSE SET Large Cap ETF (TFTSE)
(ตั้งแต่วันที่ 1 มกราคม 2553 ถึง 30 มิถุนายน 2553)



เทรดง่ายเหมือนหุ้น ลงทุนเหมือนดัชนี

ThaiDEX FTSE SET Large Cap ETF : TFTSE

บลจ.วสสณ
1 A.M. FUND

989 อาคารสยามทาวเวอร์ ชั้น 24 ถนนพระราม 1 เขตปทุมวัน กรุงเทพฯ 10330
โทร. 0-2659-8888 กด 1 ฝ่ายการตลาด

สิ่งตีพิมพ์

ชำระค่าไปรษณียากรแล้ว
ใบอนุญาตเลขที่ 76/2540
ไปรษณีย์รองเมือง

เหตุขัดข้องที่นำจ่ายไม่ได้

- ☐ 1. จ่าหน้าไม่ชัดเจน
- ☐ 2. ไม่มีเลขที่บ้านตามจ่าหน้า
- ☐ 3. ไม่ยอมรับ
- ☐ 4. ไม่มีผู้รับตามจ่าหน้า
- ☐ 5. ไม่มารับภายในกำหนด
- ☐ 6. เลิกกิจการ
- ☐ 7. ย้ายไม่ทราบที่อยู่ใหม่
- ☐ 8. อื่นๆ

ลงชื่อ