


--

31	2554
----	------

 <p>กองทุนรวมวายุภักดิ์ หนึ่ง VAYUPAK FUND 1 ลงทุนเป็นค่า วินพยานันคง</p>	
"	"
	()
	()
"	"



2554 1 2554 31 2554

()

()

ผลการดำเนินงานของกองทุนรวมวายุภักษ์ หนึ่ง

	วันจดทะเบียน	ผลการดำเนินงาน (สิ้นสุด ณ 30 ธันวาคม 2554)						
		NAV ต่อหน่วย (บาท)	3	6	9	1		3
VAYU1 ⁽¹⁾	1 . . 2546	16.6038	2.13%	1.90%	3.13%	5.95%	28.58%	123.52%
⁽²⁾	-		6.97%	0.79%	1.17%	1.66%	66.82%	46.13%

:

(1) 15

(2) AIMC Benchmark = 50 25

TBMA Government Bond Index 25 1

1 3 (), ()

()

-

-

-

การจ่ายเงินปันผล

					()	
1	15	2547	29	2547	0.30	0.00
2	20	2548	28	2548	0.35	0.52
3	28	2548	11	2548	0.25	0.00
4	23	2549	3	2549	0.35	0.30
5	27	2549	10	2549	0.35	0.05
6	30	2550	13	2550	0.30	0.47
7	15	2550	29	2550	0.30	0.00
8	5	2551	19	2551	0.40	0.7333
9	15	2551	27	2551	0.30	0.00
10	12	2552	25	2552	0.15	0.15
11	11	2552	25	2552	0.30	0.00
12	8	2553	19	2553	0.35	0.5167
13	5	2553	19	2553	0.30	0.00
14	14	2554	2	2554	0.35	0.00
15	10	2554	26	2554	0.25	0.00
16	2	2555	15	2555	0.05	0.00
					4.65	3.2567

ค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์กองทุนรวมวายุภักษ์ หนึ่ง

ระหว่างวันที่ 1 มกราคม 2554 – 31 ธันวาคม 2554

		()	(%)
1		8,145,179.44	17.32
2		7,308,229.73	15.54
3		5,836,787.85	12.41
4	() ()	4,363,830.33	9.28
5	()	4,212,581.30	8.96
6	()	3,561,133.84	7.57
	()		
7	()	3,140,393.52	6.68
8	()	2,868,507.07	6.10
9	()	2,766,362.30	5.88
10		2,758,066.18	5.86
11		2,079,693.77	4.42
		47,040,765.33	100.00

ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวมวายุภักษ์ หนึ่ง

ระหว่างวันที่ 1 มกราคม 2554 – 31 ธันวาคม 2554

*		
(fund's direct expenses)	:	
	61,612	0.04
	5,216	0.00
	16,050	0.01
	22,019	0.01
**	11,680	0.01
***	116,577	0.07

*

**

0.01

รายละเอียดการลงทุน การกู้ยืมเงินและภาระผูกพัน

กองทุนรวมวายุภักษ์ หนึ่ง
มูลค่า ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2554

	()	%NAV
	303,006,512,052.44	182.50
	1,831,723,000.00	1.10
	103,209,076,863.50	62.16
	1,971,813,500.00	1.19
	4,400,467,300.00	2.65
	147,003,657,240.00	88.54
	10,606,864,836.00	6.39
	3,032,824,844.00	1.83
	28,078,778.50	0.02
: AAA	1,331,143,964.89	0.80
: AA+	30,190,125.90	0.02
: AA	574,698,090.11	0.35
: AA-	53,637,463.02	0.03
: A+	1,446,805,699.25	0.87
: A	847,027,473.54	0.51
	7,247,932,373.01	4.37
	2,156,660,054.79	1.30
	4,811,564,425.60	2.90
1	20,298,736.59	0.01
1 - 3	1,922,918,965.90	1.16
3	560,047,138.60	0.34
1	5,328,337,189.04	3.21
1 - 3	4,590,743,990.20	2.77
	(138,373,515,735.17)	(83.34)
	1,815,944,722.17	1.09
	(421,725,451.67)	(0.25)
	166,027,215,587.77	100.00

สถาบันการจัดอันดับความน่าเชื่อถือ TRIS Rating

1

AAA

AA

AAA

A

BBB

BB

B

C

D

AA C

(+)

(-)

คำอธิบายการจัดอันดับเครดิตตราสารหนี้ระยะสั้นที่มีอายุต่ำกว่า 1 ปี

T1

"+"

T2

T3

T4

TRIS Rating

TRIS Rating

(Rating Outlook)
TRIS Rating

4

Positive

Stable

Negative

Developing

สถาบันการจัดอันดับความน่าเชื่อถือ Fitch Rating

AAA (tha)

" "

Fitch

AA (tha)

BBB (tha)

BB (tha)

B (tha)

CCC (tha), CC (tha), C (tha)

D (tha)

คำอธิบายการจัดอันดับความน่าเชื่อถือระยะสั้น สำหรับประเทศไทย

F1 (tha)

" "

"+"

F2 (tha)

F3 (tha)

B (tha)

C (tha)

D (tha)

หมายเหตุประกอบการจัดอันดับความน่าเชื่อถือ ในระยะยาว ในระยะสั้น สำหรับประเทศไทย

"tha"

"+"

"-"

"AAA (tha)"

"CCC (tha)"

"F1 (tha)"

(Rating Watch):

"

"

"

"

"

"

รายงานสรุปจำนวนเงินลงทุนในตราสารแห่งนี้ เงินฝาก หรือ ตราสารกึ่งหนี้กึ่งทุน

	()	%NAV
()	12,422,346,020.33	7.48
()	14,216,156,853.40	8.56
() (Investment Grade)	4,283,502,816.71	2.58
() (Investment Grade)	-	-

(Upper limit)

()

15%

NAV

รายละเอียดตัวตราสารและอันดับความน่าเชื่อถือของตราสารทุกตัวใน port

กองทุนรวมวายุภักษ์ หนึ่ง
มูลค่า ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2554

	ความน่าเชื่อถือ	()
.	-	2,153,092,250.00
.	-	269,916,620.00
.	-	794,976,000.00
.	-	579,603,200.00
.	-	1,408,393,200.00
.	-	163,447,200.00
.	-	344,902,500.00
.	-	598,067,000.00
.	-	233,118,450.00
.	-	167,844,000.00
.	-	499,463,800.00
.	-	187,941,500.00
.	-	96,754,210.00
.	-	1,364,088,600.00
.	-	1,217,766,000.00
.	-	305,020,000.00
.	-	24,200,000.00
.	-	879,732,594.00
.	()	2,740,500,000.00
.	-	436,848,000.00
.	-	278,900,116.00
.	-	1,021,175,040.00
.	-	536,971,500.00
.	-	1,354,883,200.00
.	-	6,965,215,313.50
.	-	35,116,690.00
.	-	247,266,900.00
.	-	264,071,100.00
.	-	127,747,200.00
.	-	129,154,400.00
.	-	138,584,400,000.00
.	-	2,594,563,000.00
.	-	1,434,842,000.00
.	-	185,240,000.00
.	-	147,776,750.00
.	-	91,545,490,300.00
.	-	2,446,157,600.00
.	-	1,248,668,400.00

รายละเอียดตัวตราสารและอันดับความน่าเชื่อถือของตราสารทุกตัวใน port (ต่อ)

กองทุนรวมวายุภักษ์ หนึ่ง
มูลค่า ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2554

	ความน่าเชื่อถือ	()
.	-	121,052,800.00
.	-	137,072,350.00
.	-	6,806,308,800.00
.	-	206,804,000.00
.	-	132,240,000.00
.	-	191,970,000.00
.	-	482,508,000.00
.	-	365,157,000.00
.	- P	28,078,778.50
.	- ()	AAA
.	.	250,859,617.50
.	.	AAA
.	.	13,251,902.53
.	.	AAA
.	.	80,892,951.20
.	()	AAA
.	()	AAA
.	()	22,040,102.26
.	()	AAA
.	()	833,217,279.20
.	()	AAA
.	()	30,316,909.20
.	()	AAA
.	-	100,565,203.00
.	-	AA+
.	-	30,190,125.90
.	-	AA
.	-	236,270,418.80
.	-	AA
.	-	35,261,515.10
.	-	AA
.	-	55,790,650.91
.	-	AA
.	-	247,375,505.30
.	-	AA-
.	-	30,294,915.74
.	-	AA-
.	-	23,342,547.28
.	-	A+
.	-	60,707,905.20
.	-	A+
.	-	171,285,679.40
.	-	A+
.	-	714,597,478.00
.	-	A+
.	-	198,040,598.00
.	-	A+
.	-	197,452,632.00
.	- ()	A+
.	-	104,721,406.65
.	-	A
.	-	86,271,385.04
.	-	A
.	-	297,648,777.00
.	-	A
.	-	9,841,720.70
.	-	A
.	-	453,265,590.80

รายละเอียดตัวตราสารและอันดับความน่าเชื่อถือของตราสารทุกตัวใน port (ต่อ)

กองทุนรวมวายุภักษ์ หนึ่ง
มูลค่า ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2554

	ความน่าเชื่อถือ	()
.	-	768,406,334.94
.	-	934,803.72
.	-	2,033,747.27
.	-	1,624,247,249.66
.	-	3,490,518,294.83
.	-	446,434,177.86
.	-	16,385.07
.	-	16,980,001.34
.	-	265,906.75
.	-	898,095,471.57
.	-	2,156,660,054.79
.	-	934,479,801.50
.	-	724,560,657.53
.	-	1,111,237,725.48
.	-	1,320,089,342.46
.	-	721,196,898.63
.	-	20,298,736.59
.	-	1,147,528,416.37
.	-	718,434,660.80
.	-	56,955,888.73
.	-	169,554,139.17
.	-	140,683,218.20
.	-	104,926,208.00
.	-	29,607,556.50
.	-	97,641,160.53
.	-	17,634,856.20
.	-	29,988,530.41
.	-	374,837,035.68
.	-	209,385,039.01
.	-	9,971,064.79
.	-	211,281,369.60
.	-	29,840,536.02
.	-	99,489,718.16
.	-	64,475,823.07
.	-	133,671,787.75
.	-	635,032,681.94
.	-	470,136,215.44
.	-	288,898,872.38
.	-	13,952,718.59
.	-	1,700,869,338.25
.	-	834,660,539.99

รายละเอียดตัวตราสารและอันดับความน่าเชื่อถือของตราสารทุกตัวใน port (ต่อ)

กองทุนรวมวายุภักษ์ หนึ่ง
มูลค่า ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2554

ความน่าเชื่อถือ	()
-	151,951,890.26
-	69,894,027.70
-	151,392,132.12
-	971,469,287.76
-	871,878,385.00
-	376,517,638.80
-	39,292,168.64
-	1,283,723,722.71
-	775,219,951.77
-	20,208,801.40
-	101,041,902.00

31 2554



ERNST & YOUNG

Ernst & Young Office Limited
33rd Floor, Lake Rajada Office Complex
193/136-137 Rajadapisek Road
Klongtoey, Bangkok 10110
G.P.O.Box 1047, Bangkok 10501, Thailand
Tel: +66 2264 0777
Fax: +66 2264 0789-90
www.ey.com

บริษัท สำนักงาน เอ็นอีที จำกัด
ชั้น 33 อาคารเอชซีซี
193/136-137 ถนนรัชดาภิเษก
คลองเตย กรุงเทพฯ 10110
จ.ป.ณ. 1047 กรุงเทพฯ 10501
โทรศัพท์: +66 2264 0777
โทรสาร: +66 2264 0789-90
www.ey.com

31 2554

31 2553

31 2554

31 2554

4521

: 13 2555

31 2554 2553

(:)

		2554	2553
		302,689,772,165	302,673,674,474
		(138,373,611,949)	(140,569,574,914)
	7, 12	<u>164,316,160,216</u>	<u>162,104,099,560</u>
	9	93,013,970	37,072,565
		399,039,198	172,470,431
		1,585,726,855	97,708,125
		54,956,936	83,585,162
		<u>166,448,897,175</u>	<u>162,494,935,843</u>
		404,554,036	31,320,071
	12	16,638,708	23,143,129
		488,843	202,586
		<u>421,681,587</u>	<u>54,665,786</u>
	7	<u><u>166,027,215,588</u></u>	<u><u>162,440,270,057</u></u>
		70,000,000,000	70,000,000,000
		30,000,000,000	30,000,000,000
		<u>100,000,000,000</u>	<u>100,000,000,000</u>
		4,200,000,000	6,300,000,000
		61,827,215,588	56,140,270,057
	8	<u>66,027,215,588</u>	<u>62,440,270,057</u>
	7	<u><u>166,027,215,588</u></u>	<u><u>162,440,270,057</u></u>
		10.9216	10.8960
		29.8586	28.7227
		16.6027	16.2440
		10,000,000,000	10,000,000,000

()

	2554				2553			
	(%)	()	()	(%)	(%)	()	()	(%)
			97,719,165,463	32.28		88,498,206,340	29.24	
() (KTB)		414,340,615	6,173,675,163	2.04	414,340,615	7,168,092,640	2.37	
() (SCB)		785,798,200	91,545,490,300	30.24	785,798,200	81,330,113,700	26.87	
			1,359,847,100	0.45		1,269,258,700	0.42	
() (SCC)		628,700	196,783,100	0.07	628,700	214,386,700	0.07	
() (SCCC)		4,508,000	1,163,064,000	0.38	4,508,000	1,054,872,000	0.35	
			141,324,900,000	46.69		141,473,312,500	46.74	
() (PTT)		435,800,000	138,584,400,000	45.78	435,800,000	139,456,000,000	46.07	
() (ESSO)		253,750,000	2,740,500,000	0.91	253,750,000	2,017,312,500	0.67	
			706,267,800	0.24		813,680,210	0.27	
() (BKI)		2,270,290	499,463,800	0.17	2,270,290	565,302,210	0.19	
() (TIP)		10,660,000	206,804,000	0.07	10,660,000	248,378,000	0.08	
			6,601,503,280	2.18		16,173,683,036	5.34	
() (THAI)		330,075,164	6,601,503,280	2.18	330,075,164	16,173,683,036	5.34	
			35,116,690	0.01		33,611,689	0.01	
() (KWC)		501,667	35,116,690	0.01	501,667	33,611,689	0.01	
			28,078,779	0.01		28,078,778	0.01	
() (KTB-P)		5,452,190	28,078,779	0.01	5,452,190	28,078,778	0.01	
			<u>247,774,879,112</u>	<u>81.86</u>		<u>248,289,831,253</u>	<u>82.03</u>	
()			446,434,178	0.14		443,428,790	0.15	
()		-	-	-	0.250	443,428,790	0.15	
()	1.950		446,434,178	0.14	-	-	-	
			<u>446,434,178</u>	<u>0.14</u>		<u>443,428,790</u>	<u>0.15</u>	
			<u>248,221,313,290</u>	<u>82.00</u>		<u>248,733,260,043</u>	<u>82.18</u>	

	2554				2553			
	(%)	()	()	(%)	(%)	()	()	(%)
			4,595,702,100	1.52			5,443,432,335	1.80
() (KTB)		53,123,500	791,540,150	0.26		63,597,700	1,100,240,210	0.36
() (BAY)		26,345,600	579,603,200	0.19		17,247,300	444,117,975	0.15
() (BBL)		9,175,200	1,408,393,200	0.47		12,305,200	1,808,864,400	0.60
() (TISCO)		3,480,000	132,240,000	0.04		900,000	36,675,000	0.01
() (TMB)		121,500,000	191,970,000	0.06		26,500,000	62,540,000	0.02
() (TCAP)		5,124,200	137,072,350	0.05		-	-	-
() (KBANK)		11,105,600	1,354,883,200	0.45		15,864,500	1,990,994,750	0.66
			187,941,500	0.06			69,605,700	0.02
() (BLA)		4,063,600	187,941,500	0.06		2,263,600	69,605,700	0.02
			2,359,178,900	0.78			2,525,782,500	0.84
() (SCC)		7,186,500	2,249,374,500	0.74		7,179,300	2,448,141,300	0.81
() (SCCC)		331,800	85,604,400	0.03		331,800	77,641,200	0.03
() (DCC)		400,000	24,200,000	0.01		-	-	-
			681,441,300	0.22			816,322,950	0.26
() (CPN)		8,080,000	305,020,000	0.10		7,173,300	191,885,775	0.06
() (PS)		11,134,000	129,154,400	0.04		6,925,500	128,121,750	0.04
() (OH)		-	-	-		45,103,400	94,717,140	0.03
() (LH)		40,206,000	247,266,900	0.08		62,263,300	401,598,285	0.13
			2,222,680,566	0.74			837,932,550	0.28
() (CPALL)		26,359,200	1,364,088,600	0.45		21,348,600	837,932,550	0.28
() (HMPRO)		25,354,556	278,900,116	0.09		-	-	-
() (MAKRO)		1,104,900	264,071,100	0.09		-	-	-
() (ROBINS)		3,477,100	147,776,750	0.05		-	-	-
() (BIGC)		1,398,700	167,844,000	0.06		-	-	-

	2554			2553				
	(%)	()	()	(%)	(%)	()	()	(%)
			1,710,670,200	0.56		1,167,635,135		0.39
() (CPF)		36,902,000	1,217,766,000	0.40		25,467,400	629,044,780	0.21
() (TUF)		6,242,000	365,157,000	0.12		8,462,814	444,297,735	0.15
() (MINT)		11,406,000	127,747,200	0.04		7,990,900	94,292,620	0.03
			121,052,800	0.04		-	-	-
() (STA)		6,878,000	121,052,800	0.04		-	-	-
			4,519,036,240	1.48		11,968,004,449		3.95
() (BCP)		8,648,000	163,447,200	0.05		6,963,006	129,511,912	0.04
() (BANPU)		1,456,000	794,976,000	0.26		2,049,600	1,623,283,200	0.54
() (RATCH)		4,210,000	185,240,000	0.06		6,935,000	265,263,750	0.09
() (TOP)		8,248,000	482,508,000	0.16		13,317,700	1,042,110,025	0.34
() (IRPC)		250,288,000	1,021,175,040	0.34		1,254,494,900	8,154,216,850	2.69
() (PTTAR)		-	-	-		11,474,650	438,905,362	0.15
() (PTTGC)		23,522,000	1,434,842,000	0.47		-	-	-
() (GLOW)		7,664,000	436,848,000	0.14		6,660,600	314,713,350	0.10
			3,131,534,500	1.04			4,163,538,183	1.38
() (IVL)		18,358,000	536,971,500	0.18		12,521,700	723,128,175	0.24
() (PTTCH)		-	-	-		6,468,264	950,834,808	0.32
() (PTTEP)		15,398,000	2,594,563,000	0.86		14,818,900	2,489,575,200	0.82
			831,185,450	0.28			378,164,025	0.12
() (BGH)		7,293,500	598,067,000	0.20		4,709,500	218,991,750	0.07
() (BH)		5,013,300	233,118,450	0.08		5,013,300	159,172,275	0.05
			344,902,500	0.12			379,771,275	0.12
() (BEC)		7,664,500	344,902,500	0.12		11,961,300	379,771,275	0.12

	2554				2553			
	(%)	()	()	(%)	(%)	()	()	(%)
			569,098,230	0.19			1,226,760,719	0.41
() (THAI)		10,240,276	204,805,520	0.07		21,313,476	1,044,360,324	0.35
() (AOT)		5,945,300	267,538,500	0.09		3,385,100	132,018,900	0.04
() (BTS)		138,220,300	96,754,210	0.03		-	-	-
() (PSL)		-	-	-		1,709,500	31,112,900	0.01
() (TTA)		-	-	-		930,850	19,268,595	0.01
			-	-			128,497,500	0.04
() (HANA)		-	-	-		5,139,900	128,497,500	0.04
			2,939,679,350	0.97			1,635,530,000	0.54
() (ADVANC)		15,324,500	2,153,092,250	0.71		15,942,800	1,355,138,000	0.45
() (DTAC)		11,317,800	786,587,100	0.26		6,676,000	280,392,000	0.09
			-	-			38,344,633	0.01
() (BCP-W1)		-	-	-		2,083,140	5,874,455	0.00
() (MINT-W4)		-	-	-		746,420	2,209,403	0.00
(IVL-T1)		-	-	-		1,391,300	30,260,775	0.01
			-	-			385,380,900	0.12
() (BCP-DR1)		-	-	-		20,831,400	385,380,900	0.12
			24,214,103,636	8.00			31,164,702,854	10.28

			2554				2553			
			(%)	()	()	(%)	(%)	()	()	(%)
					4,056,991,384	1.34			5,013,263,104	1.66
() (AIS127A)	23	2555	-	-	-	-	4.000	50,000,000	51,215,974	0.02
() (AYCA130A)	21	2556	4.400	700,000,000	708,521,863	0.23	4.400	700,000,000	716,143,421	0.24
() (AYCA132A)	25	2556	3.330	170,000,000	169,284,943	0.06	3.330	170,000,000	170,664,874	0.06
() (AYCA120A)	21	2555	4.000	60,000,000	60,234,481	0.02	-	-	-	-
(CBA136A)	4	2556	3.930	235,000,000	235,561,943	0.08	3.930	235,000,000	237,668,031	0.08
() (GLOW12D)	8	2555	3.140	86,000,000	85,642,525	0.03	3.140	96,000,000	95,989,330	0.03
() (LH133A)	29	2556	3.000	300,000,000	297,574,803	0.10	3.000	300,000,000	297,423,759	0.10
() (MBTH120A)	5	2555	2.890	250,000,000	249,117,700	0.08	2.890	250,000,000	248,897,240	0.08
() (PS136A)	24	2556	3.000	10,000,000	9,835,145	0.00	3.000	10,000,000	9,892,788	0.00
() (PS13NA)	10	2556	3.100	460,000,000	451,234,028	0.15	3.100	460,000,000	453,806,753	0.15
() (TCAP131A)	22	2556	-	-	-	-	3.350	46,000,000	45,996,549	0.02
(TESC132A)	11	2556	3.020	30,000,000	29,835,172	0.01	3.020	62,000,000	61,853,056	0.02
() (PTEP126A)	15	2555	3.910	13,200,000	13,227,864	0.00	3.910	13,200,000	13,392,467	0.00
() (PTEP135A)	29	2556	3.000	80,000,000	80,603,636	0.03	3.000	80,000,000	81,051,220	0.03
() (BAY11DA)	2	2554	-	-	-	-	5.100	200,000,000	204,444,396	0.07
() (BGH133A)	6	2556	-	-	-	-	4.840	155,000,000	159,830,294	0.05
(CIT117A)	4	2554	-	-	-	-	6.180	199,000,000	202,580,368	0.07
() (CPF138A)	15	2556	-	-	-	-	5.700	100,000,000	105,757,239	0.03
() (CPF13NA)	25	2556	4.000	30,000,000	30,176,313	0.01	4.000	30,000,000	30,322,595	0.01
(DBAK116A)	19	2554	-	-	-	-	5.730	200,000,000	203,107,670	0.07

			2554				2553				
			(%)	()	()	(%)	(%)	()	()	(%)	
()	() (TLT12DA)	23	2555	3.000	105,000,000	104,641,147	0.03	3.000	105,000,000	104,881,567	0.03
	() (TLT134A)	30	2555	3.250	22,000,000	21,864,705	0.01	3.250	72,000,000	71,696,912	0.02
	() (TLT138A)	20	2556	3.080	830,000,000	823,832,137	0.27	3.080	1,000,000,000	993,093,500	0.33
	() (TLT139A)	3	2556	3.500	30,000,000	29,971,704	0.01	-	-	-	-
	() (TLT130A)	29	2556	3.540	100,000,000	99,944,491	0.03	-	-	-	-
	() (TTW122A)	26	2555	4.000	23,000,000	23,019,917	0.01	-	-	-	-
	() (TOP126A)	5	2555	-	-	-	-	4.740	250,000,000	255,991,485	0.08
	(RG129A)	30	2555	3.220	35,000,000	34,974,362	0.01	-	-	-	-
	(RG133A)	31	2556	3.405	55,300,000	55,310,882	0.02	-	-	-	-
	(RG139A)	30	2556	3.560	245,000,000	245,153,189	0.08	-	-	-	-
	THE KOREA DEVELOPMENT BANK (KDB13NA)	24	2556	2.940	200,000,000	197,428,434	0.07	2.940	200,000,000	197,561,616	0.07
						22,455,040	0.01			233,080,857	0.08
				1.350		2,023,415	0.00	0.765		589,005	0.00
	()			2.600		16,442,715	0.01	0.850		231,162,453	0.08
				0.750		2,618,430	0.00	0.250		1,109	0.00
	()			0.750		5,977	0.00	0.250		2,501	0.00
				0.500		1,053,119	0.00	0.500		992,511	0.00
	()			-		-	-	0.250		226,690	0.00
	()			0.750		46,055	0.00	0.250		1	0.00
	()			0.750		1,664	0.00	0.500		1,106	0.00
	()			2.000		263,665	0.00	0.750		105,481	0.00

			2554				2553			
			(%)	()	()	(%)	(%)	()	()	(%)
					8,868,000,000	2.93			3,998,000,000	1.32
(FD000779)	6	2554	-	-	-	-	1.825	298,000,000	-	0.10
(FD000836)	12	2555	3.500	-	60,000,000	0.02	-	-	-	-
(FD000840)	25	2555	3.500	-	30,000,000	0.01	-	-	-	-
(FD000847)	8	2555	3.500	-	160,000,000	0.06	-	-	-	-
(FD000849)	14	2555	3.500	-	200,000,000	0.07	-	-	-	-
(FD000881)	14	2555	3.750	-	80,000,000	0.03	-	-	-	-
(FD000887)	7	2555	3.700	-	370,000,000	0.13	-	-	-	-
(FD000890)	11	2555	3.700	-	90,000,000	0.03	-	-	-	-
(FD000894)	19	2555	3.700	-	550,000,000	0.18	-	-	-	-
(FD000898)	23	2555	3.625	-	340,000,000	0.11	-	-	-	-
(FD000900)	27	2555	3.700	-	29,000,000	0.01	-	-	-	-
(FD126243)	9	2555	3.500	-	370,000,000	0.12	-	-	-	-
(FD126245)	12	2555	3.500	-	90,000,000	0.03	-	-	-	-
(FD126252)	30	2555	3.500	-	400,000,000	0.14	-	-	-	-
(FD126288)	19	2555	3.875	-	150,000,000	0.05	-	-	-	-
(FD126289)	21	2555	3.875	-	350,000,000	0.12	-	-	-	-
(FD126316)	2	2556	3.700	-	185,000,000	0.06	-	-	-	-
() (FD000871)	25	2555	4.000	-	20,000,000	0.01	-	-	-	-
() (FD126235)	24	2555	3.260	-	250,000,000	0.09	-	-	-	-
() (FD126237)	25	2555	3.260	-	100,000,000	0.04	-	-	-	-
() (FD126269)	22	2555	3.800	-	190,000,000	0.07	-	-	-	-
() (FD126270)	22	2555	3.800	-	200,000,000	0.07	-	-	-	-
(FD002462)	29	2556	3.000	-	900,000,000	0.30	3.000	900,000,000	-	0.30
(FD002473)	4	2556	3.000	-	600,000,000	0.20	3.000	600,000,000	-	0.20
(FD126299)	30	2555	3.950	-	120,000,000	0.04	-	-	-	-

			2554				2553			
			(%)	()	()	(%)	(%)	()	()	(%)
()										
() () (FD126303)	9	2555	3.260		60,000,000	0.02	-		-	-
() () (FD126304)	13	2555	3.300		245,000,000	0.08	-		-	-
() () (FD126305)	14	2555	3.300		235,000,000	0.08	-		-	-
() () (FD126314)	6	2555	3.250		220,000,000	0.08	-		-	-
() () (FD126318)	6	2555	3.250		120,000,000	0.04	-		-	-
() () (FD002512)	28	2554	-		-	-	2.000		410,000,000	0.13
(FD002514)	8	2554	-		-	-	2.000		440,000,000	0.14
(PB000506)	19	2555	3.000		4,000,000	0.00	-		-	-
(PB000512)	17	2556	3.800		170,000,000	0.06	-		-	-
(PB000513)	21	2556	3.800		230,000,000	0.08	-		-	-
(PB000525)	17	2555	4.000		400,000,000	0.14	-		-	-
(PN003317)	7	2556	3.000		1,050,000,000	0.35	3.000		1,050,000,000	0.35
(PN003339)	20	2556	3.800		300,000,000	0.01	-		-	-
(PB000474)	10	2554	-		-	-	3.000		300,000,000	0.10
					4,785,000,000	1.58			483,287,181	0.16
(AY11210A)	10	2554	-	-	-	-	1.950	90,000,000	89,806,223	0.03
() (BD000621)	24	2554	-	-	-	-	2.000	200,000,000	200,000,000	0.07
(PE11322A)	22	2554	-	-	-	-	2.150	75,000,000	74,657,124	0.02
(PE11607A)	7	2554	-	-	-	-	2.396	120,000,000	118,823,834	0.04
() (BD000716)	26	2555	3.500	100,000,000	100,000,000	0.03	-	-	-	-
() (BD000721)	28	2555	3.500	30,000,000	30,000,000	0.01	-	-	-	-
() (BD000865)	6	2555	3.850	480,000,000	480,000,000	0.16	-	-	-	-
() (BE001147)	20	2555	3.300	200,000,000	200,000,000	0.07	-	-	-	-
() (BE000831)	18	2556	3.670	500,000,000	500,000,000	0.17	-	-	-	-
() (BD000728)	5	2555	3.300	100,000,000	100,000,000	0.03	-	-	-	-

()			2554				2553			
			(%)	()	()	(%)	(%)	()	()	(%)
() (BD000785)	28	2555	4.000	20,000,000	20,000,000	0.01	-	-	-	-
() (BD000885)	9	2555	3.800	60,000,000	60,000,000	0.02	-	-	-	-
() (BD000834)	18	2556	3.700	580,000,000	580,000,000	0.19	-	-	-	-
() (BD000840)	21	2555	3.250	165,000,000	165,000,000	0.05	-	-	-	-
() (BD000882)	27	2555	3.700	520,000,000	520,000,000	0.17	-	-	-	-
() (BD000886)	3	2555	3.750	160,000,000	160,000,000	0.05	-	-	-	-
() (BD000899)	1	2555	3.400	40,000,000	40,000,000	0.01	-	-	-	-
() (BE000837)	21	2555	3.700	1,110,000,000	1,110,000,000	0.37	-	-	-	-
() (BE001138)	9	2555	3.250	340,000,000	340,000,000	0.11	-	-	-	-
() (BE001148)	20	2555	3.280	380,000,000	380,000,000	0.13	-	-	-	-
					12,521,908,815	4.14			13,048,080,435	4.32
(LB116A)	17	2554	-	-	-	-	1.750	110,000,000	109,807,947	0.04
(LB111NA)	30	2554	-	-	-	-	5.375	135,300,000	138,930,354	0.05
(LB12NA)	1	2555	4.125	20,000,000	20,160,860	0.01	4.125	20,000,000	20,488,943	0.01
(LB133A)	13	2556	4.250	1,117,800,000	1,133,211,388	0.37	4.250	1,360,000,000	1,400,415,650	0.46
(LB137A)	13	2556	5.250	680,000,000	701,611,644	0.23	5.250	760,000,000	802,079,080	0.26
(LB145B)	12	2557	5.250	53,000,000	55,637,060	0.02	5.250	617,000,000	659,096,454	0.22
(LB155A)	22	2558	3.625	166,000,000	168,894,687	0.06	3.625	306,000,000	311,195,197	0.10
(LB15DA)	11	2558	3.125	140,000,000	140,431,505	0.05	-	-	-	-
(LB16NA)	18	2559	4.125	100,000,000	104,428,948	0.03	4.125	140,000,000	145,318,886	0.05
(LB170A)	10	2560	2.800	30,000,000	29,416,543	0.01	2.800	50,000,000	47,827,397	0.02
(LB183B)	13	2561	5.125	87,000,000	96,297,427	0.03	5.125	87,000,000	95,472,939	0.03
(LB191A)	12	2562	5.625	15,000,000	17,234,942	0.01	5.625	175,000,000	199,143,821	0.07

()			2554				2553			
			(%)	()	()	(%)	(%)	()	()	(%)
(BOT111A)	24	2554	-	-	-	-	3.700	110,000,000	110,115,401	0.04
(BOT114A)	16	2554	-	-	-	-	1.270	136,000,000	135,737,330	0.04
(BOT115A)	2	2554	-	-	-	-	3.625	900,000	904,559	0.00
(BOT116A)	25	2554	-	-	-	-	2.250	30,000,000	30,010,351	0.01
(BOT117B)	31	2554	-	-	-	-	4.750	173,000,000	175,463,700	0.06
(BOT118A)	20	2554	-	-	-	-	1.880	1,600,000	1,596,010	0.00
(BOT111NA)	13	2554	-	-	-	-	3.400	110,000,000	110,851,800	0.04
(BOT110A)	22	2554	-	-	-	-	2.150	390,000,000	389,395,676	0.13
(BOT121A)	29	2555	2.050	372,000,000	371,577,706	0.12	2.050	112,000,000	111,503,905	0.04
(BOT122A)	18	2555	2.100	210,000,000	209,638,191	0.07	2.100	460,000,000	457,842,204	0.15
(BOT124A)	29	2555	2.250	634,370,000	632,529,959	0.21	2.250	1,494,370,000	1,487,401,738	0.49
(BOT125A)	21	2555	1.650	290,000,000	288,361,379	0.10	1.650	290,000,000	285,715,046	0.09
(BOT126A)	17	2555	2.200	14,000,000	13,940,061	0.00	2.200	500,000,000	496,109,440	0.16
(BOT127A)	16	2555	2.475	1,687,760,000	1,681,528,301	0.56	2.475	1,805,760,000	1,800,264,422	0.59
(BOT128A)	19	2555	2.480	151,190,000	150,565,085	0.05	2.480	151,190,000	150,652,654	0.05
(BOT120A)	21	2555	2.350	70,000,000	69,569,534	0.02	-	-	-	-
(BOT12DA)	23	2555	-	-	-	-	2.820	150,000,000	149,733,608	0.05
(BOT131A)	14	2556	2.750	150,000,000	149,459,598	0.05	2.750	411,000,000	410,468,441	0.14
(BOT132A)	17	2556	3.050	961,000,000	960,467,808	0.32	-	-	-	-
(BOT135A)	20	2556	2.600	875,000,000	869,260,578	0.29	2.600	710,000,000	705,026,024	0.23
(BOT138A)	18	2556	3.420	370,000,000	371,802,725	0.12	-	-	-	-
(BOT139A)	23	2556	2.600	1,285,400,000	1,274,567,446	0.42	2.600	964,000,000	953,782,005	0.32
(BOT13NA)	18	2556	2.530	781,000,000	772,838,011	0.25	-	-	-	-
(BOT143A)	31	2557	3.200	20,000,000	20,045,733	0.01	-	-	-	-
(BOT145A)	12	2557	3.330	100,000,000	100,585,738	0.03	-	-	-	-

()			2554				2553			
			(%)	()	()	(%)	(%)	()	()	(%)
(BOTS139A)	3	2556	3.500	38,600,000	38,848,004	0.01	-	-	-	-
(CB11105A)	5	2554	-	-	-	-	1.917	50,000,000	49,989,498	0.02
(CB11110A)	10	2554	-	-	-	-	1.900	150,000,000	149,929,759	0.05
(CB11111A)	11	2554	-	-	-	-	1.903	100,000,000	99,947,890	0.03
(CB11113C)	13	2554	-	-	-	-	1.918	40,000,000	39,974,793	0.01
(CB11127C)	27	2554	-	-	-	-	1.860	60,000,000	59,920,609	0.02
(CB11331A)	31	2554	-	-	-	-	1.700	285,000,000	283,638,044	0.09
(CB11616A)	16	2554	-	-	-	-	1.520	87,340,000	86,512,321	0.03
(CB12105A)	5	2555	2.535	30,000,000	29,975,968	0.01	-	-	-	-
(CB12202A)	2	2555	3.150	10,000,000	9,971,065	0.00	-	-	-	-
(CB12202C)	2	2555	3.359	210,000,000	209,385,039	0.07	-	-	-	-
(CB12301A)	1	2555	3.340	100,000,000	99,489,718	0.03	-	-	-	-
(CB12301B)	1	2555	3.130	30,000,000	29,840,536	0.01	-	-	-	-
(CB12405A)	5	2555	3.130	65,000,000	64,475,823	0.02	-	-	-	-
(CB12426A)	26	2555	3.130	135,000,000	133,671,788	0.04	-	-	-	-
(CB12503A)	3	2555	3.140	475,000,000	470,136,215	0.16	-	-	-	-
(CB12803A)	3	2555	3.4114	850,000,000	834,660,540	0.28	-	-	-	-
(KEXI136A)	28	2556	2.800	200,000,000	197,391,262	0.07	2.800	200,000,000	197,946,740	0.07
(KEXI118A)	7	2554	-	-	-	-	5.390	185,000,000	187,869,799	0.06
					<u>30,254,355,239</u>	<u>10.00</u>			<u>22,775,711,577</u>	<u>7.54</u>
					<u>54,468,458,875</u>	<u>18.00</u>			<u>53,940,414,431</u>	<u>17.82</u>
					<u>302,689,772,165</u>	<u>100.00</u>			<u>302,673,674,474</u>	<u>100.00</u>

31 2554 2553

	2554	(:) 2553
	9,423,093,822	8,233,252,742
	752,231,392	598,382,753
	<u>10,175,325,214</u>	<u>8,831,635,495</u>
<i>10</i>	27,622,879	27,622,879
<i>10, 12</i>	61,612,074	64,200,000
<i>10</i>	5,216,250	5,350,000
<i>10</i>	16,050,000	16,050,000
<i>10, 12</i>	5,068,240	4,306,600
	1,008,000	1,008,000
	<u>116,577,443</u>	<u>118,537,479</u>
	<u>10,058,747,771</u>	<u>8,713,098,016</u>
()	2,876,868,155	696,479,939
()	<i>11</i> (5,794,633,361)	66,990,572,219
	<i>12</i> 2,195,962,966	(56,316,394,980)
()	<u>(721,802,240)</u>	<u>11,370,657,178</u>
	<u>9,336,945,531</u>	<u>20,083,755,194</u>

31 2554 2553

	2554	(:) 2553
	10,058,747,771	8,713,098,016
	2,876,868,155	696,479,939
()	(5,794,633,361)	66,990,572,219
	2,195,962,966	(56,316,394,980)
	<u>9,336,945,531</u>	<u>20,083,755,194</u>
	(4,200,000,000)	(4,550,000,000)
	(1,550,000,000)	(1,550,000,000)
14	<u>(5,750,000,000)</u>	<u>(6,100,000,000)</u>
	3,586,945,531	13,983,755,194
	162,440,270,057	148,456,514,863
	<u>166,027,215,588</u>	<u>162,440,270,057</u>

31 2554 2553

		(:)	
		2554	2553
		9,336,945,531	20,083,755,194
()		(70,315,291,801)	(58,785,597,089)
		67,395,868,059	56,137,298,013
		(2,919,423,742)	(2,648,299,076)
		(226,568,767)	(10,746,421)
		(1,488,018,730)	(24,035,124)
	()	373,233,965	(31,917,137)
	()	(6,504,421)	17,168,857
()		286,257	(456,424)
		28,628,226	28,628,373
()		(14,439,154)	30,269,402
		(2,876,868,155)	(696,479,939)
()		5,794,633,361	(66,990,572,219)
	()	(2,195,962,966)	56,316,394,980
		5,805,941,405	6,073,710,466
		(5,750,000,000)	(6,100,000,000)
		(5,750,000,000)	(6,100,000,000)
	()	55,941,405	(26,289,534)
		37,072,565	63,362,099
	(9)	93,013,970	37,072,565

31 2554, 2553, 2552, 2551, 2550 2549

(:)

		31					
		2554	2553	2552	2551	2550	2549
(.)		16.24	14.84	13.45	14.70	13.99	13.78
()		1.01	0.87	0.58	0.97	0.85	1.05
()		0.29	0.07	-0.09	0.01	0.07	0.02
()		-0.58	6.70	7.93	-14.55	9.26	-0.57
		0.22	-5.63	-6.67	13.03	-8.91	0.30
()		0.94	2.01	1.75	-0.54	1.27	0.80
		-0.58	-0.61	-0.36	-0.71	-0.56	-0.59
		16.60	16.24	14.84	13.45	14.70	13.99
()	(%)	5.70	13.12	12.38	-3.79	8.83	5.69
		166,027,215,588	162,440,270,057	148,456,514,863	134,521,531,427	147,006,966,293	139,882,577,285
	(%)	0.07	0.08	0.08	0.07	0.08	0.09
	(%)	6.22	5.77	4.18	6.90	6.02	7.59
	(%)*	18.8	10.76	10.11	12.99	8.99	3.34
		163,708,966,136	153,062,610,242	141,590,156,689	141,983,851,840	144,184,543,800	140,178,225,256

*

31 2554 2553

1.

1.1

()

()

(. . .)

1

2546

100,000

()

() ()

()

10

2

(1) . 70,000

(2) . 30,000

29 2554 . . .

()

()

1 2554

...

30

10

2547

SET50

1

2546

70,000

(Put Option)

(Call Option)

(Put Option)

(Call Option)

1.2

1
(/
) /
3
10
/

1.3

31 2554
433.0 197.4
(2553: 840.9 385.8)

2.

... 2547
106

3.

1 29
 2554

106

4.

1 3
 2556

106

5.

5.1

5.2

- 1) (Close Price)
 - 2) (Prior Price)
 - 3) (Last Bid)
-
1.
 - 1) (Executed Price/Yield)
 - 2) (Average Quoted Price/Yield)
firm quote
 - 3) (Model)
 - 4) rating
- (negative)
- (default)
-
2.
 - 1) (Average Quoted Price/Yield)
firm quote

2)

(Model)

3)

rating

(negative)

(default)

"

"

5.3

...

(Put Option)

(Call Option)

(1)

(2)

(1) (Put Option)

)
)
)

(2) (Call Option)

)
)
)

)
)
)

5.4

5.5

6.

7.

						(:)
					2554	2553
					<u>248,221,313,290</u>	<u>248,733,260,043</u>
	:	(Call Option)			(109,847,701,341)	(108,163,685,129)
					<u>138,373,611,949</u>	<u>140,569,574,914</u>
	:				304,400,827,537	303,009,844,971
					(138,373,611,949)	(140,569,574,914)
					<u>166,027,215,588</u>	<u>162,440,270,057</u>
	31	2554	2553			
					()	
				2553		()
	()		2553			
	31	2553				
	31	2554	2553			
						()
	()	()		2553		
"				"		
						(Call Option)
					31	2554
2553						

(:)

2554

			(:)		
1		3	2,100,000,000	900,000,000	3,000,000,000
2	3	7	1,400,000,000	2,600,000,000	4,000,000,000
3	7		2,951,360,780	56,075,854,808	59,027,215,588
			<u>6,451,360,780</u>	<u>59,575,854,808</u>	<u>66,027,215,588</u>
			70,000,000,000	-	70,000,000,000
			-	30,000,000,000	30,000,000,000
			<u>76,451,360,780</u>	<u>89,575,854,808</u>	<u>166,027,215,588</u>
()			<u>7,000,000,000</u>	<u>3,000,000,000</u>	<u>10,000,000,000</u>
			10.9216	29.8586	16.6027
			(:)		

2553

			(:)		
1		3	2,100,000,000	900,000,000	3,000,000,000
2	3	7	1,400,000,000	2,600,000,000	4,000,000,000
3	7		2,772,013,503	52,668,256,554	55,440,270,057
			<u>6,272,013,503</u>	<u>56,168,256,554</u>	<u>62,440,270,057</u>
			70,000,000,000	-	70,000,000,000
			-	30,000,000,000	30,000,000,000
			<u>76,272,013,503</u>	<u>86,168,256,554</u>	<u>162,440,270,057</u>
()			<u>7,000,000,000</u>	<u>3,000,000,000</u>	<u>10,000,000,000</u>
			10.8960	28.7227	16.2440

8.

		(:)	
		2554	2553
		48,347,798,628	39,634,700,612
		900,567,470	204,087,531
		189,961,478,843	122,970,906,624
		(140,569,574,914)	(84,253,179,934)
		(36,199,999,970)	(30,099,999,970)
		62,440,270,057	48,456,514,863
		9,336,945,531	20,083,755,194
		(5,750,000,000)	(6,100,000,000)
		66,027,215,588	62,440,270,057

9.

	31	2554			
			()		1.95
92,588,867			()		0.75
425,103		93,013,970			
	31	2553			
			()		0.25
37,072,565					

10.

10.1

142

10.2

5
15
()

() 1 2554

4.5

10.3

1 2547

(:)

()

-

10	3	34	44
10	3	10	42
10	10	50	60

34

30

24 2554

1 2554

10

70

0.01%

10.4

10.5

(1)

(2)

11. ()

(:)

2554	2553
<u>(189,961,478,843)</u>	<u>(122,970,906,624)</u>
184,166,845,482	189,961,478,843
<u>(5,794,633,361)</u>	<u>66,990,572,219</u>

()

/

/

12.

(:)

31	
2554	2553

2,195,962,966 56,316,394,980
- 1,639,225,000

829,950 386,400

()

30,746,922 32,100,000

()

30,865,152 32,100,000

31 2554 2553

(:)

2554		2553	
------	--	------	--

()

7,292,325 10,521,667

()

7,337,681 10,521,667

138,373,611,949 140,569,574,914

13.

(2553: 128,457,291,601 (2553: 113,782,802,081) 78.47
74.34)

14.

				()	()	()	()	()
28	2554	1	2553 -					
		31	2553	0.3500	0.5167	2,450	1,550	4,000
26	2554	1	2554 -					
		30	2554	0.2500	-	1,750	-	1,750
		2554				<u>4,200</u>	<u>1,550</u>	<u>5,750</u>
22	2553	1	2552 -					
		31	2552	0.3500	0.5167	2,450	1,550	4,000
20	2553	1	2553 -					
		30	2553	0.3000	-	2,100	-	2,100
		2553				<u>4,550</u>	<u>1,550</u>	<u>6,100</u>

15.

31 2554
() () 12 (2553: 12
)

16.

16.1

107 "

"

ความเสี่ยงด้านการให้สินเชื่อ

ความเสี่ยงจากอัตราดอกเบี้ย

31

2554

()

			1					
1	5	5						
			()				()	
15,050	15,039	143	469	271,989	302,690	0.50 - 5.625		
-	-	-	93	-	93	0.75 - 1.95		
-	-	-	-	399	399	-		
-	-	-	-	1,586	1,586	-		
-	-	-	-	405	405	-		
-	-	-	-	17	17	-		

ความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

16.2

17.

18.

19.

18

2555

.

0.05

350

15

2555

20.

()

()

13

2555

รายชื่อบุคคลที่เกี่ยวข้อง

ในส่วนของบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน เอ็มเอฟซี จำกัด (มหาชน)

ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2554

1	()	30	
2		31	
3	()	32	
4		33	
5		34	
6		35	
7		36	
8	MFH 48.99	37	
9	MFH 99.99	38	
10	MFH 99.99	39	
11	MFH 99.99	40	
12	.	41	
13		42	
14		43	
15		44	
16		45	
17		46	
18	...	47	
19		48	
20		49	
21		50	
22		51	
23		52	
24		53	
25		54	
26		55	
27		56	
28		57	
29		58	

รายชื่อบุคคลที่เกี่ยวข้อง (ต่อ)

ในส่วนของบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน เอ็มเอฟซี จำกัด (มหาชน)

ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2554

59		86	5/365/53
60		87	26/28/2554
61		88	30/28/2554
62		89	L5/182/54
63		90	37/28/2554
64		91	39/28/2554
65		92	31/28/2554
66		93	31/91/2554
67		94	29/182/2554
68		95	44/28/2554
69		96	
70	5/2 /2553	97	
71	4/3 /2553	98	10% 1
72	31/182/2554	99	1/2552 3
73	43/91/2554	100	1/2552 2
74	29/182/2554	101	1/2552 1
75	49/182/2554	102	() 1/2553 . . 2558
76	. 101/14/2554	103	() 2/2553 . . 2555
77	. 103/13/2554	104	2,500,000,000 1/2553 1 . . 2556
78	1/364/53	105	() 1/2553 1 . . 2556
79	. 98/15/53	106	() 1/2553 2 . . 2558
80	. 102/13/53	107	() 1/2553 . . 2556
81	. 5/14/54	108	() 1/2553 . . 2556
82	. 7/14/54	109	
83	. 21/14/54	110	() 2/2552 2
84	. 23/14/54	111	()
85	. 30/15/54	112	Asean Investment Trust (AIT)

รายชื่อบุคคลที่เกี่ยวข้อง (ต่อ)

ในส่วนของบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงเทพ จำกัด (มหาชน)

ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2554

1	() *	30	
2	.	31	
3	.	32	
4	.	33	
5	.	34	
6	.	35	
7	.	36	
8	.	37	
9		38	
10		39	
11		40	
12		41	
13		42	
14		43	
15		44	
16		45	
17		46	
18		47	
19		48	
20		49	
21		50	
22		51	
23		52	
24		53	
25		54	
26		55	
27		56	
28		57	()
29			

หมายเหตุ * เป็นบุคคลที่เกี่ยวข้องที่ทำธุรกรรมกับกองทุน

website . www.mfcfund.com www.ktam.co.th
website <http://www.sec.or.th>

การใช้สิทธิออกเสียงในที่ประชุมผู้ถือหุ้น

www.mfcfund.com

www.ktam.co.th

รายงานรายชื่อผู้จัดการกองทุนของกองทุนรวมวายุภักษ์ หนึ่ง

ในส่วนของบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน เอ็มเอฟซี จำกัด (มหาชน)

ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2554

รายงานรายชื่อผู้จัดการกองทุนของกองทุนรวมวายุภักษ์ หนึ่ง

ในส่วนของบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงเทพ จำกัด (มหาชน)

ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2554

รายงานการลงทุนไม่เป็นไปตามนโยบายการลงทุนเฉลี่ยในรอบปีบัญชี

กองทุนรวมวายุภักษ์ หนึ่ง

รอบปีบัญชีระหว่าง วันที่ 1 มกราคม 2554 ถึงวันที่ 31 ธันวาคม 2554

**การรับผลประโยชน์ตอบแทนจากการที่กองทุนใช้บริการบุคคลอื่น (Soft Commission)
ของกองทุนรวมวายุภักษ์ หนึ่ง**

()

company visit
(Quantitative)

(Qualitative)

(Portfolio constructive)

1.		16.	.
2.	.	17.	
3.	.	()	18.
4.		19.	.
5.		20.	.
6.	.	()	
7.	.	()	21.
8.	.		22.
9.	.	()	23.
10.	.	()	24.
11.			25.
12.	.		26.
13.	.	()	27.
14.	.	()	28.
15.	.		()
		29.	.

()

real time

			/
1	.		
2	.	()	
3	.	()	

**การรับผลประโยชน์ตอบแทนเนื่องจากการที่กองทุนรวมวายุภักษ์ หนึ่ง ใช้บริการบุคคลอื่นๆ
(Soft Commission)**

1	()	
2	()	
3	()	
4		
5		
6	()	
7	()	
8	()	
9		
10	()	
11	()	

ความเห็นของบริษัทจัดการกองทุนรวมเกี่ยวกับการลงทุนเพื่อเป็นทรัพย์สิน
ของกองทุนรวมวายุภักษ์ หนึ่ง

			2554		
	30	2554	1,025.32	7.44	0.72%
2553				1,148.28	
	843.69		27,124		5,119
			29,145		32,961
			1,303		
				43.20	
			32.68		
	39.65			16.12	
	0.71		3.83		5.15
	7.00			25.84	
27.51					
			2554		
1.					
2.					
3.					
4.					
5.					
6.			50		
	4				

2555

2555

-

2555

1.

2555

2.

PIIGS

EU

3.

2-3

4.

5.

6.

23

2555

2554
 8 2554
 24 2554 (.) 2 2553 3.50
 30 2554 3.25

(Yield Curve) 1 1
 +72 +121 bps. 2 3
 +4 +31 bps. 5 10 -10
 -42 bps. 10
 -15 -44 bps.

2555
 2555
 2555

31 2554 89.86
10.14
31 2553 92.31 7.69
2.45
31 2554
48.17 33.80 2.37
1.23 30 2553
50.69 31.04 5.75
1.26
1.34 4.14 4.32
1.66



กองทุนรวมวายุภักดิ์ หนึ่ง
VAYUPAK FUND 1
ลงทุนเพื่อค่า วัฒนาถาวร