

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน วรณ จำกัด

กองทุนเปิด วรณ แอนโท คอร์ปชั่น 70 หุ้นระยะยาว

ONE ANTI-CORRUPTION 70 LONG TERM EQUITY FUND

ONE-ACT70LTF

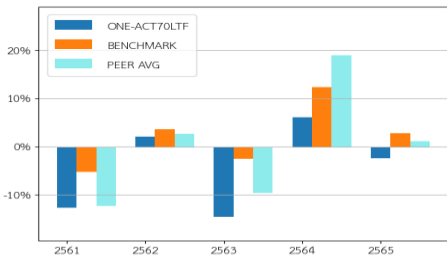
ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- 🏠 กองทุนรวมตราสารทุน
- 🏠 กองทุนรวมหุ้นระยะยาว
- 🏠 Equity General

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- มีนโยบายเน้นลงทุนในตราสารของบริษัทที่มีแนวโน้มหรือปัจจัยพื้นฐานดีและดำเนินธุรกิจภายใต้หลักธรรมาภิบาล ซึ่งผ่านเกณฑ์การพิจารณาหรือดัชนีชี้วัดในด้านการกำกับดูแลกิจการที่ดีจากองค์กรหรือสถาบันที่เกี่ยวข้องกับการกำกับดูแลกิจการ การต่อต้านการทุจริตในระดับ 4 ขึ้นไป รวมทั้งตราสารภาครัฐ โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของ NAV โดยในสัดส่วนดังกล่าวจะเป็นหุ้นสามัญจดทะเบียนใน SET และ/หรือ MAI เฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 65 ของ NAV และไม่เกินร้อยละ 70 ของ NAV
- กองทุนอาจพิจารณาลงทุนในตราสารหนี้ที่มีอันดับความน่าเชื่อถือต่ำกว่าที่สามารถลงทุนได้ ตราสารหนี้ที่ไม่ได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือ และตราสารทุนของบริษัทที่ไม่ได้จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์
- กองทุนอาจลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเพื่อเป็นการเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน หรือลงทุนเพื่อลดความเสี่ยง และกองทุนอาจลงทุนในตราสารที่มีลักษณะของสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแฝง ซึ่งเป็นไปตามหลักเกณฑ์หรือได้รับความเห็นชอบจากสำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ต.

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (% ต่อปี)



ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปีกลุ่ม (% ต่อปี)

	2561	2562	2563	2564	2565
ONE-ACT70LTF	-12.67%	2.03%	-14.59%	6.13%	-2.42%
BENCHMARK	-5.21%	3.6%	-2.55%	12.36%	2.76%
PEER AVG	-12.3%	2.69%	-9.61%	19.03%	1.13%

	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี
กองทุน	-11.05	-7.24	-5.73	-8.99
ดัชนีชี้วัด	-10.26	-7.25	-5.66	-7.77
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	-13.57	-8.3	-7.72	-10.63
ความผันผวนกองทุน	8.43	8.1	8.55	8.01
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	8.27	8.44	8.39	7.92

	3 ปี	5 ปี	10 ปี	ตั้งแต่จัดตั้ง
กองทุน	0.65	-5.59	N/A	-2.7
ดัชนีชี้วัด	5.94	0.04	N/A	1.92
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	6.16	-1.98	0.99	N/A
ความผันผวนกองทุน	10.2	11.28	N/A	10.59
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	10.66	12.33	N/A	11.06

ระดับความเสี่ยง



ลงทุนในตราสารทุนเป็นหลักโดยเฉลี่ยในรอบปีไม่น้อยกว่า 80 % ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน	30 กันยายน 2559
วันเริ่มต้น class	30 กันยายน 2559
นโยบายการจ่ายเงินปันผล	จ่าย
อายุกองทุน	ไม่กำหนด

ผู้จัดการกองทุนรวม

- นายชัยพฤกษ์ กุลกาญจนารช (ตั้งแต่ 3 มกราคม 2564)
- นายบัญชา จึงวัฒนกิจ (ตั้งแต่จดทะเบียน)

ดัชนีชี้วัด

ดัชนีผลตอบแทนรวมตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET TRI) สัดส่วน 70.00% และดัชนีตราสารหนี้ภาครัฐระยะสั้น (ThaiBMA Short-term Government Bond Total Return Index) สัดส่วน 30.00%

คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวมมิได้เป็นลสิ่งยืนยันถึง ผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต : ได้รับการรับรอง CAC
จัดอันดับกองทุน Morningstar ★★

ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือ

บริหารความเสี่ยงด้านสภาพ

คล่อง

ได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



www.one-asset.com

การซื้อหน่วยลงทุน

วันทำการซื้อ :	ทุกวันทำการ
เวลาทำการ :	09:00 - 15:00 น.
การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ :	5,000.00 บาท
การซื้อครั้งถัดไปขั้นต่ำ :	5,000.00 บาท

การขายคืนหน่วยลงทุน

วันทำการขายคืน :	ทุกวันทำการ
เวลาทำการ :	09:00 - 15:30 น.
การขายคืนขั้นต่ำ :	ไม่กำหนด
ยอดคงเหลือขั้นต่ำ :	100 หน่วย
ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน :	T+3 คือ 3 วันทำการ
หลังจากวันทำการขายคืน	

หมายเหตุ : บริษัทจัดการของสงวนสิทธิ์ไม่เปิดรับคำสั่งซื้อหน่วยลงทุนเพิ่มเติม และรับคำสั่งลับเปลี่ยนหน่วยลงทุนระหว่างกันเฉพาะหน่วยลงทุนกองทุนรวมหุ้นระยะยาวที่ถือครองก่อนวันที่ 1 มกราคม 2563 เท่านั้น

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	2.675	2.675
รวมค่าใช้จ่าย	6.42	3.7771

หมายเหตุ :

- ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่มภาษีธุรกิจเฉพาะ หรือภาษีอื่นใดแล้ว
- ค่าใช้จ่ายที่กองทุนเรียกเก็บอาจเปลี่ยนแปลงตามความเหมาะสม โดยเก็บในอัตราไม่เกินจากที่ระบุไว้ในโครงการ
- สามารถดูข้อมูลค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายย้อนหลัง 3 ปี ของกองทุนในหนังสือชี้ชวนส่วนข้อมูลกองทุนรวม ได้ที่ www.one-asset.com

one-asset.com

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การขาย	2.14	ยกเว้น
การรับซื้อคืน	2.14	ยกเว้น
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า	2.14	ยกเว้น
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก	1.07	ยกเว้น
การโอนหน่วยลงทุน	ตามที่นายทะเบียนเรียกเก็บ	ตามที่นายทะเบียนเรียกเก็บ

หมายเหตุ :

- ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่มภาษีธุรกิจเฉพาะ หรือภาษีอื่นใดแล้ว
- ค่าใช้จ่ายที่กองทุนเรียกเก็บอาจเปลี่ยนแปลงตามความเหมาะสม โดยเก็บในอัตราไม่เกินจากที่ระบุไว้ในโครงการ
- ค่าธรรมเนียมการสับเปลี่ยนหน่วยลงทุน
 - (3.1) กรณีกองทุนเป็นกองทุนต้นทาง
 - โอนย้ายไปยังกองทุนรวมหุ้นระยะยาวอื่นภายใต้การจัดการของบริษัทจัดการอื่น: 1.07% แต่ไม่ต่ำกว่า 200 บาท
 - โอนย้ายไปยังกองทุนรวมหุ้นระยะยาวอื่นภายใต้การจัดการของบริษัทจัดการ: ยกเว้นการเรียกเก็บ
 - (3.2) กรณีกองทุนเป็นกองทุนปลายทาง: เป็นไปตามค่าธรรมเนียมการขายหน่วยลงทุน

ข้อมูลเชิงสถิติ

Maximum Drawdown :	-14.85%
Recovering Period :	N/A
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน :	0.29 เท่า
Sharpe Ratio :	-0.01
Alpha :	-5.29%
Beta :	0.95

การจัดสรรการลงทุนในต่างประเทศ

ประเทศ	%NAV
ไทย	100

การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม

อุตสาหกรรม	%NAV
พลังงานและสาธารณูปโภค	23.11
พัฒนาอสังหาริมทรัพย์	20.03
ธนาคาร	12.5
พาณิชย์	9.93
เงินทุนและหลักทรัพย์	7.91

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน

ประเภททรัพย์สิน	%NAV
หุ้นในประเทศ	64.85
ตราสารหนี้ภาคเอกชน	25.62
เงินฝาก และอื่นๆ	6.29
ตราสารหนี้ภาครัฐ	3.25

ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก

ทรัพย์สิน	%NAV
หุ้นกู้บริษัท กัลฟ์ เอ็นเนอร์จี ดีเวลลอปเม้นท์ จำกัด(มหาชน)ครั้งที่ 1/2565 ชุดที่ 1 ครบกำหนด2568 (GULF252A)	6.45
หุ้นกู้ไม่ด้อยสิทธิและไม่มีประกันของบริษัท แลนด์ แอนด์ เฮ้าส์ จำกัด (มหาชน) ครั้งที่ 1/2565 ครบ2567 (LH244B)	6.42
บริษัท แอดวานซ์ อินโฟร์ เซอร์วิส จำกัด (มหาชน) (ADVANC)	5.44
บริษัท ปตท.สำรวจและผลิตปิโตรเลียม จำกัด (มหาชน) (PTTEP)	4.8
บริษัท ซีพี ออลล์ จำกัด (มหาชน) (CPALL)	4.66

คำอธิบาย

Maximum Drawdown เปรอ์เซ็นต์ผลขาดทุนสูงสุดของกองทุนรวมในระยะเวลา 5 ปีย้อนหลัง (หรือตั้งแต่จัดตั้งกองทุนกรณีที่ยังไม่ครบ 5 ปี) โดยวัดจากระดับ NAV ต่อหน่วยที่จุดสูงสุดไปจนถึงจุดต่ำสุด

ในช่วงที่ NAV ต่อหน่วยปรับตัวลดลง ค่า Maximum Drawdown เป็นข้อมูลที่ช่วยให้ทราบถึงความเสี่ยงที่อาจจะขาดทุนจากการลงทุนในกองทุนรวม

Recovering Period ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาตั้งแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้เวลานานเท่าใด

FX Hedging เปรอ์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตกองทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลานึง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์กับผลรวมของมูลค่าการขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 1 ปีหารด้วยมูลค่า NAV ของกองทุนรวมเฉลี่ยในรอบระยะเวลาเดียวกัน กองทุนรวมที่มีค่า portfolio turnover สูงบ่งชี้ถึงการซื้อขายหลักทรัพย์บ่อยครั้งของผู้จัดการกองทุนและทำให้มีต้นทุนการซื้อขายหลักทรัพย์ที่สูง จึงต้องพิจารณาเปรียบเทียบกับผลการดำเนินงานของกองทุนรวมเพื่อประเมินความคุ้มค่าของการซื้อขายหลักทรัพย์ดังกล่าว

Sharpe Ratio อัตราส่วนระหว่างผลตอบแทนส่วนเพิ่มของกองทุนรวมเปรียบเทียบกับความเสี่ยงจากการลงทุน โดยคำนวณจากผลต่างระหว่างอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมกับอัตราผลตอบแทนที่ปราศจากความเสี่ยง (risk-free rate) เปรียบเทียบกับค่าเบี่ยงเบนมาตรฐาน (standard deviation) ของกองทุนรวม ค่า Sharpe Ratio สะท้อนถึงอัตราผลตอบแทนที่กองทุนรวมควรได้รับเพิ่มขึ้นเพื่อชดเชยกับความเสี่ยงที่กองทุนรวมรับมา โดยกองทุนรวมที่มีค่า Sharpe Ratio สูงกว่าจะเป็นกองทุนที่มีประสิทธิภาพในการบริหารจัดการลงทุนที่ดีกว่าเนื่องจากได้รับผลตอบแทนส่วนเพิ่มที่สูงกว่าภายใต้ระดับความเสี่ยงเดียวกัน

Alpha ผลตอบแทนส่วนเกินของกองทุนรวมเมื่อเปรียบเทียบกับดัชนีชี้วัด (benchmark) โดยค่า Alpha ที่สูง หมายถึง กองทุนสามารถสร้างผลตอบแทนได้สูงกว่าดัชนีชี้วัด ซึ่งเป็นผลจากประสิทธิภาพของผู้จัดการกองทุนในการคัดเลือกหรือหาจังหวะเข้าลงทุนในหลักทรัพย์ได้อย่างเหมาะสม

Beta ระดับและทิศทางการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุน โดยเปรียบเทียบกับอัตราการเปลี่ยนแปลงของตลาด Beta น้อยกว่า 1 แสดงว่าหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนน้อยกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด Beta มากกว่า 1 แสดงว่า หลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนมากกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด

Tracking Error トラผลตอบแทนของกองทุนมีประสิทธิภาพในการเลียนแบบดัชนีชี้วัด โดยหาก tracking error ต่ำ หมายถึงกองทุนรวมมีประสิทธิภาพในการสร้างผลตอบแทนให้ใกล้เคียงกับดัชนีชี้วัด กองทุนรวมที่มีค่า tracking error สูง จะมีอัตราผลตอบแทนโดยเฉลี่ยห่างจากดัชนีชี้วัดมากขึ้น

Yield to Maturity อัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในตราสารหนี้โดยถือจนครบกำหนดอายุ ซึ่งคำนวณจากดอกเบี้ยที่จะได้รับในอนาคตตลอดอายุตราสารและเงินต้นที่จะได้รับคืนนำมาคิดลดเป็นมูลค่าปัจจุบัน โดยใช้ตัวอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมตราสารหนี้ คำนวณจากค่าเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักของ Yield to Maturity ของตราสารหนี้แต่ละตัวที่กองทุนมีการลงทุน และเนื่องจาก Yield to Maturity มีหน่วยมาตรฐานเป็นเปอร์เซ็นต์ต่อปี จึงสามารถนำไปใช้เปรียบเทียบอัตราผลตอบแทนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีนโยบายถือครองตราสารหนี้จนครบกำหนดอายุและมีลักษณะการลงทุนที่ใกล้เคียงกันได้

บริษัท หลักทรัพย์จัดการกองทุน วรณ จำกัด

เลขที่ 989 อาคารสยามพิพรรธน์ทาวเวอร์ ชั้น 9, 24 ถนนพระราม 1 แขวงปทุมวัน เขตปทุมวัน

กรุงเทพมหานคร 10330

โทรศัพท์ 0-2659-8888 โทรสาร 0-2659-8860-1

www.one-asset.com/