บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน วรรณ จำกัด

# กองทุนเปิด เอกตราสารหนี้คืนกำไร

# ONE FIXED INCOME AUTOMATIC REDEMPTION FUND

ONE-FAR

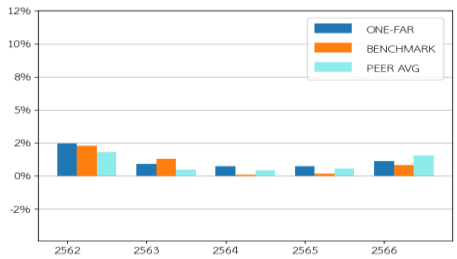
## ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมตราสารหนี้
- Short Term General Bond

## นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- กองทุนมีนโยบายลงทุนในตราสารแห่งหนี้ที่ให้ผลตอบแทนสูงและมีความมั่นคงเป็นหลัก กองทุนจะลงทุนในทรัพย์สินประเภทตราสารหนี้รวมกันทุกขณะไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน
- กองทุนสามารถลงทุนในกองทุนรวมทั่วไปอื่นที่อยู่ภายใต้การบริหารจัดการเดียวกันได้ไม่จำกัดอัตราส่วน
- กองทุนอาจลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) เพื่อลดความเสี่ยง(Hedging) หรือเพื่อเป็นการเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน (Efficient Portfolio Management)
- กองทุนมีกลยุทธ์การลงทุนเพื่อมุ่งหวังให้ผลประกอบการเคลื่อนไหวตามดัชนีชี้วัด และในบางโอกาสอาจสร้างผลตอบแทนสูงกว่าดัชนีชี้วัด

## ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (% ต่อปี)




## ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด (% ต่อปี)

| | 2562 | 2563 | 2564 | 2565 | 2566 |
|---|---|---|---|---|---|
| ONE-FAR | 2.51% | 0.91% | 0.74% | 0.73% | 1.13% |
| BENCHMARK | 2.28% | 1.28% | 0.08% | 0.18% | 0.8% |
| PEER AVG | 1.81% | 0.49% | 0.42% | 0.55% | 1.53% |

| | YTD | 3 เดือน | 6 เดือน | 1 ปี |
|---|---|---|---|---|
| กองทุน | 1.57 | 0.59 | 1.11 | 2.49 |
| ดัชนีชี้วัด | 1.29 | 0.62 | 0.81 | 1.81 |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน | 1.47 | 0.49 | 1.04 | 2.21 |
| ความผันผวนกองทุน | 0.13 | 0.1 | 0.13 | 0.13 |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด | 0.28 | 0.21 | 0.29 | 0.27 |

| | 3 ปี | 5 ปี | 10 ปี | ตั้งแต่จัดตั้ง |
|---|---|---|---|---|
| กองทุน | 1.19 | 1.11 | 1.58 | 3.66 |
| ดัชนีชี้วัด | 0.74 | 0.84 | 1.49 | 1.84 |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน | 1.14 | 0.96 | 1.2 | N/A |
| ความผันผวนกองทุน | 0.42 | 0.38 | 0.39 | 1.38 |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด | 0.57 | 0.5 | 0.55 | 1.38 |

## ระดับความเสี่ยง

| ต่ำ | 1 | 2 | 3 | **4** | 5 | 6 | 7 | 8 | 8+ | สูง |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|

**เสี่ยงปานกลางค่อนข้างต่ำ**

ลงทุนในพันธบัตรรัฐบาล และตราสารหนี้เอกชน โดยมีตราสาร non-investment grade /unrated ไม่เกิน 20 % ของ NAV

## ข้อมูลกองทุนรวม

| | |
|---|---|
| วันจดทะเบียนกองทุน | 19 มีนาคม 2540 |
| วันเริ่มต้น class | 19 มีนาคม 2540 |
| นโยบายการจ่ายเงินปันผล | ไม่จ่าย |
| อายุกองทุน | ไม่กำหนด |

## ผู้จัดการกองทุนรวม

- น.ส.พรอุมา เทวาหุดี (ตั้งแต่ 19 มิถุนายน 2543)
- น.ส.จันทร์เพ็ญ ชูวงษ์ (ตั้งแต่จดทะเบียน)

## ดัชนีชี้วัด

อัตราดอกเบี้ยเงินฝากประจำ 1 ปี วงเงินน้อยกว่า 5 ล้านบาท เฉลี่ยของ 3 ธนาคารพาณิชย์ขนาดใหญ่ ได้แก่ ธนาคารกรุงเทพ ธนาคารกสิกรไทย และธนาคารไทยพาณิชย์ หลังหักภาษี สัดส่วนร้อยละ 50 และอัตราผลตอบแทนรวมสุทธิของดัชนีพันธบัตรรัฐบาลอายุ 1 - 3 ปี ของสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย สัดส่วนร้อยละ 50

## คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวมมิได้เป็นสิ่งยืนยันถึง ผลการดำเนินงานในอนาคต

**การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต : ได้รับการรับรอง CAC**

**จัดอันดับกองทุน Morningstar ★★★★**

**ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือ บริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่อง 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 - 15:00 น.

การขายคืนขั้นต่ำ : ไม่กำหนด

ยอดคงเหลือขั้นต่ำ : 100 หน่วย

ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน : T+2 คือ2 วันทำการหลังจากวันทำรายการขายคืน

หมายเหตุ :

ผู้ลงทุนจะได้รับผลตอบแทนอย่างสม่ำเสมอจากการที่กองทุนจะดำเนินการ รับซื้อคืนหน่วยลงทุนโดยอัตโนมัติ ในอัตราไม่ต่ำกว่าร้อยละ 90 ของส่วนเกินมูลค่าเงินลงทุน (Capital Gain) ในวันที่ 31 มกราคม วันที่ 31 พฤษภาคม และวันที่ 30 กันยายน ของทุกปี หรือวันทำการก่อนหน้าในกรณีที่วันดังกล่าวตรงกับวันหยุด

## ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)

| ค่าธรรมเนียม | สูงสุดไม่เกิน | เก็บจริง |
|---|---|---|
| การจัดการ | 0.867 | 0.428 |
| รวมค่าใช้จ่าย | 4.28 | 0.56175 |

หมายเหตุ :

1.ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่มภาษีธุรกิจเฉพาะ หรือภาษีอื่นใดแล้ว

2.ค่าใช้จ่ายที่กองทุนเรียกเก็บอาจเปลี่ยนแปลงตามความเหมาะสม โดยเก็บในอัตราไม่เกินจากที่ระบุไว้ในโครงการ

3. สามารถดูข้อมูลค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายย้อนหลัง 3 ปี ของกองทุนในหนังสือชี้ชวนส่วนข้อมูลกองทุนรวม ได้ที่ www.one-asset.com

## ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)

| ค่าธรรมเนียม | สูงสุดไม่เกิน | เก็บจริง |
|---|---|---|
| การขาย | ยกเว้น | ยกเว้น |
| การรับซื้อคืน | ยกเว้น | ยกเว้น |
| การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า | ยกเว้น | ยกเว้น |
| การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก | ยกเว้น | ยกเว้น |
| การโอนหน่วยลงทุน | ตามที่นายทะเบียนเรียกเก็บ | ตามที่นายทะเบียนเรียกเก็บ |

หมายเหตุ :

1. ค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายดังกล่าวข้างต้นเป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่มหรือภาษีอื่นใดในทำนองเดียวกันแล้ว

2.ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บอาจเปลี่ยนแปลงตามความเหมาะสม โดยเก็บในอัตราไม่เกินจากที่ระบุไว้ในโครงการ

3. กรณีกองทุน ONE-FAR (กองทุนต้นทาง) ลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมซึ่งอยู่ภายใต้การบริหารของบริษัทจัดการเดียวกัน (กองทุนปลายทาง) บริษัทจัดการจะไม่คิดค่าธรรมเนียมการจัดการ และ/หรือ ค่าธรรมเนียมการขายของกองทุนรวมต้นทางซ้ำซ้อนกับกองทุนรวมปลายทาง

## สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน

| ประเภททรัพย์สิน | %NAV |
|---|---|
| ตราสารหนี้ภาคเอกชน | 49.9 |
| ตราสารหนี้ภาครัฐ | 49.65 |
| เงินฝาก และอื่นๆ | 0.45 |

## ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก

| ทรัพย์สิน | %NAV |
|---|---|
| พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 27/91/67 | 9.89 |
| หุ้นกู้ของธนาคารเกียรตินาคินภัทร จากัด (มหาชน) ครั้งที่ 6/2566 ครบกาหนดไถ่ถอนปี พ.ศ. 2567 | 8.15 |
| พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 25/91/67 | 7.92 |
| พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 31/91/67 | 7.4 |
| พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 34/91/67 | 6.16 |

## ข้อมูลเชิงสถิติ

Maximum Drawdown : -0.69%

Recovering Period : 4 เดือน

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน : 5.17 เท่า

อายุเฉลี่ยของตราสารหนี้ : 5 เดือน 15 วัน

Yield to Maturity : 2.46% ต่อปี

## การจัดสรรการลงทุนในต่างประเทศ

| ประเทศ | %NAV |
|---|---|
| ไทย | 100 |

## ผู้ออกตราสาร 5 อันดับแรก

| อุตสาหกรรม | %NAV |
|---|---|
| BANK OF THAILAND | 49.65 |
| KIATNAKIN PHATRA BANK PUBLIC COMPANY LIMITED | 8.15 |
| CHAROEN POKPHAND FOODS PUBLIC COMPANY LIMITED | 6.15 |
| EASY BUY PUBLIC COMPANY LIMITED | 4.95 |
| LAND AND HOUSES PUBLIC COMPANY LIMITED | 4.42 |

## การจัดสรรการลงทุนตามอันดับความน่าเชื่อถือ (%NAV)

| | ในประเทศ | national | international |
|---|---|---|---|
| GOV/AAA/AAA(tha) | 49.65 | 0.0 | |
| AA/AA(tha) | 7.57 | 6.64 | |
| A/A(tha) | 35.73 | 0.5 | |
| BBB/BBB(tha) | | | |
| ต่ำกว่า BBB | | | |
| unrated | | | |

**คำอธิบาย**

**Maximum Drawdown** เปอร์เซ็นต์ผลขาดทุนสูงสุดของกองทุนรวมในระยะเวลา 5 ปีย้อนหลัง (หรือตั้งแต่จัดตั้งกองทุนกรณีที่ยังไม่ครบ 5 ปี) โดยวัดจากระดับ NAV ต่อหน่วยที่จุดสูงสุดไปจนถึงจุดต่ำสุดในช่วงที่ NAV ต่อหน่วยปรับตัวลดลง ค่า Maximum Drawdown เป็นข้อมูลที่ช่วยให้ทราบถึงความเสี่ยงที่อาจจะขาดทุนจากการลงทุนในกองทุนรวม

**Recovering Period** ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาตั้งแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลานานเท่าใด

**FX Hedging** เปอร์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

**อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน** ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตกองทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลาหนึ่ง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อหลักทรัพย์กับผลรวมของมูลค่าการขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 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** ตราผลตอบแทนของกองทุนมีประสิทธิภาพในการเลียนแบบดัชนีชี้วัด โดยหาก tracking error ต่ำ หมายถึงกองทุนรวมมีประสิทธิภาพในการสร้างผลตอบแทนให้ใกล้เคียงกับดัชนีชี้วัด กองทุนรวมที่มีค่า tracking error สูง จะมีอัตราผลตอบแทนโดยเฉลี่ยห่างจากดัชนีชี้วัดมากขึ้น

**Yield to Maturity** อัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในตราสารหนี้โดยถือจนครบกำหนดอายุ ซึ่งคำนวณจากดอกเบี้ยที่จะได้รับในอนาคตตลอดอายุตราสารและเงินต้นที่จะได้รับคืนนำมาคิดลดเป็นมูลค่าปัจจุบัน โดยใช้วัดอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมตราสารหนี้ คำนวณจากค่าเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักของ Yield to Maturity ของตราสารหนี้แต่ละตัวที่กองทุนมีการลงทุน และเนื่องจาก Yield to Maturity มีหน่วยมาตรฐานเป็นเปอร์เซ็นต์ต่อปี จึงสามารถนาไปใช้เปรียบเทียบอัตราผลตอบแทนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีนโยบายถือครองตราสารหนี้จนครบกาหนดอายุและมีลักษณะการลงทุนที่ใกล้เคียงกันได้

**บริษัท หลักทรัพย์จัดการกองทุน วรรณ จำกัด**

เลขที่ 989 อาคารสยามพิวรรธน์ทาวเวอร์ ชั้น 9, 24 ถนนพระราม 1 แขวงปทุมวัน เขตปทุมวัน

กรุงเทพมหานคร 10330

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

www.one-asset.com/