

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน วรธร จำกัด

กองทุนเปิด วรธร STOXX อาเซียน ซีเล็ค ดิวิเดนด อินเด็กซ์ ฟินด์

ONE STOXX ASEAN SELECT DIVIDEND INDEX FUND

ONE-STOXXASEAN

ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

ระดับความเสี่ยง

🏠 กองทุนรวมตราสารทุน

🏠 กองทุนรวมดัชนี

🏠 ASEAN Equity

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- กองทุนมีนโยบายลงทุนในตราสารแห่งทุน และ/หรือ หุ้นสามัญ จำนวน 30 บริษัทที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ และเป็นส่วนประกอบของดัชนี STOXX ASEAN SELECT DIVIDEND 30 INDEX โดยลงทุนในสัดส่วนหรือน้ำหนักที่ใกล้เคียงกับดัชนี (Fully Replication) โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน
- กองทุนอาจลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) มีตัวแปรเป็นอัตราแลกเปลี่ยนเพื่อป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน
- กองทุนมีกลยุทธ์การลงทุนเพื่อมุ่งหวังให้เกิดผลประกอบการตามดัชนีชี้วัด (Passive Management)



ลงทุนในตราสารทุนเป็นหลักโดยเฉลี่ยในรอบปีไม่น้อยกว่า 80 % ของ NAV

**ข้อมูลกองทุนรวม**

วันจดทะเบียนกองทุน	29 มิถุนายน 2558
วันเริ่มต้น class	29 มิถุนายน 2558
นโยบายการจ่ายเงินปันผล	จ่าย
อายุกองทุน	ไม่กำหนด

**ผู้จัดการกองทุนรวม**

- 🏠 นายสุทธิโรจน์ สิทธิวัฒนานนท์ (ตั้งแต่จดทะเบียน)
- 🏠 นายธัชธรรม วิจารณกรณ์ (ตั้งแต่ 8 มกราคม 2559)

**ดัชนีชี้วัด**

ดัชนี STOXX ASEAN Select Dividend 30 Index USD โดยปรับด้วยอัตราแลกเปลี่ยนเพื่อเทียบกับค่าสกุลเงินบาท ณ วันที่คำนวณผลตอบแทน

**คำเตือน**

- 🏠 การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- 🏠 ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวมมิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต : ได้รับการรับรอง CAC

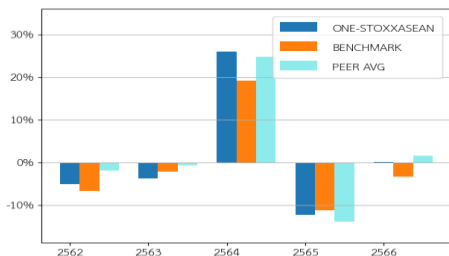
จัดอันดับกองทุน Morningstar ★★

- ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเรื่องมีอ
- บริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่อง
- ได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



[www.one-asset.com](http://www.one-asset.com)

**ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (% ต่อปี)**



**ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปีกลุ่ม (% ต่อปี)**

	2562	2563	2564	2565	2566
ONE-STOXXASEAN	-5.12%	-3.73%	25.97%	-12.28%	0.06%
BENCHMARK	-6.66%	-2.16%	19.13%	-11.2%	-3.31%
PEER AVG	-1.88%	-0.64%	24.8%	-13.86%	1.56%
	YTD	3 เดือน	6 เดือน		1 ปี
กองทุน	7.33	7.33	-2.17	3.98	
ดัชนีชี้วัด	7.87	7.87	-1.19	0.29	
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	10.93	10.93	5.69	10.74	
ความผันผวนกองทุน	8.92	8.92	10.2	10.37	
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	9.07	9.07	10.44	10.84	
	3 ปี	5 ปี	10 ปี		ตั้งแต่จัดตั้ง
กองทุน	5.07	0.8	N/A	0.03	
ดัชนีชี้วัด	2.37	-0.79	-0.21	-0.38	
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	2.79	2.14	-5.26	N/A	
ความผันผวนกองทุน	12.3	17.12	N/A	15.07	
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	12.69	16.9	14.26	15.07	

## การซื้อหน่วยลงทุน

วันทำการซื้อ : ทุกวันทำการ  
เวลาทำการ : 09:00 - 14:00 น.  
การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ : 10,000.00 บาท  
การซื้อครั้งถัดไปขั้นต่ำ : 10,000.00 บาท

## การขายคืนหน่วยลงทุน

วันทำการขายคืน : ทุกวันทำการ  
เวลาทำการ : 09:00 - 14:00 น.  
การขายคืนขั้นต่ำ : ไม่กำหนด  
ยอดคงเหลือขั้นต่ำ : 100 หน่วย  
ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน : T+4 คือ 4 วันทำการ  
หลังจากวันทำการขายคืน

## ข้อมูลเชิงสถิติ

Maximum Drawdown : -17.86%  
Recovering Period : N/A  
FX Hedging : N/A  
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน : 209.31 เท่า  
Sharpe Ratio : 0.35  
Alpha : 2.69%  
Beta : 0.92  
Tracking Error : 2.64%

## ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	2.675	0.535
รวมค่าใช้จ่าย	10.0	0.785

หมายเหตุ :

- ค่าธรรมเนียมดังกล่าวยังไม่รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใด
- ค่าใช้จ่ายที่กองทุนเรียกเก็บอาจเปลี่ยนแปลงตามความเหมาะสม โดยเก็บในอัตราไม่เกินจากที่ระบุไว้ในโครงการ
- สามารถดูข้อมูลค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายย้อนหลัง 3 ปี ของกองทุนในหนังสือชี้ชวนส่วนข้อมูลกองทุนรวม ได้ที่ [www.one-asset.com](http://www.one-asset.com)

## ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การขาย	2.14	1.25
การรับซื้อคืน	2.14	ยกเว้น
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า	2.14	1.25
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก	2.14	ยกเว้น
การโอนหน่วยลงทุน	ตามที่นายทะเบียนเรียกเก็บ	ตามที่นายทะเบียนเรียกเก็บ

หมายเหตุ :

- ค่าธรรมเนียมดังกล่าวยังไม่รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใด
- ค่าใช้จ่ายที่กองทุนเรียกเก็บอาจเปลี่ยนแปลงตามความเหมาะสม โดยเก็บในอัตราไม่เกินจากที่ระบุไว้ในโครงการ
- ค่าใช้จ่ายในการส่งเสริมการขาย ค่าโฆษณาและประชาสัมพันธ์กองทุนรวมจะไม่เรียกเก็บจากกองทุน

## สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน

ประเภททรัพย์สิน	%NAV
หุ้นในต่างประเทศ	85.86
หุ้นในประเทศ	10.75
เงินฝาก และอื่นๆ	3.39

## ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก

ทรัพย์สิน	%NAV
HOANG HUY INVESTMENT FINANCI (TCH VN Equity)	5.92
HDBANK (HDB VN Equity)	5.15
PETROVIETNAM GAS JSC (GAS VN Equity)	4.9
METROPOLITAN BANK & TRUST (MBT PM Equity)	3.44
INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P (INDF U Equity)	3.33

## การจัดสรรการลงทุนในต่างประเทศ

ประเทศ	%NAV
อินโดนีเซีย	22.03
สิงคโปร์	19.26
มาเลเซีย	18.81
เวียดนาม	15.97

## การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม

อุตสาหกรรม	%NAV
BANKS	37.12
CAPITAL GOODS	12.18
MATERIALS	6.39
ENERGY	6.3
TRANSPORTATION	6.23

## คำอธิบาย

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

**Recovering Period** ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาตั้งแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลาเวลานานเท่าใด

**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** 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 จึงสามารถนำไปใช้เปรียบเทียบอัตราผลตอบแทนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีนโยบายถือครองตราสารหนี้จนครบกำหนดอายุและมีลักษณะการลงทุนที่ใกล้เคียงกันได้

### บริษัท หลักทรัพย์จัดการกองทุน วรณ จำกัด

เลขที่ 989 อาคารสยามพิวรรณ์ทาวเวอร์ ชั้น 9, 24 ถนนพระราม 1 แขวงปทุมวัน เขตปทุมวัน

กรุงเทพมหานคร 10330

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

www.one-asset.com/