

## ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

กองทุนรวมตราสารทุน

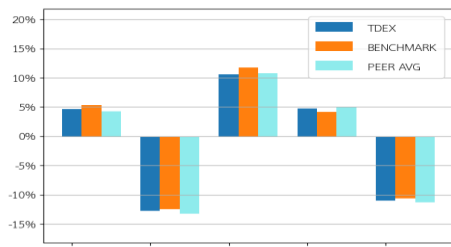
กองทุนรวมอีทีเอฟ

SET 50 Index Fund

## นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- กองทุนมีนโยบายลงทุนในตราสารแห่งทุนโดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน โดยเน้นลงทุนในหลักทรัพย์ที่เป็นส่วนประกอบของดัชนีอ้างอิง (SET50 Total Return Index) ซึ่งรวมถึงหลักทรัพย์ที่อยู่ในระหว่างการเข้าหรือออกจากการเป็นหลักทรัพย์ที่เป็นส่วนประกอบของดัชนีอ้างอิงด้วย
- กองทุนอาจลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (derivatives) โดยมีวัตถุประสงค์เพื่อสร้างผลตอบแทนให้ใกล้เคียงกับดัชนีอ้างอิง
- กองทุนมีกลยุทธ์การลงทุนเพื่อมุ่งหวังให้เกิดผลประกอบการเคลื่อนไหวตามดัชนีชี้วัด (Passive Management)

## ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (% ต่อปี)



## ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปีกลุ่ม (% ต่อปี)

	2562	2563	2564	2565	2566
TDEX	4.64%	-12.71%	10.61%	4.78%	-10.95%
BENCHMARK	5.32%	-12.41%	11.76%	4.2%	-10.65%
PEER AVG	4.22%	-13.21%	10.81%	4.94%	-11.29%

	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี
กองทุน	-2.53	-2.53	-4.92	-11.13
ดัชนีชี้วัด	-2.4	-2.4	-4.73	-10.79
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	-2.55	-2.55	-5.0	-11.27
ความผันผวนกองทุน	10.67	10.67	12.15	11.92
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	10.8	10.8	12.32	12.09

	3 ปี	5 ปี	10 ปี	ตั้งแต่จัดตั้ง
กองทุน	-2.1	-2.65	1.48	5.37
ดัชนีชี้วัด	-1.91	-2.31	1.97	5.61
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	-2.16	-2.89	1.34	N/A
ความผันผวนกองทุน	11.56	18.37	15.24	19.79
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	11.83	18.82	15.59	20.09

## ระดับความเสี่ยง



เสี่ยงสูง

ลงทุนในตราสารทุนเป็นหลักโดยเฉลี่ยในรอบปีไม่น้อยกว่า 80 % ของ NAV

## ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน 4 กันยายน 2550

วันเริ่มต้น class 4 กันยายน 2550

นโยบายการจ่ายเงินปันผล จ่าย

อายุกองทุน ไม่กำหนด

## ผู้จัดการกองทุนรวม

นายชัยพฤกษ์ กุลกาญจนาร (ตั้งแต่ 3 มกราคม 2564)

นายบัญชา จึงวัฒนกิจ (ตั้งแต่จดทะเบียน)

## ดัชนีชี้วัด

ดัชนีผลตอบแทนรวม SET50 (SET50 TRI)

## ค่าเตือน

การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน

ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวมมิได้เป็นที่ยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต : ได้รับการรับรอง CAC

ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือ

บริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่อง

ได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม


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

## การซื้อหน่วยลงทุน

วันที่ทำการซื้อ :

เวลาทำการ :

การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ : ไม่กำหนด

การซื้อครั้งถัดไปขั้นต่ำ : ไม่กำหนด

หมายเหตุ :

ศึกษารายละเอียดการซื้อขายและการขายคืนหน่วยลงทุนได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

## ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	0.47187	0.47187
รวมค่าใช้จ่าย	2.675	0.50932

หมายเหตุ :

- ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่มภาษีธุรกิจเฉพาะ หรือภาษีอื่นใดแล้ว
- ค่าใช้จ่ายที่กองทุนเรียกเก็บอาจเปลี่ยนแปลงตามความเหมาะสม โดยเก็บในอัตราไม่เกินจากที่ระบุไว้ในโครงการ
- สามารถดูข้อมูลค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายย้อนหลัง 3 ปี ของกองทุนในหนังสือชี้ชวนส่วนข้อมูลกองทุนรวม ได้ที่ [www.one-asset.com](http://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 :

- ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่มภาษีธุรกิจเฉพาะ หรือภาษีอื่นใดแล้ว
- ค่าใช้จ่ายที่กองทุนเรียกเก็บอาจเปลี่ยนแปลงตามความเหมาะสม โดยเก็บในอัตราไม่เกินจากที่ระบุไว้ในโครงการ

## สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน

ประเภททรัพย์สิน	%NAV
หุ้นในประเทศ	98.36
เงินฝาก และอื่นๆ	1.64

## การขายคืนหน่วยลงทุน

วันที่ทำการขายคืน :

เวลาทำการ :

การขายคืนขั้นต่ำ : ไม่กำหนด

ยอดคงเหลือขั้นต่ำ : ไม่กำหนด

ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน :

## ข้อมูลเชิงสถิติ

Maximum Drawdown : -16.55%

Recovering Period : N/A

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน : 0.08 เท่า

Tracking Error : 0.21%

## การจัดสรรการลงทุนในต่างประเทศ

ประเทศ	%NAV
ไทย	100

## การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม

อุตสาหกรรม	%NAV
พลังงานและสาธารณูปโภค	25.42
ธนาคาร	13.45
ขนส่งและโลจิสติกส์	9.7
เทคโนโลยีสารสนเทศและการสื่อสาร	9.36
พาณิชย์	8.37

## ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก

ทรัพย์สิน	%NAV
บริษัท ปตท. จำกัด (มหาชน) (PTT)	8.27
บริษัท ท่าอากาศยานไทย จำกัด (มหาชน) (AOT)	8.01
บริษัท เดลต้า อีเลคโทรนิคส์ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) (DELTA)	7.92
บริษัท แอดวานซ์ อินโฟร์ เซอร์วิส จำกัด (มหาชน) (ADVANC)	5.26
บริษัท ปตท.สำรวจและผลิตปิโตรเลียม จำกัด (มหาชน) (PTTEP)	5.24

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