

ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

ระดับความเสี่ยง

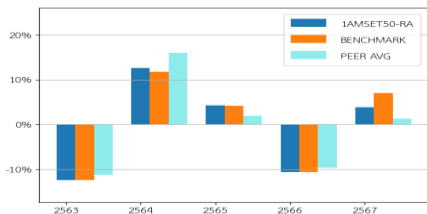
🏠 กองทุนรวมตราสารทุน

🏠 Equity Large Cap

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- กองทุนมีนโยบายลงทุนในตราสารทุนโดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน โดยเน้นลงทุนในหุ้นสามัญประมาณ 25 - 30 บริษัท ที่เป็นส่วนประกอบของดัชนี SET50
- กองทุนอาจลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) เพื่อลดความเสี่ยง (Hedging) หรือเพื่อเป็นการเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน (Efficient Portfolio Management)
- กองทุนมีกลยุทธ์การลงทุนเพื่อมุ่งหวังให้ผลประกอบการสูงกว่าดัชนีชี้วัด (active management)

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (% ต่อปี)



	2563	2564	2565	2566	2567
1AMSET50-RA	-12.42%	12.64%	4.25%	-10.67%	3.84%
BENCHMARK	-12.41%	11.76%	4.2%	-10.65%	7.03%
PEER AVG	-11.22%	16.03%	1.98%	-9.68%	1.34%

ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปีกumul (%)

	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี*
กองทุน	-15.81	-15.81	-18.33	-10.96
ดัชนีชี้วัด	-17.19	-17.19	-17.76	-9.18
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	-14.41	-14.41	-17.79	-11.4
ความผันผวนกองทุน	17.52	17.52	15.11	13.55
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	18.82	18.82	16.03	14.44
	3 ปี*	5 ปี*	10 ปี*	ตั้งแต่จัดตั้ง*
กองทุน	-7.4	2.12	0.2	7.77
ดัชนีชี้วัด	-7.38	2.46	0.02	6.76
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	-8.03	2.92	-0.53	N/A
ความผันผวนกองทุน	11.9	14.27	15.13	20.09
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	12.62	15.38	16.43	20.79

*หมายเหตุ: % ต่อปี



ลงทุนในตราสารทุนเป็นหลักโดยเฉลี่ยในรอบปีไม่น้อยกว่า 80 % ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน	27 พฤศจิกายน 2546
วันเริ่มต้น class	27 พฤศจิกายน 2546
นโยบายการจ่ายเงินปันผล	*ไม่จ่าย
อายุกองทุน	ไม่กำหนด

*ไม่จ่าย แต่จะมีการจัดสรรกำไรให้กับผู้ลงทุนในรูปแบบของการรับซื้อคืนหน่วยลงทุน แบบสม่ำเสมอตามคำสั่งล่วงหน้า ในสัดส่วนไม่น้อยกว่าร้อยละ 50 ของมูลค่าหน่วยลงทุนที่เพิ่มขึ้นของผู้ถือหน่วยลงทุนแต่ละราย เมื่อส่วนต่างของมูลค่าหน่วยลงทุนเพิ่มขึ้นทุกๆ ช่วง 1.00 บาท ในโอกาสแรกที่มูลค่าหน่วยลงทุนเพิ่มมากกว่าหรือเท่ากับ 11.00 บาท 12.00 บาท 13.00 บาท ฯลฯ ทั้งนี้ ส่วนต่างของมูลค่าหน่วยลงทุนที่ใช้ในการคำนวณนี้อาจมากกว่าหรือน้อยกว่า 1.00 บาทก็ได้ โดยผู้ลงทุนจะต้องแจ้งความจำนงให้กับบริษัทจัดการไว้เป็นลายลักษณ์อักษร

ผู้จัดการกองทุนรวม

- 🏠 นายชัยพลกฤษ์ กุลกาญจนารัตน์ (ตั้งแต่ 3 มกราคม 2564)
- 🏠 นายบัญชา จึงวัฒนกิจ (ตั้งแต่ 3 มกราคม 2549)

ดัชนีชี้วัด

ดัชนีผลตอบแทนรวม SET50 (SET50 TRI)

ค่าเตือน

- 🏠 การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- 🏠 ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวมมิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต : ได้รับการรับรอง CAC

จัดอันดับกองทุน Morningstar ★★★★★

ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือ

บริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่อง

ได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



การซื้อขายหน่วยลงทุน

วันทำการซื้อ : ทุกวันทำการ

เวลาทำการ : 09:00 - 15:30 น.

การซื้อขายครั้งแรกขั้นต่ำ : 1,000.00 บาท

การซื้อขายครั้งถัดไปขั้นต่ำ : 1,000.00 บาท

การขายคืนหน่วยลงทุน

วันทำการขายคืน : ทุกวันทำการ

เวลาทำการ : 09:00 - 15:30 น.

การขายคืนขั้นต่ำ : ไม่กำหนด

ยอดคงเหลือขั้นต่ำ : 100 หน่วย

ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน : T+3 คือ 3 วันทำการ

หลังจากวันทำการขายคืน

ข้อมูลเชิงสถิติ

Maximum Drawdown : -21.25%

Recovering Period : N/A

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน : 0.3 เท่า

Sharpe Ratio : -1.0

Alpha : -1.78%

Beta : 0.92

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	0.52002	0.52002
รวมค่าใช้จ่าย	6.42	0.65912

หมายเหตุ :

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

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การขาย	0.2675	0.2675
การรับซื้อคืน	ยกเว้น	ยกเว้น
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า	0.2675	0.2675
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก	ยกเว้น	ยกเว้น
การซื้อขายหลักทรัพย์ กรณีขายคืน	0.3	0.25
การโอนหน่วยลงทุน	ตามที่นายทะเบียนเรียกเก็บ	ตามที่นายทะเบียนเรียกเก็บ

หมายเหตุ :

- ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่มภาษีธุรกิจเฉพาะ หรือภาษีอื่นใดแล้ว
- ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บอาจเปลี่ยนแปลงตามความเหมาะสม โดยเก็บในอัตราไม่เกินจากที่ระบุไว้ในโครงการ

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน

ประเภททรัพย์สิน	%NAV
หุ้นในประเทศ	95.34
เงินฝาก และอื่นๆ	4.66

ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก

ทรัพย์สิน	%NAV
บริษัท แอดวานซ์ อินโฟร์ เซอร์วิส จำกัด (มหาชน)	9.42
บริษัท ปตท. จำกัด (มหาชน)	6.28
บริษัท กัลฟ์ เอ็นเนอร์จี ดีเวลลอปเม้นท์ จำกัด (มหาชน)	5.36
บริษัท ซีพี ออลล์ จำกัด (มหาชน)	5.19
บริษัท กรุงเทพดุสิตเวชการ จำกัด (มหาชน)	5.04

การจัดสรรการลงทุนในต่างประเทศ

ประเทศ	%NAV
ไทย	100

การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม

อุตสาหกรรม	%NAV
พลังงานและสาธารณูปโภค	18.56
ธนาคาร	17.05
เทคโนโลยีสารสนเทศและการสื่อสาร	15.41
พาณิชย์	10.78
การแพทย์	7.23

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/