

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน วรรม จำกัด

กองทุนเปิด เอกตราสารหนี้คืนกำไร

ONE FIXED INCOME AUTOMATIC REDEMPTION FUND

ONE-FAR

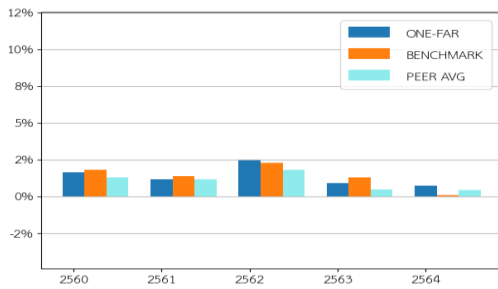
ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- 🏠 กองทุนรวมตราสารหนี้
- 🏠 Short Term General Bond

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

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

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (% ต่อปี)



|           | 2560  | 2561  | 2562  | 2563  | 2564  |
|-----------|-------|-------|-------|-------|-------|
| ONE-FAR   | 1.64% | 1.17% | 2.51% | 0.91% | 0.74% |
| BENCHMARK | 1.8%  | 1.39% | 2.28% | 1.28% | 0.08% |
| PEER AVG  | 1.3%  | 1.17% | 1.81% | 0.49% | 0.42% |

ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด (% ต่อปี)

|                          | YTD  | 3 เดือน | 6 เดือน | 1 ปี           |
|--------------------------|------|---------|---------|----------------|
| กองทุน                   | 0.73 | 0.36    | 0.52    | 0.73           |
| ดัชนีชี้วัด              | 0.18 | 0.68    | 0.79    | 0.18           |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน | 0.18 | N/A     | 0.18    | 0.37           |
| ความผันผวนกองทุน         | 0.08 | 0.09    | 0.08    | 0.08           |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด    | 0.49 | 0.29    | 0.42    | 0.49           |
|                          | 3 ปี | 5 ปี    | 10 ปี   | ตั้งแต่จัดตั้ง |
| กองทุน                   | 0.79 | 1.21    | 1.85    | 3.79           |
| ดัชนีชี้วัด              | 0.51 | 1.04    | 1.89    | 1.88           |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน | 0.66 | 0.89    | 1.46    | N/A            |
| ความผันผวนกองทุน         | 0.27 | 0.35    | 0.4     | 1.41           |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด    | 0.55 | 0.51    | 0.64    | 1.43           |

ระดับความเสี่ยง



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.พรอมา เทวาทูดี (ตั้งแต่ 19 มิถุนายน 2543)
- 🏠 น.ส.จันทร์เพ็ญ ชูวงศ์ (ตั้งแต่จดทะเบียน)

ดัชนีชี้วัด

อัตราผลตอบแทนถ่วงน้ำหนักระหว่างอัตราดอกเบี้ยเงินฝากประจำ 1 ปี วงเงินน้อยกว่า 5 ล้านบาท เหลือของ 3 ธนาคารพาณิชย์ขนาดใหญ่ ได้แก่ ธนาคารกรุงเทพ ธนาคารกสิกรไทย และธนาคารไทยพาณิชย์ หลังหักภาษี ในสัดส่วนร้อยละ 50 และอัตราผลตอบแทนรวมสุทธิของดัชนีพันธบัตรรัฐบาลอายุ 1-3 ปี ของสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย ในสัดส่วนร้อยละ

ค่าเตือน

- 🏠 การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช้การฝากเงิน
- 🏠 ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวมมิได้เป็นสิ่งยืนยันถึง

ผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต : ได้รับการรับรอง CAC

จัดอันดับกองทุน Morningstar ★★★★★

ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือ

บริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่อง

ได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



**การซื้อขายหน่วยลงทุน**

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 คือ 2 วันทำการ  
หลังจากวันทำการขายคืน

หมายเหตุ :1. ลงทุนจะได้รับผลตอบแทนอย่างสม่ำเสมอจากการที่กองทุนจะดำเนินการ  
รับซื้อคืนหน่วยลงทุนโดยอัตโนมัติ ในอัตราไม่ต่ำกว่าร้อยละ 90 ของส่วนเกินมูลค่าเงินลงทุน (Capital Gain) ในวันที่  
31 มกราคม วันที่ 31 พฤษภาคม และวันที่ 30 กันยายน ของทุกปี

หรือวันทำการก่อนหน้าในกรณีในวันดังกล่าวตรงกับวันหยุด

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)

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

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 :

- ค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายดังกล่าวข้างต้นเป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่มหรือภาษีอื่นใดในตนเองเรียบร้อยแล้ว
- ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บอาจเปลี่ยนแปลงตามความเหมาะสม โดยเก็บในอัตราไม่เกินจากที่ระบุไว้ในโครงการ
- กรณีกองทุน ONE-FAR (กองทุนต้นทาง) ลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมซึ่งอยู่ภายใต้การบริหารของบริษัทจัดการเดียวกัน (กองทุนปลายทาง) บริษัทจัดการจะไม่คิดค่าธรรมเนียมการจัดการ และ/หรือ ค่าธรรมเนียมการขายของกองทุนรวมต้นทางซ้ำซ้อนกับกองทุนรวมปลายทาง

| สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน |       |
|--------------------------------|-------|
| ประเภททรัพย์สิน                | %NAV  |
| ตราสารหนี้ภาคเอกชน             | 73.58 |
| ตราสารหนี้ภาครัฐ               | 25.51 |
| เงินฝาก และอื่นๆ               | 0.91  |

| ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก  |       |
|--|-------|
| ทรัพย์สิน  | %NAV  |
| พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 47/91/65   | 13.98 |
| หุ้นกู้ของบริษัท บัตรกรุงไทย จำกัด (มหาชน) ครั้งที่ 1/2564 ครบกำหนดไถ่ถอนปี พ.ศ. 2567              | 8.58  |
| หุ้นกู้ของบริษัท เจ เอ็ม ที เน็ทเวอร์ค เซอร์วิส เซ็ส จำกัด (มหาชน) ครั้งที่ 1/2563 ครบกำหนดปี 2566 | 7.03  |
| หุ้นกู้ของบริษัท สุภาลัย จำกัด (มหาชน) ครั้งที่ 2/2565 ชุดที่ 1 ครบกำหนดไถ่ถอนปี พ.ศ. 2566         | 4.18  |
| หุ้นกู้ของบริษัท สุภาลัย จำกัด (มหาชน) ครั้งที่ 4/2565 ครบกำหนดไถ่ถอนปี พ.ศ.2566                   | 3.52  |

**ข้อมูลเชิงสถิติ**

Maximum Drawdown : -0.48%  
Recovering Period : N/A ปี 5 เดือน  
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน : 1.58 เท่า  
อายุเฉลี่ยของตราสารหนี้ : N/A ปี 5 เดือน  
Yield to Maturity : 1.66% ต่อปี

**การจัดสรรการลงทุนในต่างประเทศ**

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

**ผู้ออกตราสาร 5 อันดับแรก**

| อุตสาหกรรม                                 | %NAV  |
|--|-------|
| BANK OF THAILAND                           | 22.72 |
| KRUNGTHAI CARD PUBLIC COMPANY LIMITED      | 8.58  |
| SUPALAI PUBLIC COMPANY LIMITED             | 7.69  |
| JMT NETWORK SERVICE PUBLIC COMPANY LIMITED | 7.03  |
| RATCHTHANI LEASING PUBLIC COMPANY LIMITED  | 6.99  |

**การจัดสรรการลงทุนตามอันดับความน่าเชื่อถือ (%NAV)**

|                  | ในประเทศ | national | international |
|------------------|----------|----------|---------------|
| GOV/AAA/AAA(tha) | 25.51    | 1.05     |               |
| AA/AA(tha)       | 16.2     | 0.99     |               |
| A/A(tha)         | 40.92    | 5.91     |               |
| BBB/BBB(tha)     | 9.49     |          |               |
| ต่ำกว่า BBB      |          |          |               |
| unrated          |          |          |               |

## คำอธิบาย

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

ต่อหน่วยที่จุดสูงสุดไปจนถึงจุดต่ำสุดในช่วงที่ NAV ต่อหน่วยปรับตัวลดลง ค่า Maximum Drawdown เป็นข้อมูลที่ช่วยให้ทราบถึงความเสี่ยงที่อาจจะขาดทุนจากการลงทุนในกองทุนรวม

**Recovering Period** ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาตั้งแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินต้นเริ่มต้นใช้เวลานานเท่าใด

**FX Hedging** เปรอ์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

**อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน** ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตกองทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลาหนึ่ง

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 อาคารสยามพิวรรธน์ทาวเวอร์ ชั้น 9, 24 ถนนพระราม 1 แขวงปทุมวัน เขตปทุมวัน

กรุงเทพมหานคร 10330

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

www.one-asset.com/