

ห้ามขายผู้ลงทุนรายย่อย
กองทุนรวมที่มีความเสี่ยงสูงหรือซับซ้อน
หนังสือชี้ชวนส่วนสรุปข้อมูลสำคัญ

ONE-COMPLEX1Y3M

ข้อมูล ณ วันที่ 30 ธันวาคม 2564



กองทุนเปิด วรรณ คอมเพล็กซ์ รีเทิร์น 1Y3M ห้ามขายผู้ลงทุนรายย่อย
ONE COMPLEX RETURN 1Y3M FUND NOT FOR RETAIL INVESTORS
(ONE-COMPLEX1Y3M)

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน วรรณ จำกัด
การเข้าร่วมการต่อต้านทุจริต : ได้รับการรับรอง CAC

กองทุนรวมผสม
กองทุนรวมที่ลงทุนแบบมีความเสี่ยงทั้งในและต่างประเทศ

ผู้ลงทุนไม่สามารถขายคืนหน่วยลงทุนนี้ในช่วงเวลา 1 ปี 3 เดือนได้ และกองทุนนี้ลงทุนกระจุกตัวในผู้ออกและหมวดอุตสาหกรรมธุรกิจการเงินและหมวดอสังหาริมทรัพย์และก่อสร้าง ดังนั้น หากมีปัจจัยลบที่ส่งผลกระทบต่อการลงทุนดังกล่าว ผู้ลงทุนอาจสูญเสียเงินลงทุนจำนวนมาก



คุณกำลังจะลงทุนอะไร?



กองทุนรวมนี้เหมาะกับใคร?



คุณต้องระวังอะไรเป็นพิเศษ?



สัดส่วนของประเภททรัพย์สินที่ลงทุน



ค่าธรรมเนียม



ผลการดำเนินงาน



ข้อมูลอื่นๆ

การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช้การฝากเงิน



โทร. 0-2659-8888 กด 1 ฝ่ายลูกค้าสัมพันธ์และสนับสนุนธุรกิจ • www.one-asset.com

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน วรรณ จำกัด 989 ถนนสุขุมวิท แขวงคลองเตย เขตคลองเตย กรุงเทพมหานคร 10330



คุณกำลังจะลงทุนอะไร?

■ นโยบายการลงทุน

(1) กองทุนมีนโยบายลงทุนในตราสารหนี้ และ/หรือ เงินฝากทั้งในประเทศ และ/หรือ ต่างประเทศ เช่น ตัวแลกเงินธนาคารพาณิชย์ เงินฝากในธนาคารพาณิชย์ และตราสารหนี้ที่ออกโดยบริษัทเอกชนทั่วไป โดยกองทุนจะลงทุนในตราสารหนี้ที่มีอันดับความน่าเชื่อถืออยู่ในอันดับที่สามารถลงทุนได้ (Investment Grade) รวมกันทั้งสิ้นประมาณร้อยละ 99.00 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน โดยมีเป้าหมายเพื่อให้เงินลงทุนในส่วนนี้หลังหักค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนแล้ว เติบโตเป็นร้อยละ 100.50 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน

(2) กองทุนจะแบ่งเงินลงทุนส่วนที่เหลือประมาณร้อยละ 1.00 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน เพื่อลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) เช่น สัญญาคอลลอร์แนท (Call Warrant) หรือสัญญาคอลลอปชั่น (Call Option) ที่ออก รับรอง รับอวัล หรือค้ำประกันโดยธนาคารพาณิชย์ไทย หรือสถาบันการเงินไทย ที่สัญญาจะมีการจ่ายผลตอบแทนอ้างอิงกับระดับของดัชนีอ้างอิง (Index level) คือ ดัชนี SET50 Index ตามเงื่อนไขการจ่ายผลตอบแทน เพื่อเปิดโอกาสให้กับกองทุนสามารถแสวงหาผลตอบแทนอ้างอิงกับดัชนี SET50 Index

กองทุนอาจลงทุนในตราสารที่มีสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแฝง (Structured Note) รวมทั้งกองทุนอาจลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเพื่อการเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน (Efficient Portfolio Management) และสำหรับการลงทุนในตราสารหนี้ และ/หรือ เงินฝากต่างประเทศ กองทุนจะป้องกันความเสี่ยงด้านอัตราแลกเปลี่ยน (Hedging) ทั้งจำนวน ทั้งนี้ หากมีการเปลี่ยนแปลงกลยุทธ์เกี่ยวกับการทำสัญญาซื้อขายล่วงหน้าดังกล่าว กองทุนอาจจะเข้าลงทุนในตราสารที่มีอายุยาวกว่าอายุโครงการ อย่างไรก็ตาม กองทุนจะเข้าทำสัญญาขายตราสารดังกล่าวล่วงหน้าเพื่อให้อายุของสัญญาสอดคล้องกับอายุโครงการ

กองทุนอาจเข้าทำธุรกรรมการซื้อโดยมีสัญญาขายคืน (reverse repo) หรือ ธุรกรรมประเภทการให้ยืมหลักทรัพย์ (securities lending) โดยเป็นไปตามหลักเกณฑ์ที่คณะกรรมการ ก.ล.ด. หรือสำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ด. ประกาศกำหนด

อนึ่ง กองทุนจะไม่ลงทุนในตราสารทุนของบริษัทที่ไม่ได้จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ฯ (Unlisted Securities) รวมถึงตราสารหนี้ที่มีอันดับความน่าเชื่อถือต่ำกว่าอันดับที่สามารถลงทุนได้ (non-investment grade) หรือที่ไม่มีการจัดอันดับความน่าเชื่อถือ (unrated) เว้นแต่ในกรณีที่ตราสารนั้นได้จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ (Listed Securities) หรือได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถืออยู่ในอันดับที่สามารถลงทุนได้ (Investment grade) แล้วแต่กรณี ในขณะที่กองทุนลงทุนเท่านั้น

■ กลยุทธ์ในการบริหารจัดการลงทุน

กองทุนจะลงทุนครั้งเดียว โดยจะถือทรัพย์สินที่ลงทุนไว้จนครบกำหนดอายุโครงการ (buy-and-hold)



กองทุนรวมนี้เหมาะกับใคร?

- ผู้ลงทุนที่มีใช้รายย่อยและผู้มีเงินลงทุนสูง
- ผู้ลงทุนที่คาดหวังผลตอบแทนที่สูงกว่าเงินฝาก และยอมรับผลตอบแทนที่อาจต่ำกว่าหุ้นได้
- ผู้ลงทุนที่ยอมรับและเข้าใจว่าอาจขาดทุนและสูญเสียเงินต้น หากผู้ออกตราสารหรือเงินฝากที่กองทุนนำไปลงทุนไม่สามารถชำระเงินต้นและดอกเบี้ยคืนได้
- ผู้ลงทุนที่สามารถลงทุนได้ตลอดอายุกองทุน ระยะเวลาประมาณ 1 ปี 3 เดือน โดยคาดหวังผลตอบแทนที่ดีกว่าการลงทุนในตราสารหนี้ทั่วไป
- ผู้ลงทุนที่ต้องการรับผลตอบแทนเพิ่มเติมจากการปรับขึ้นของราคาสินทรัพย์อ้างอิง

■ กองทุนรวมนี้ไม่เหมาะกับใคร

- ผู้ลงทุนที่เน้นการได้รับผลตอบแทนในจำนวนเงินที่แน่นอน หรือรักษาเงินต้นให้อยู่ครบ
- ผู้ลงทุนที่ต้องการไถ่ถอนหน่วยลงทุนเพื่อรับเงินในช่วงเวลาประมาณ 1 ปี 3 เดือน

■ ทำอย่างไรหากยังไม่เข้าใจนโยบายและความเสี่ยงของกองทุนนี้

- อ่านหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม หรือสอบถามผู้สนับสนุนการขายและบริษัทจัดการ
- อย่าลงทุนหากไม่เข้าใจลักษณะและความเสี่ยงของกองทุนรวมนี้ดีพอ



คุณต้องระวังอะไรเป็นพิเศษ?

■ คำเตือนที่สำคัญ

- กองทุนนี้เป็นผลิตภัณฑ์ในตลาดทุนที่มีความเสี่ยงสูงหรือมีความซับซ้อน ซึ่งมีความแตกต่างจากการลงทุนในกองทุนรวมทั่วไป ผู้ลงทุนควรสอบถามรายละเอียดเพิ่มเติมจากผู้ขาย หรือศึกษารายละเอียดจากเอกสารประกอบเสนอขายกองทุน
- กองทุนมีการลงทุนในสัญญาคอลลอร์แบนด์ (Call Warrant) หรือสัญญาคอลลอปชั่น (Call Option) ที่มีการจ่ายผลตอบแทนอ้างอิงกับดัชนี SET50 และเงื่อนไขที่กำหนด ส่งผลให้อัตราผลตอบแทนของกองทุนอาจไม่เท่ากับอัตราเปลี่ยนแปลงของดัชนี SET50 ผู้ลงทุนควรศึกษาข้อมูลของดัชนี SET50 และเงื่อนไขการจ่ายผลตอบแทนก่อนตัดสินใจลงทุน
- กองทุนอาจลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเพื่อเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารงาน (Efficient Portfolio Management) และ/หรือ ตราสารที่มีลักษณะของสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแฝง (Structured Note) ส่งผลให้กองทุนมีความเสี่ยงมากกว่ากองทุนรวมทั่วไป และมีความเสี่ยงมากกว่ากองทุนรวมที่ลงทุนในหลักทรัพย์อ้างอิงโดยตรง เนื่องจากใช้เงินลงทุนในจำนวนที่น้อยกว่าจึงมีกำไร/ขาดทุนสูงกว่าการลงทุนในหลักทรัพย์อ้างอิงโดยตรง
- เนื่องจากกองทุนมีนโยบายนำเงินไปลงทุนในต่างประเทศบางส่วน จึงทำให้กองทุนอาจมีความเสี่ยงในเรื่องของเสถียรภาพ จากการเปลี่ยนแปลงทางเศรษฐกิจ การเมือง การเงิน ตลอดจนภาวะตลาดเงิน ตลาดทุนของประเทศต่าง ๆ ที่กองทุนลงทุน ผู้ลงทุนควรศึกษาปัจจัยต่าง ๆ ที่อาจมีผลกระทบอย่างรอบคอบก่อนตัดสินใจลงทุน
- ผลตอบแทนของกองทุนขึ้นอยู่กับระดับของดัชนี SET50 Index (ดัชนีอ้างอิง) ดังนั้น ผู้ลงทุนควรศึกษาข้อมูลของกองทุนก่อนตัดสินใจลงทุน
- อัตราส่วนร่วม (Participation Rate) ของดัชนีอ้างอิงอาจมีการเปลี่ยนแปลงได้ หากสภาวะตลาดมีการเปลี่ยนแปลงหรือเป็นไปตามดุลยพินิจของผู้จัดการกองทุน แต่อย่างไรก็ตาม อัตราส่วนร่วมจะไม่ต่ำกว่าอัตราส่วนร่วมที่กำหนดไว้ในโครงการ โดยบริษัทจัดการจะแจ้งให้ผู้ถือหน่วยลงทุนทราบภายใน 15 วันทำการนับแต่วันจดทะเบียนทรัพย์สินเป็นกองทุนรวม
- กองทุนอาจไม่ได้รับเงินต้นและผลตอบแทนตามที่คาดหมายไว้ หากผู้ออกตราสารหรือธนาคารที่กองทุนลงทุนไม่สามารถชำระเงินต้นและดอกเบี้ยคืนได้
- กองทุนนี้เป็นกองทุนที่มีความเสี่ยงสูงหรือซับซ้อน ผู้ลงทุนควรจัดสรรเงินลงทุนในสินทรัพย์อื่นเพื่อเป็นการกระจายความเสี่ยงให้เหมาะสมกับระดับความเสี่ยงที่ผู้ลงทุนยอมรับได้
- กองทุนรวมอาจมีการลงทุนเฉพาะเจาะจงในหมวดอุตสาหกรรมธุรกิจการเงิน และหมวดอสังหาริมทรัพย์และก่อสร้าง จึงอาจมีความเสี่ยงและความผันผวนของราคาสูงกว่ากองทุนรวมทั่วไปที่มีการกระจายการลงทุนในหลายอุตสาหกรรม

แผนภาพแสดงตำแหน่งความเสี่ยงของกองทุนรวม



ปัจจัยความเสี่ยงที่สำคัญ

ความเสี่ยงจากการผิดนัดชำระหนี้ของผู้ออกตราสาร

credit rating ตาม national credit rating	GOV/AAA	AA, A	BBB	ต่ำกว่า BBB	unrated
	ต่ำ				สูง
หมายเหตุ : แรเงาการันตีที่กองทุนลงทุนในตราสารหรือเงินฝากที่มีอันดับความน่าเชื่อถือ (Credit Rating) นั้นเกินกว่าร้อยละ 20 ของ NAV					

ความเสี่ยงจากความผันผวนของมูลค่าหน่วยลงทุน

ความผันผวนของ ผลการดำเนินงาน (SD)	< 5%	5 - 10%	10 - 15 %	15 - 25 %	> 25%
	ต่ำ				สูง

ความเสี่ยงจากการกระจุกตัวในผู้ออกตราสารรวม

High Issuer concentration Risk	<10%	10% - 20%	20% - 50%	50% - 80%	> 80%
	ต่ำ				สูง

ความเสี่ยงจากการลงทุนกระจุกตัวในหมวดอุตสาหกรรมใดอุตสาหกรรมหนึ่ง

High Sector concentration Risk	<20%	20% - 50%	50% - 80%	> 80%	
	ต่ำ				สูง
หมายเหตุ: กองทุนรวมมีการลงทุนกระจุกตัวในหมวดอุตสาหกรรมธุรกิจการเงินและหมวดอสังหาริมทรัพย์และก่อสร้าง					

ความเสี่ยงจากการลงทุนกระจุกตัวในประเทศใดประเทศหนึ่ง

High Country Concentration Risk	<20% 20% - 50% 50% - 80% > 80%
	ต่ำ สูง

ความเสี่ยงจากการเปลี่ยนแปลงของอัตราแลกเปลี่ยน

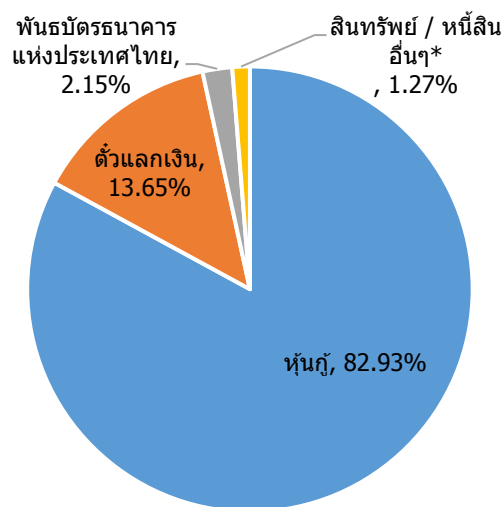
การป้องกันความเสี่ยง FX*	ทั้งหมด/เกือบทั้งหมด	บางส่วน	ดูยพินิจ	ไม่ป้องกัน
	ต่ำ			สูง

หมายเหตุ: กองทุนป้องกันความเสี่ยง FX ทั้งหมด สำหรับการลงทุนในตราสารหนี้ และ/หรือเงินฝากต่างประเทศ และในส่วนของ สัญญาคอลลอร์แนร์ (Call Warrant) หรือสัญญาคอลลอปชั่น (Call Option) จะลงทุนในรูปสกุลเงินบาท

คุณสามารถดูข้อมูลที่เป็นปัจจุบันได้ที่ www.one-asset.com



สัดส่วนของประเภททรัพย์สินที่ลงทุน



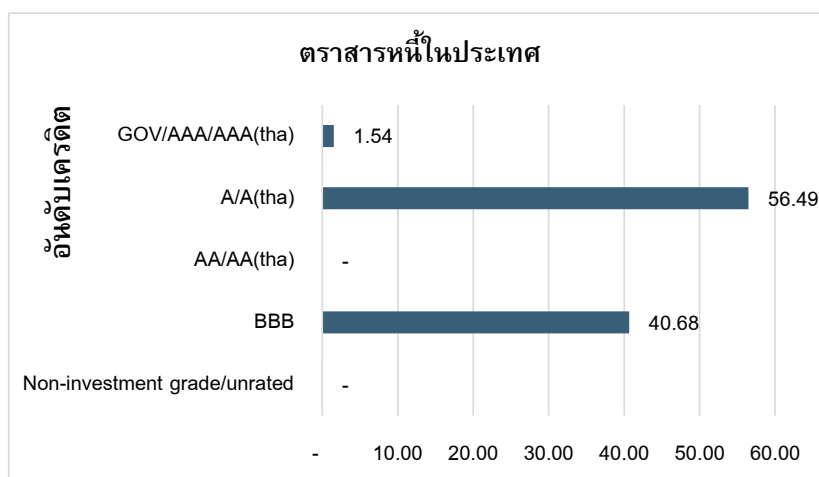
% ของ NAV

■ ชื่อทรัพย์สินที่ลงทุนสูงสุด 5 อันดับแรก

	หลักทรัพย์	Rating	%
1	หุ้นกู้ โดยบริษัท ซีพี ออลล์ จำกัด (มหาชน) (CPALL226A)	A-(tha)	18.77%
2	หุ้นกู้ โดยบริษัท ดับบลิวเอชเอ คอร์ปอเรชั่น จำกัด (มหาชน) (WHA226B)	A-	18.72%
3	หุ้นกู้ โดยบริษัท ข.การช่าง จำกัด (มหาชน) (CK226A)	A-	18.28%
4	หุ้นกู้ โดยบริษัท แอสสิริ จำกัด (มหาชน) (SIRI225A)	BBB+	15.52%
5	ตั๋วแลกเงิน โดยบริษัท เจ มาร์ท จำกัด (มหาชน) (JMART226A)	BBB	13.65%

หมายเหตุ : เป็นข้อมูล ณ วันที่ 30 ธันวาคม 2564

■ นำหนักการลงทุนตามอันดับความน่าเชื่อถือ



หมายเหตุ : เป็นข้อมูล ณ วันที่ 30 ธันวาคม 2564

ทั้งนี้ คุณสามารถดูข้อมูลที่เป็นปัจจุบันได้ที่ website www.one-asset.com



ค่าธรรมเนียม

* ค่าธรรมเนียมมีผลกระทบต่อผลตอบแทนที่คุณจะได้รับ ดังนั้น คุณควรพิจารณาการเรียกเก็บค่าธรรมเนียมดังกล่าวก่อนการลงทุน *

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)



หมายเหตุ :

1. ค่าธรรมเนียมการจัดการจะสามารถระบุได้เมื่อมีการลงทุนจริง เนื่องจาก บลจ. จะคำนวณค่าธรรมเนียมการจัดการจากอัตราผลตอบแทนของตราสาร ณ วันที่กองทุนเข้าลงทุน
2. ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว
3. ค่าใช้จ่ายที่กองทุนเรียกเก็บอาจเปลี่ยนแปลงตามความเหมาะสม โดยเก็บในอัตราไม่เกินจากที่ระบุไว้ในหนังสือชี้ชวนเสนอขายหน่วยลงทุน

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)

รายการ	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
ค่าธรรมเนียมการขาย	2.14	1.00
ค่าธรรมเนียมการรับซื้อคืน	2.14	ยกเว้นการเรียกเก็บ
ค่าธรรมเนียมการสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า	2.14	1.00
ค่าธรรมเนียมการสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก	2.14	ยกเว้นการเรียกเก็บ
ค่าธรรมเนียมการโอนหน่วย	ตามที่นายทะเบียนเรียกเก็บ	ตามที่นายทะเบียนเรียกเก็บ
ค่าธรรมเนียมการออกเอกสารแสดงสิทธิในหน่วยลงทุน	ตามที่จ่ายจริง	ตามที่จ่ายจริง
ค่าใช้จ่ายอื่นๆ	ตามที่จ่ายจริง	ตามที่จ่ายจริง

หมายเหตุ :

1. ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว
2. ค่าใช้จ่ายที่กองทุนเรียกเก็บอาจเปลี่ยนแปลงตามความเหมาะสม โดยเก็บในอัตราไม่เกินจากที่ระบุไว้ในหนังสือชี้ชวนเสนอขายหน่วยลงทุน
3. ค่าธรรมเนียมการขายหน่วยลงทุน ค่าธรรมเนียมการรับซื้อคืนหน่วยลงทุน และค่าธรรมเนียมการสับเปลี่ยนหน่วยลงทุน บริษัทจัดการอาจเก็บจากผู้ถือหน่วยลงทุนแต่ละกลุ่ม และ/หรือแต่ละรายในอัตราที่ไม่เท่ากัน ผู้ถือหน่วยลงทุนสามารถต่อรองอัตรา

ค่าธรรมเนียมดังกล่าวได้ บริษัทจัดการจะแจ้งให้ทราบรายละเอียดต่อไป โดยติดประกาศไว้ที่สำนักงานของบริษัทจัดการและ
ผู้สนับสนุนการขายหรือรับซื้อคืนหน่วยลงทุน และ/หรือผ่านเว็บไซต์ของบริษัทจัดการ



ผลการดำเนินงานในอดีต

* ผลการดำเนินงานในอดีต มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต *

- ดัชนีชี้วัด คือ ไม่มี เนื่องจากกองทุนไม่สามารถวัดผลการดำเนินงานได้เพราะอัตราผลตอบแทนของกองทุนขึ้นอยู่กับเงื่อนไขการจ่ายผลตอบแทนของสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ซึ่งมีลักษณะเฉพาะเจาะจงที่สร้างขึ้นสำหรับกองทุนนี้โดยเฉพาะ
- กองทุนนี้เคยมีผลขาดทุนสูงสุดในช่วงเวลา 5 ปี คือ -0.04%
- ความผันผวนของผลการดำเนินงาน (Standard Deviation) คือ 0.35% ต่อปี
- ความผันผวนของส่วนต่างของผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัด (Tracking Error: TE) คือ 0.35% ต่อปี
- ประเภทกองทุนรวมเพื่อใช้เปรียบเทียบผลการดำเนินงาน ณ จุดขาย คือ miscellaneous

คุณสามารถดูข้อมูลที่เป็นปัจจุบันได้ที่ www.one-asset.com



ข้อมูลอื่น ๆ

นโยบายการจ่ายเงินปันผล	ไม่จ่าย
ผู้ดูแลผลประโยชน์	ธนาคารกสิกรไทย จำกัด (มหาชน)
วันที่จดทะเบียน	
อายุโครงการ	ประมาณ 1 ปี 3 เดือน โดยไม่ต่ำกว่า 1 ปี 2 เดือน และไม่เกิน 1 ปี 4 เดือน นับจากวันจดทะเบียนกองทรัสต์สินเป็นกองทุนรวม
ซื้อและขายคืนหน่วยลงทุน	<u>วันทำการซื้อ (IPO)</u> : 5-11 มีนาคม 2564 <u>วันทำการซื้อ</u> : บริษัทจัดการไม่เปิดเสนอขายภายหลังการเสนอขายหน่วยลงทุนครั้งแรก <u>วันทำการขายคืน</u> : บริษัทจัดการจะไม่เปิดรับซื้อคืนหน่วยลงทุนปกติภายหลังปิดการเสนอขายครั้งแรก โดยจะรับซื้อคืนหน่วยลงทุนอัตโนมัติเมื่อครบกำหนดอายุโครงการ บริษัทจัดการจะประกาศแจ้งวันรับซื้อคืนหน่วยลงทุนอัตโนมัติและวันครบอายุโครงการ โดยจะปิดประกาศ ณ สำนักงานของบริษัทจัดการ สถานที่ติดต่อของผู้นับสนุนการขายหรือรับซื้อคืน และประกาศผ่านทางเว็บไซต์ของบริษัทจัดการภายใน 30 วันทำการนับจากวันที่จดทะเบียนกองทรัสต์สินเป็นกองทุนรวม มูลค่าขั้นต่ำของการซื้อครั้งแรก : 500,000.00 บาท ทั้งนี้ มูลค่าขั้นต่ำของการสั่งซื้อครั้งแรก ยังไม่รวมค่าธรรมเนียมการขายหน่วยลงทุน (ถ้ามี) มูลค่าขั้นต่ำของการซื้อครั้งถัดไป : - มูลค่าขั้นต่ำของการขายคืน : ไม่กำหนด ยอดคงเหลือขั้นต่ำ : ไม่กำหนด ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน : ภายใน 5 วันทำการนับแต่วันรับซื้อคืนหน่วยลงทุนโดยอัตโนมัติ บริษัทจัดการจะชำระค่าขายคืนดังกล่าว ตามวิธีที่ผู้ถือหน่วยลงทุนระบุไว้ในแบบคำขอเปิดบัญชีกองทุนเปิด คุณสามารถตรวจสอบมูลค่าทรัพย์สินได้ที่ www.one-asset.com
รายชื่อผู้จัดการกองทุน	- นายสุทธิโรจน์ สิกธิวัฒนานนท์ วันที่จดทะเบียนกองทุน - นายสิทธิ จ่างตระกูล วันที่จดทะเบียนกองทุน - นายธัชธรรม วิจารณ์ วันที่จดทะเบียนกองทุน

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุนของกองทุนรวม (PTR)	0.01 *กรณีกองทุนรวมที่จดทะเบียนจัดตั้งไม่ถึง 1 ปี จะแสดงค่าที่เกิดขึ้นจริงในช่วงเวลาตั้งแต่วันที่จดทะเบียนถึงวันที่รายงาน
ผู้สนับสนุนการขายหรือรับซื้อคืน	บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน วรธน จำกัด หรือผู้สนับสนุนการขายหรือรับซื้อคืนหน่วยลงทุนที่ได้รับแต่งตั้งจากบริษัทจัดการ ทั้งนี้ ผู้ลงทุนสามารถตรวจสอบรายชื่อผู้สนับสนุนการขายหรือรับซื้อคืนที่ให้บริการเพิ่มเติมได้ที่ www.one-asset.com
ติดต่อสอบถามรับหนังสือชี้ชวน ร้องเรียน	บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน วรธน จำกัด 989 อาคารสยามพิวรรธน์ทาวเวอร์ ชั้น 9, 24 ถนนพระราม 1 แขวง/เขตปทุมวัน กรุงเทพมหานคร 10330 โทรศัพท์ 0-2659-8888 โทรสาร 0-2659-8860-1
ธุรกรรมที่อาจก่อให้เกิดความขัดแย้งทางผลประโยชน์	คุณสามารถตรวจสอบธุรกรรมที่อาจก่อให้เกิดความขัดแย้งทางผลประโยชน์ได้ที่ www.one-asset.com

- การลงทุนในหน่วยลงทุนไม่ใช้การฝากเงิน รวมทั้งไม่ได้อยู่ภายใต้ความคุ้มครองของสถาบันคุ้มครองเงินฝาก จึงมีความเสี่ยงจากการลงทุนซึ่งผู้ลงทุนอาจไม่ได้รับเงินลงทุนคืนเต็มจำนวน
- ได้รับอนุมัติจัดตั้ง และอยู่ภายใต้การกำกับดูแลของสำนักงาน ก.ล.ต.
- การพิจารณาร่างหนังสือชี้ชวนในการเสนอขายหน่วยลงทุนของกองทุนรวมนี้มีได้เป็นการแสดงว่าสำนักงาน ก.ล.ต. ได้รับรองถึงความถูกต้องของข้อมูลในหนังสือชี้ชวนของกองทุนรวม หรือ ได้ประกันราคาหรือผลตอบแทนของหน่วยลงทุนที่เสนอนั้น ทั้งนี้ บริษัทจัดการกองทุนรวม ได้สอบถามข้อมูลในหนังสือชี้ชวนส่วนสรุปข้อมูลสำคัญ ณ วันที่ 30 ธันวาคม 2564 แล้วด้วยความระมัดระวังในฐานะผู้รับผิดชอบในการดำเนินการของกองทุนรวมและขอรับรองว่าข้อมูลดังกล่าวถูกต้อง ไม่เป็นเท็จ และไม่ทำให้ผู้อื่นสำคัญผิด

ข้อมูลอื่นๆ

สรุปรายละเอียดการลงทุนของกองทุน

ส่วนที่ 1 เงินต้นและผลตอบแทน : กองทุนลงทุนในตราสารหนี้ และ/หรือ เงินฝากทั้งในประเทศและ/หรือ ต่างประเทศ เช่น ตั๋วแลกเงินธนาคารพาณิชย์ เงินฝากในธนาคารพาณิชย์ และตราสารหนี้ที่ออกโดยบริษัทเอกชน ทั่วไป โดยกองทุนจะลงทุนในตราสารหนี้ที่มีอันดับความน่าเชื่อถืออยู่ในอันดับที่สามารถลงทุนได้ (Investment Grade) รวมกันทั้งสิ้นประมาณร้อยละ 99.00 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน โดยมีเป้าหมายเพื่อให้เงินลงทุน หลังหักค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนแล้วเติบโตเป็นร้อยละ 100.50 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน

กองทุนอาจลงทุนในตราสารที่มีสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแฝง (Structured Note) รวมทั้งกองทุนอาจลงทุนใน สัญญาซื้อขายล่วงหน้าเพื่อการเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน (Efficient Portfolio Management) และสำหรับการลงทุนในตราสารหนี้และ/หรือเงินฝากต่างประเทศ กองทุนจะป้องกันความเสี่ยงด้านอัตราแลกเปลี่ยน (Hedging) ทั้งจำนวน ทั้งนี้ หากมีการเปลี่ยนแปลงกลยุทธ์เกี่ยวกับการทำสัญญาซื้อขายล่วงหน้าดังกล่าว กองทุน อาจจะเข้าลงทุนในตราสารที่มีอายุยาวกว่าอายุโครงการ อย่างไรก็ตาม กองทุนจะเข้าทำสัญญาขายตราสารดังกล่าว ล่วงหน้าเพื่อให้อายุของสัญญาสอดคล้องกับอายุโครงการ เป็นต้น

ส่วนที่ 2 ผลตอบแทนส่วนเพิ่ม : กองทุนจะแบ่งเงินลงทุนประมาณร้อยละ 1.00 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของ กองทุน เพื่อลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) ได้แก่ สัญญาคอลลอว์เรนต์ (Call Warrant) หรือ สัญญาคอลลอปชั่น (Call Option) ที่สัญญาจะมีการจ่ายผลตอบแทนอ้างอิงระดับของดัชนีอ้างอิง (Index Level) คือ ระดับดัชนี SET50 Index ที่ออก รับรอง รับอาวัล หรือค้ำประกัน โดยธนาคารพาณิชย์ไทย หรือสถาบัน การเงินไทย

ลักษณะที่สำคัญของสัญญาคอลลอร์แนร์ (Call Warrant) หรือสัญญาคอลลอปชั่น (Call Option) ที่อ้างอิงกับผลตอบแทนของ SET50 Index

ลักษณะผลตอบแทนของตราสาร	• สัญญาคอลลอร์แนร์ (Call Warrant) หรือสัญญาคอลลอปชั่น (Call Option) จะอ้างอิงกับระดับดัชนี SET50 Index โดยจะพิจารณาระดับดัชนี ภายในระยะเวลาประมาณ 30 วัน ก่อนวันสิ้นสุดโครงการ • สัญญาคอลลอร์แนร์ (Call Warrant) หรือสัญญาคอลลอปชั่น (Call Option) จะอ้างอิงกับระดับดัชนี SET50 Index โดยระดับดัชนี SET50 Index ที่คาดว่าจะเกิดขึ้นนั้นจะมี 2 กรณีคือ 1) เกิด Knock-out กรณีที่ระดับดัชนี SET50 Index เพิ่มขึ้นสูงกว่า 10% ณ วันใดวันหนึ่งเมื่อเทียบกับวันเริ่มต้นสัญญา โดยผู้ลงทุนจะได้รับผลตอบแทน 0.60% (Rebate rate) ของเงินลงทุนในกองทุน ณ วันสิ้นสุดสัญญา 2) ไม่เกิด Knock-out กรณีที่ระดับดัชนี SET50 Index เพิ่มขึ้นไม่เกิน 10% หรือลดลงน้อยกว่าหรือเท่ากับระดับดัชนี SET50 Index ณ วันเริ่มต้นสัญญาตลอดจนครบอายุสัญญา โดยจะพิจารณาผลตอบแทน ภายในระยะเวลาประมาณ 30 วัน ก่อนวันสิ้นสุดโครงการ • ผลขาดทุนสูงสุดจากการลงทุนในสัญญาคอลลอร์แนร์ (Call Warrant) หรือสัญญาคอลลอปชั่น (Call Option) คือค่าใช้สทธิ (premium) ของสัญญา
สกุลเงิน	บาท (THB)
อายุตราสาร	ประมาณ 1 ปี 3 เดือน แต่ไม่น้อยกว่า 1 ปี 2 เดือน และไม่เกิน 1 ปี 4 เดือน โดยนับจากวันจดทะเบียนของทรัพย์สินเป็นกองทุนรวม
การจ่ายผลตอบแทน (Payoff at expiry)	1. ณ วันพิจารณาสินทรัพย์อ้างอิง (ภายในระยะเวลาประมาณ 30 วัน ก่อนวันสิ้นสุดโครงการ) หากระดับดัชนี SET50 Index ปรับตัวลดลงน้อยกว่าหรือเท่ากับระดับดัชนี SET50 Index ณ วันเริ่มต้นสัญญา โดยไม่เข้าเงื่อนไขตามกรณีที่ 3. จะไม่ได้รับผลตอบแทนจากการลงทุนในสัญญาคอลลอร์แนร์ (Call Warrant) หรือสัญญาคอลลอปชั่น (Call Option) 2. ณ วันพิจารณาสินทรัพย์อ้างอิง (ภายในระยะเวลาประมาณ 30 วัน ก่อนวันสิ้นสุดโครงการ) หากดัชนี SET50 Index ปรับตัวเพิ่มขึ้นไม่เกิน 10% เมื่อเทียบกับระดับดัชนี SET50 Index ณ วันเริ่มต้นสัญญา โดยไม่เข้าเงื่อนไขตามกรณีที่ 3. จะได้รับผลตอบแทนจากการลงทุนในสัญญาคอลลอร์แนร์ (Call Warrant) หรือสัญญาคอลลอปชั่น (Call Option) ในอัตรา $60\% \times \text{ค่าการเปลี่ยนแปลงของระดับดัชนี} \times \text{เงินต้น}$ 3. พิจารณาผลตอบแทนตลอดอายุสัญญา แต่หากระดับดัชนี SET50 Index ณ วันใดวันหนึ่งตลอดอายุสัญญารวมถึงวันพิจารณาสินทรัพย์อ้างอิงมากกว่า 10% เมื่อเทียบกับวันเริ่มต้นสัญญา จะได้รับผลตอบแทนจากการลงทุนในสัญญาคอลลอร์แนร์ (Call Warrant) หรือสัญญาคอลลอปชั่น (Call Option) นี้ในอัตรา 0.60% (Rebate Rate) ของเงินลงทุน
เหตุการณ์ที่ส่งผลกระทบต่อ การลงทุน	กองทุนสงวนสิทธิที่จะนำเงินส่วนที่ลงทุนในสัญญาคอลลอร์แนร์ (Call Warrant) หรือสัญญาคอลลอปชั่น (Call Option) ไปลงทุนในทรัพย์สินอื่นที่ใกล้เคียงตามดุลยพินิจของผู้จัดการกองทุน จนครบอายุกองทุน โดย

	คำนึงถึงผลประโยชน์สูงสุดของผู้ถือหุ้นรายละคน ซึ่งผลตอบแทนอาจเปลี่ยนแปลงจากที่กำหนดไว้ในกรณีที่เหตุการณ์ใดเหตุการณ์หนึ่งต่อดัชนี SET50 Index (ดัชนีอ้างอิง) ต่อไปนี้ 1) มีการยกเลิกดัชนีอ้างอิง 2) ดัชนีอ้างอิงหยุดการคำนวณ อันเนื่องมาจากตลาดหลักทรัพย์ที่เกี่ยวข้องปิดทำการติดต่อกัน 3 วันทำการ หรือผู้ให้บริการดัชนีงดประกาศระดับของดัชนีติดต่อกัน 3 วันทำการ 3) มีการเปลี่ยนแปลงวิธีการคำนวณดัชนี 4) มีการเปลี่ยนแปลงผู้ให้บริการดัชนี 5) มีการเปลี่ยนแปลงกฎหมายหรือข้อบังคับที่ส่งผลกระทบต่อดัชนีอ้างอิง 6) ผู้ออกสัญญาคอลลอร์แนร์ (Call Warrant) หรือสัญญาคอลลอปชั่น (Call Option) ที่มีการจ่ายผลตอบแทนอ้างอิงกับระดับของดัชนีอ้างอิง มีต้นทุนในการป้องกันความเสี่ยงเพิ่มขึ้น เช่น จากการเพิ่มขึ้นของอัตราความเสี่ยงอากร ค่าใช้จ่าย และค่าธรรมเนียมต่าง ๆ 7) มีเหตุการณ์ใด ๆ ที่ทำให้ผู้ออกสัญญาวอร์แนร์ หรือสัญญาคอลลอปชั่น ที่มีการจ่ายผลตอบแทนอ้างอิงกับระดับของดัชนีอ้างอิงไม่สามารถป้องกันความเสี่ยงจากการเปลี่ยนแปลงของราคาดัชนีอ้างอิงได้ โดยผู้ออกสัญญาคอลลอร์แนร์ (Call Warrant) หรือสัญญาคอลลอปชั่น (Call Option) ได้ใช้ความพยายามอย่างถึงที่สุดในการแก้ไขปัญหาแล้ว แต่อย่างไรก็ตามผู้ออกสัญญาคอลลอร์แนร์ (Call Warrant) หรือสัญญาคอลลอปชั่น (Call Option) ยังคงได้รับผลกระทบดังต่อไปนี้ 1. ไม่สามารถหา สร้าง สร้างใหม่ ทดแทน ถือครอง ยกเลิก หรือขายธุรกรรม หรือสินทรัพย์เพื่อป้องกันความเสี่ยงด้านราคาตามเงื่อนไขและข้อผูกพันที่เกี่ยวข้องกับสัญญาวอร์แนร์นั้น หรือ 2. ไม่สามารถขายหรือไม่ได้รับชำระเงินคืนจากการขายธุรกรรมหรือสินทรัพย์ที่ลงทุน
Participation rate (PR)	60% ทั้งนี้ อัตราส่วนร่วม (Participation Rate) ของระดับดัชนีอ้างอิงอาจมีการเปลี่ยนแปลงได้ หากสถานะตลาดมีการเปลี่ยนแปลงหรือเป็นไปตามดุลยพินิจของผู้จัดการกองทุน แต่อย่างไรก็ตาม อัตราส่วนร่วมจะไม่ต่ำกว่าอัตราส่วนร่วมที่กำหนดไว้ในโครงการ
Rebate Rate	0.60%
Knock-out level	ระดับดัชนี SET50 Index เพิ่มขึ้นมากกว่า 10% ณ วันใดวันหนึ่งตลอดอายุสัญญาจนถึงวันพิจารณาสินทรัพย์อ้างอิง เมื่อเทียบกับวันเริ่มต้นสัญญา
ผู้ออก ผู้รับรอง ผู้รับอาวัล หรือผู้ค้ำประกัน ทรสาร	ธนาคารพาณิชย์ไทย หรือสถาบันการเงินไทย

หมายเหตุ บริษัทจัดการจะแจ้งประเภทของสัญญาซื้อขายล่วงหน้า, ผู้ออกสัญญาซื้อขายล่วงหน้า, รวมถึงสกุลเงินที่กองทุนจะลงทุนและได้รับผลตอบแทน ให้ผู้ลงทุนทราบในหนังสือชี้ชวนส่วนสรุปข้อมูลสำคัญก่อนการเสนอขายครั้งแรก

เงื่อนไขการจ่ายผลตอบแทน และการคำนวณผลตอบแทนของสัญญาคอลลอร์แรนท์ (Call Warrant) หรือสัญญาคอลลอปชั่น (Call Option)

เงื่อนไขการจ่ายผลตอบแทน

กรณี	การเกิด Knock out	เงื่อนไข	ผลตอบแทนที่ผู้ลงทุนจะได้รับจากสัญญาคอลลอร์แรนท์ (Call Warrant) หรือสัญญาคอลลอปชั่น (Call Option)
1	ไม่เกิด Knock out	ระดับดัชนี SET50 Index ณ วันพิจารณาสิทธิอ้างอิง $\leq$ ระดับดัชนี SET50 Index ณ วันเริ่มต้นสัญญา	ไม่ได้รับผลตอบแทนส่วนเพิ่ม
2	ไม่เกิด Knock out	ระดับดัชนี SET50 Index ณ วันพิจารณาสิทธิอ้างอิง เพิ่มขึ้น $\leq 10\%$ จากระดับดัชนี SET50 Index ณ วันเริ่มต้นสัญญา	ได้รับผลตอบแทนในอัตรา $60\% \times$ ค่าการเปลี่ยนแปลงของระดับดัชนี $\times$ เงินต้น
3	เกิด Knock-out	ระดับดัชนี SET50 Index ณ วันใดวันหนึ่งตลอดอายุสัญญารวมถึงวันพิจารณาสิทธิอ้างอิง $> 10\%$ ของระดับดัชนี SET50 Index ณ วันเริ่มต้นสัญญา	ได้รับ Rebate 0.60% ของเงินลงทุนในกองทุน ณ วันครบอายุโครงการ

การคำนวณผลตอบแทนของสัญญาคอลลอร์แรนท์ (Call Warrant) หรือสัญญาคอลลอปชั่น (Call Option)

การจ่ายเงินจากการลงทุน ณ วันครบอายุโครงการ

= เงินต้น + ผลตอบแทนจากการลงทุนในตราสารหนี้ และ/หรือเงินฝาก + ผลตอบแทนจากการลงทุนในสัญญาคอลลอร์แรนท์ (Call Warrant) หรือสัญญาคอลลอปชั่น (Call Option) *

โดยผลตอบแทนจากการลงทุนในสัญญาคอลลอร์แรนท์ (Call Warrant) หรือสัญญาคอลลอปชั่น (Call Option) แบ่งเป็น

1. กรณีที่ไม่เกิด Knock out (กรณีที่ 1 และ กรณีที่ 2) **

ผลตอบแทน = $[PR \times \text{Max}(0, \text{Return SET50 Index})]$

โดยที่ - Return SET50 Index = $(\text{Index Final Level} / \text{Index Initial Level}) - 100\%$

- PR = Participation Rate

- Index Final Level คือ ระดับดัชนีของ SET50 Index ณ วันพิจารณาสิทธิอ้างอิงของสัญญาคอลลอร์แรนท์ (Call Warrant) หรือสัญญาคอลลอปชั่น (Call Option)

- Index Initial Level คือ ระดับดัชนีของ SET50 Index ณ วันเข้าทำสัญญาคอลลอร์แรนท์ (Call Warrant) หรือสัญญาคอลลอปชั่น (Call Option)

2. กรณีเกิด Knock out (กรณีที่ 3)

ผลตอบแทน = เงินลงทุนในกองทุน $\times$ Rebate Rate

ทั้งนี้ ในกรณีที่เกิดเหตุการณ์ใด ๆ ซึ่งอาจมีผลกระทบต่อ การคำนวณผลตอบแทนจากการลงทุนในสัญญาคอลลอร์แรนท์ (Call Warrant) หรือสัญญาคอลลอปชั่น (Call Option) การคำนวณผลตอบแทนดังกล่าวจะเป็นไปตามข้อตกลงที่ระบุไว้ในสัญญาคอลลอร์แรนท์ (Call Warrant) หรือสัญญาคอลลอปชั่น (Call Option) ที่กองทุนลงทุน ซึ่งบริษัทจัดการจะแจ้งเงื่อนไขดังกล่าวให้แก่ผู้ถือหน่วยลงทุนทราบภายใน 15 วัน นับตั้งแต่วันที่เกิดเหตุการณ์นั้น ๆ ขึ้น

หมายเหตุ

- * ผลตอบแทนจากการลงทุนในสัญญาคอลลอร์แรนท์ (Call Warrant) หรือสัญญาคอลลอปชั่น (Call Option) มาจากการลงทุนในสัญญาคอลลอร์แรนท์ (Call Warrant) หรือสัญญาคอลลอปชั่น (Call Option) คิดเป็นมูลค่าประมาณร้อยละ 1.00 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน และจ่ายผลตอบแทนครั้งเดียวตอนสิ้นสุดอายุโครงการ โดยผลตอบแทนจากการลงทุนจะอ้างอิงกับอัตราผลตอบแทนของระดับดัชนี SET50 Index
- ** ถึงแม้จะเป็นกรณีที่ไม่มีเกิด Knock out เหมือนกัน แต่เนื่องจากกรณีที่ 1 นั้น ค่า Index Final Level ลดลงต่ำกว่า Index Initial Level ซึ่งเมื่อแทนค่าตามสูตรการคำนวณแล้วผู้ลงทุนจึงไม่ได้รับผลตอบแทนจากการลงทุนในสัญญาคอลลอร์แรนท์ (Call Warrant) หรือสัญญาคอลลอปชั่น (Call Option) ทั้งนี้ รายละเอียดปรากฏตามตัวอย่างแสดงการจ่ายคืนเงินจากการลงทุน ณ วันครบอายุโครงการ กรณีที่ 1 และกรณีที่ 2 ด้านล่างนี้

ตัวอย่างแสดงการจ่ายคืนเงินจากการลงทุน ณ วันครบอายุโครงการ

สมมติให้เงินลงทุนทั้งหมด 1,000,000 บาท สามารถแบ่งออกเป็น 2 ส่วน ดังนี้

ส่วนที่ 1 : ประมาณ 990,000 บาท (ร้อยละ 99.00) ลงทุนในตราสารหนี้และ/หรือเงินฝากทั้งในประเทศและ/หรือต่างประเทศ โดยมีเป้าหมายเพื่อให้ส่วนนี้หลังหักค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนแล้ว เดบิตเป็น 1,005,000 บาท (ร้อยละ 100.50)

ส่วนที่ 2 : ประมาณ 10,000 บาท (ร้อยละ 1.00) ลงทุนในสัญญาคอลลอร์แรนท์ (Call Warrant) หรือสัญญาคอลลอปชั่น (Call Option) ซึ่งมูลค่าตามขนาดของสัญญาคอลลอร์แรนท์ (Call Warrant) หรือสัญญาคอลลอปชั่น (Call Option) อยู่ที่ 1,000,000 บาท (ร้อยละ 100)

ประเภทหลักทรัพย์ / ทรัพย์สิน	สัดส่วนการลงทุนโดยประมาณ	อัตราผลตอบแทน ณ วันครบอายุโครงการ (ประมาณ 1 ปี 3 เดือน)	เงินต้นและผลตอบแทนที่คาดว่าจะได้รับ (ต่ออายุโครงการ)
ส่วนที่ 1 : ตราสารหนี้ และ/หรือ เงินฝากทั้งในประเทศและ/หรือ ต่างประเทศ	99.00%	ประมาณ 1.90%	101.35%
หัก ค่าใช้จ่ายโดยประมาณ			0.85%
เงินต้นและผลตอบแทนจากการลงทุนในส่วนที่ 1 หลังหักค่าใช้จ่ายของกองทุนโดยประมาณ			100.50%
ส่วนที่ 2 : สัญญาคอลลอร์แรนท์ (Call Warrant) หรือสัญญาคอลลอปชั่น (Call Option)	1.00%	ตัวอย่างผลตอบแทนจากสัญญาคอลลอร์แรนท์ (Call Warrant) หรือสัญญาคอลลอปชั่น (Call Option) ปรากฏตามตารางท้ายนี้	

- หมายเหตุ (1) ค่าใช้จ่ายของกองทุน (รวมค่าธรรมเนียมจัดการ) สามารถเปลี่ยนแปลงตามความเหมาะสม โดยไม่เกินจากอัตราสูงสุดที่ระบุไว้ในโครงการ
- (2) กองทุนอาจไม่ได้รับเงินต้นและผลตอบแทนตามที่คาดหมายไว้ หากผู้ออกตราสารหรือธนาคารที่กองทุนลงทุนไม่สามารถชำระเงินต้นและดอกเบี้ยคืนได้
- (3) อัตราผลตอบแทนอาจเปลี่ยนแปลงได้ ทั้งนี้ขึ้นอยู่กับสภาวะตลาด ณ ขณะที่กองทุนลงทุนจริง ซึ่งอาจทำให้ผู้ถือหน่วยลงทุนไม่ได้รับผลตอบแทนตามอัตราที่ประมาณการไว้

สมมติให้

วันที่จดทะเบียน : 18 มี.ค. 2564 , วันที่สิ้นสุดอายุโครงการ : 17 มี.ย. 2565

1. วันเข้าทำสัญญาคอลลอร์แนร์ (Call Warrant) หรือสัญญาคอลลอปชั่น (Call Option) คือ 18 มี.ค. 2564
2. Index Initial Level ของดัชนี SET50 Index ณ วันเข้าทำสัญญาคอลลอร์แนร์ (Call Warrant) หรือสัญญาคอลลอปชั่น (Call Option) คือ 100
3. วันพิจารณาสิทธิอ้างอิง สัญญาคอลลอร์แนร์ (Call Warrant) หรือสัญญาคอลลอปชั่น (Call Option) คือ วันที่ 12 มี.ย. 2565
4. กำหนดให้ Participation rate = 60%
5. กำหนดให้ Rebate Rate = 0.60%

กำหนดนิยามให้ “Knock Out” หมายถึง เหตุการณ์ที่ ระดับดัชนีของกองทุน SET50 Index เพิ่มขึ้นสูงเกินกว่า 10.0% ของ Index Initial Level หรือ 110 ในวันใดวันหนึ่งตลอดอายุสัญญาจนถึงวันพิจารณาสิทธิอ้างอิง

กรณี	Knock Out	ระดับดัชนี SET50 Index ณ วันเริ่มต้นสัญญา (Index Initial Level)	ระดับดัชนี SET50 Index ที่ขึ้นสูงสุดในระหว่างอายุสัญญา	ระดับดัชนี SET50 Index ณ วันพิจารณาดัชนีอ้างอิง (Index Final Level)	การเปลี่ยนแปลงของระดับดัชนี SET50 Index ณ วันพิจารณาดัชนีอ้างอิงเทียบกับวันเริ่มต้นสัญญา
1	ไม่เกิด Knock Out	100	ไม่เกินกว่า 110 (เปลี่ยนแปลงไม่เกิน 10% นับแต่วันเริ่มต้นสัญญา)	90	-10%
2	ไม่เกิด Knock Out	100	ไม่เกินกว่า 110 (เปลี่ยนแปลงไม่เกิน 10% นับแต่วันเริ่มต้นสัญญา)	105	5% (เปลี่ยนแปลง 5% นับแต่วันเริ่มต้นสัญญา)
3	เกิด Knock Out	100	เกินกว่า 110 (เปลี่ยนแปลงเกินกว่า 10% นับแต่วันเริ่มต้นสัญญา)	115	ไม่ต้องพิจารณา เนื่องจากระดับดัชนี SET50 Index ของวันใดวันหนึ่งในระหว่างอายุสัญญา สูงเกินกว่า 10% ของระดับดัชนี SET50 Index ณ วันเริ่มต้นสัญญา ซึ่งเข้าเงื่อนไขการเกิด Knock Out

ตัวอย่างสรุปผลตอบแทนที่คาดว่าจะได้รับจากการลงทุนในแต่ละกรณี

กรณีที่	เหตุการณ์ "Knock Out"	Index Final Level ของ ดัชนี SET50 Index ณ วันพิจารณา สิ้นทรัพย์อ้างอิง	ส่วนที่ 1 : เงินต้น (บาท)*	ส่วนที่ 2 ผลตอบแทนจาก สัญญาคอลลอร์ แรนท์(Call Warrant) หรือ สัญญา คอลอปชั่น (Call Option) (บาท)*	รวมเงินต้นและ ผลตอบแทน ทั้งหมดเมื่อครบ อายุโครงการ (บาท)*
1	ไม่เกิด Knock out	Index Final Level <u>น้อยกว่า</u> Index Initial Level ณ วันเข้าทำ สัญญาคอลลอร์ แรนท์ (Call Warrant) หรือ สัญญาคอลอปชั่น (Call Option)	1,005,000	0 คำนวณได้จาก = 1,000,000 x ([60.00% x Max (0%, (90/100)- 100%))] = 1,000,000 x (60.00% x 0%) = 0 บาท	1,005,000 (หรือคิดเป็น 0.50% ต่ออายุ โครงการ)
2	ไม่เกิด Knock out	Index Final Level <u>สูงกว่า</u> Index Initial Level ณ วันเข้าทำ สัญญาคอลลอร์ แรนท์(Call Warrant) หรือ สัญญาคอลอปชั่น (Call Option))	1,005,000	30,000 คำนวณได้จาก = 1,000,000 x ([60.00% x Max (0%, (105/100)- 100%))] = 1,000,000 x (60.00% x 5%) = 30,000 บาท	1,035,000 (หรือคิดเป็น 3.50% ต่ออายุ โครงการ) (ถ้าดัชนี เปลี่ยนแปลง เพิ่มขึ้น 5% ตาม ตัวอย่าง)
3	เกิด Knock out	Index Level ณ วันใดวันหนึ่งระหว่าง อายุสัญญา รวมถึง วันพิจารณา สิ้นทรัพย์อ้างอิง สูง เกินกว่า 10% ของ Index initial Level ดังนั้น จึงไม่ ต้องพิจารณา Index Final Level	1,005,000	6,000 คำนวณได้จาก = 1,000,000 x Rebate Rate = 1,000,000 x (0.60%) = 6,000 บาท	1,011,000 (หรือคิดเป็น 1.10% ต่ออายุ โครงการ)

หมายเหตุ ตัวเลขเงินต้นและผลตอบแทนเป็นเพียงตัวอย่างการคำนวณเพื่อประกอบการอธิบายเท่านั้น มิได้เป็นการ รับประกันว่าผู้ลงทุนจะได้รับผลตอบแทนตามที่แสดงไว้

ตัวอย่างแผนภาพของรูปแบบการจ่ายเงินต้นและผลตอบแทน



ข้อมูลสำคัญเกี่ยวกับดัชนีอ้างอิง SET50 Index ที่สัญญาคอลลอร์แนร์ (Call Warrant) หรือสัญญาคอปชั่น (Call Option) ใช้อ้างอิง

วันที่เริ่มใช้ดัชนี	16 สิงหาคม 2538
Bloomberg Ticker	SET50 Index
สกุลเงิน	บาท (THB)
ผู้จัดทำดัชนี	ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย
Website	https://www.set.or.th

ดัชนี SET50 Index เป็นดัชนีราคาหุ้นที่ใช้แสดงระดับและความเคลื่อนไหวของราคาหุ้นสามัญ 50 ตัวที่มีมูลค่าตามราคาตลาด (Market Capitalization) สูง มีการซื้อขายมีสภาพคล่องสูงอย่างสม่ำเสมอ และมีสัดส่วนผู้ถือหุ้นรายย่อยผ่านเกณฑ์ที่กำหนด ซึ่งตลาดหลักทรัพย์จะกำหนดให้มีการพิจารณาปรับรายการหลักทรัพย์ที่ใช้ในการคำนวณ SET50 Index ทุก 6 เดือน แบ่งเป็นรอบเดือนมิถุนายน และธันวาคม ของทุกปีเพื่อความเหมาะสมและสอดคล้องกับการเปลี่ยนแปลงที่อาจเกิดขึ้นกับภาวะการณ์ในตลาดหลักทรัพย์ ทั้งนี้ ดัชนีได้รับการพัฒนาโดยตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยซึ่งไม่ได้มีความเกี่ยวข้องกับบริษัทจัดการ จึงมีความอิสระจากบริษัทจัดการ

อนึ่ง ผู้ถือหน่วยลงทุนสามารถเข้าถึงข้อมูลดัชนี SET50 Index เพื่อศึกษาข้อมูลเพิ่มเติมได้ที่ www.set.or.th

คำอธิบายเพิ่มเติม

- **ความเสี่ยงจากการผิดนัดชำระหนี้ของผู้ออกตราสาร (Credit Risk)** หมายถึง การพิจารณาจากอันดับความน่าเชื่อถือของตราสารที่ลงทุน (credit rating) ซึ่งเป็นข้อมูลบอกระดับความสามารถในการชำระหนี้ โดยพิจารณาจากผลการดำเนินงานที่ผ่านมาและฐานะการเงินของผู้ออกตราสาร credit rating ของหุ้นกู้ระยะยาวมีความหมายโดยย่อ ดังต่อไปนี้

ระดับการลงทุน	TRIS	Fitch	Moody's	S&P	คำอธิบาย
ระดับที่น่าลงทุน	AAA	AAA(tha)	Aaa	AAA	อันดับเครดิตสูงสุด มีความเสี่ยงต่ำที่สุดที่จะไม่สามารถชำระหนี้ได้ตามกำหนด
	AA	AA(tha)	Aa	AA	อันดับเครดิตรองลงมาและถือว่า มีความเสี่ยงต่ำมากที่จะไม่สามารถชำระหนี้ได้ตามกำหนด
	A	A(tha)	A	A	ความเสี่ยงต่ำที่จะไม่สามารถชำระหนี้ได้ตามกำหนด
	BBB	BBB(tha)	Baa	BBB	ความเสี่ยงปานกลางที่จะไม่สามารถชำระหนี้ได้ตามกำหนด
ระดับที่ต่ำกว่าน่าลงทุน	ต่ำกว่า BBB	ต่ำกว่า BBB	ต่ำกว่า BBB(tha)	ต่ำกว่า BBB	ความเสี่ยงสูง ที่จะไม่สามารถชำระหนี้ได้ตามกำหนด

- **ความเสี่ยงจากความผันผวนของราคาหลักทรัพย์ (Market Risk)** หมายถึง ความผันผวนของมูลค่าหน่วยลงทุนที่เกิดจากการเปลี่ยนแปลงของอัตราดอกเบี้ยซึ่งขึ้นกับปัจจัยภายนอก เช่น สภาวะเศรษฐกิจการลงทุน ปัจจัยทางการเมืองทั้งในและต่างประเทศ เป็นต้น โดยราคาตราสารหนึ่งจะเปลี่ยนแปลงในทิศทางตรงข้ามกับการเปลี่ยนแปลงของอัตราดอกเบี้ย เช่น หากอัตราดอกเบี้ยในตลาดเงินมีแนวโน้มปรับตัวสูงขึ้นอัตราดอกเบี้ยของตราสารหนี้ที่ออกใหม่ก็จะสูงขึ้นด้วย ดังนั้นราคาตราสารหนี้ที่ออกมาก่อนจะมีการซื้อขายในระดับราคาต่ำลง โดยกองทุนรวมที่มีอายุเฉลี่ยของทรัพย์สินที่ลงทุน (portfolio duration) สูงจะมีความเสี่ยงต่อการเปลี่ยนแปลงของราคามากกว่ากองทุนรวมที่มี portfolio duration ต่ำกว่า
- **ความเสี่ยงจากการเปลี่ยนแปลงของอัตราแลกเปลี่ยน (Currency Risk)** หมายถึง การเปลี่ยนแปลงของอัตราแลกเปลี่ยนมีผลกระทบต่อมูลค่าของหน่วยลงทุน เช่น กองทุนรวมลงทุนด้วยสกุลเงินดอลลาร์สหรัฐในช่วงที่เงินบาทอ่อนแต่ขายทำกำไรในช่วงที่บาทแข็ง กองทุนจะได้เงินบาทกลับมาน้อยลง ในทางกลับกันหากกองทุนรวมลงทุนในช่วงที่เงินบาทแข็งและขายทำกำไรในช่วงที่บาทอ่อนก็อาจได้ผลตอบแทนมากขึ้นกว่าเดิมด้วยเช่นกัน ดังนั้น การป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยนจึงเป็นเครื่องมือสำคัญในการบริหารความเสี่ยงจากดังกล่าว
แต่ทั้งนี้ กองทุนจะป้องกันความเสี่ยงด้านอัตราแลกเปลี่ยน (Hedging) ทั้งจำนวนในเงินลงทุน เงินฝาก/ตราสารหนี้ที่ลงทุนทั้งในและต่างประเทศ และในส่วนของสัญญาคอลลอว์แรนซ์ (Call Warrant) หรือสัญญาคอลลอปชั่น (Call Option) กองทุนจะลงทุนในรูปสกุลเงินบาท
- **ความเสี่ยงจากการกระจุกตัว (High Concentration Risk)**
 - (1) ความเสี่ยงจากการลงทุนกระจุกตัวในผู้ออกตราสารรายใดรายหนึ่ง (High Issuer Concentration Risk) เกิดจากกองทุนลงทุนในผู้ออกตราสารรายใด ๆ มากกว่าร้อยละ 10 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิรวมกัน ซึ่งหากเกิดเหตุการณ์ที่ส่งผลกระทบต่อ การดำเนินงาน ฐานะทางการเงิน หรือความมั่นคงของผู้ออกตราสารรายดังกล่าว กองทุนอาจมีผลการดำเนินงานที่ผันผวนมากกว่ากองทุนที่กระจายการลงทุนในหลายผู้ออกตราสาร
 - (2) ความเสี่ยงจากการลงทุนกระจุกตัวในหมวดอุตสาหกรรมใดอุตสาหกรรมหนึ่ง (Sector Concentration Risk) เกิดจาก กองทุนลงทุนในบางหมวดอุตสาหกรรมมากกว่าร้อยละ 20 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิรวมกัน ซึ่งหากเกิดเหตุการณ์ที่ส่งผลกระทบต่ออุตสาหกรรมนั้น กองทุนอาจมีผลการดำเนินงานที่ผันผวนมากกว่ากองทุนที่กระจายการลงทุนในหลายหมวดอุตสาหกรรม
 - (3) ความเสี่ยงจากการกระจุกตัวลงทุนในประเทศใดประเทศหนึ่ง (Country Concentration Risk) เกิดจากกองทุนลงทุนในประเทศใดประเทศหนึ่งมากกว่าร้อยละ 20 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิรวมกัน ซึ่งหากเกิดเหตุการณ์ที่ส่งผลกระทบต่อประเทศดังกล่าว เช่น การเมือง เศรษฐกิจ สังคม เป็นต้น กองทุนดังกล่าวอาจมีผลการดำเนินงานที่ผันผวนมากกว่ากองทุนที่กระจายการลงทุนในหลายประเทศ