

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน วรณ จำกัด

กองทุนเปิด วรณ ตราสารหนี้ไทย 2Y

ONE THAI FIXED INCOME 2Y FUND

ONE-TFIN2Y

ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

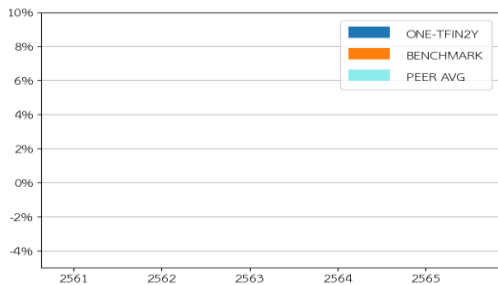
🏠 กองทุนรวมตราสารหนี้

🏠 Miscellaneous

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- กองทุนมีนโยบายลงทุนในตราสารแห่งหนึ่ง และ/หรือ เงินฝาก หรือตราสารเทียบเท่าเงินฝาก และ/หรือ หน่วยลงทุนของกองทุนรวมตราสารแห่งหนึ่ง รวมกันไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน
- กองทุนอาจลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) เฉพาะเพื่อลดความเสี่ยง (Hedging)
- กองทุนมีกลยุทธ์การลงทุนเพื่อมุ่งหวังสร้างผลตอบแทนจากการลงทุนในตราสารหนี้ โดยจะลงทุนและถือทรัพย์สินที่ลงทุนจนครบอายุโครงการ (buy-and-hold)

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (% ต่อปี)



	2561	2562	2563	2564	2565
ONE-TFIN2Y	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
BENCHMARK	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
PEER AVG	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A

ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปีกumul (% ต่อปี)

	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี
กองทุน	N/A	N/A	N/A	N/A
ดัชนีชี้วัด	N/A	N/A	N/A	N/A
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	N/A	N/A	N/A	N/A
ความผันผวนกองทุน	N/A	N/A	N/A	N/A
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	N/A	N/A	N/A	N/A
	3 ปี	5 ปี	10 ปี	ตั้งแต่จัดตั้ง
กองทุน	N/A	N/A	N/A	N/A
ดัชนีชี้วัด	N/A	N/A	N/A	N/A
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	N/A	N/A	N/A	N/A
ความผันผวนกองทุน	N/A	N/A	N/A	N/A
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	N/A	N/A	N/A	N/A

ระดับความเสี่ยง



เสี่ยงปานกลางค่อนข้างต่ำ

ลงทุนในพันธบัตรรัฐบาล และตราสารหนี้เอกชน โดยมีตราสาร non-investment grade /unrated ไม่เกิน 20 % ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม

- วันจดทะเบียนกองทุน 5 เมษายน 2564
- วันเริ่มต้น class 5 เมษายน 2564
- นโยบายการจ่ายเงินปันผล ไม่จ่าย
- อายุกองทุน ประมาณ 2 ปี โดยไม่ต่ำกว่า 1 ปี 11 เดือน และไม่เกิน 2 ปี 1 เดือน นับจากวันที่สำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ต. รับจดทะเบียนกองทุนทรัพย์สินเป็นกองทุนรวม

ผู้จัดการกองทุนรวม

- 🏠 น.ส.พรอมา เทวาทูดี (ตั้งแต่จดทะเบียน)
- 🏠 น.ส.จันทร์เพ็ญ ชูวงษ์ (ตั้งแต่จดทะเบียน)

ดัชนีชี้วัด

ไม่มี เนื่องจาก กองทุนมีกลยุทธ์การลงทุนครั้งเดียวและถือครองจนครบอายุโครงการ(buy-and-hold) เพื่อให้ได้ผลตอบแทนที่คาดหวังตามระยะเวลาที่กำหนดไว้ จึงไม่จำเป็นต้องมีดัชนีชี้วัด

คำเตือน

- 🏠 การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
  - 🏠 ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวมมิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต
  - 🏠 ผู้ลงทุนไม่สามารถขายคืนหน่วยลงทุนในช่วงระยะเวลา 2 ปี
- การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต : ได้รับการรับรอง CAC

ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือบริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่องได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



## การซื้อหน่วยลงทุน

วันทำการซื้อ :  
ไม่เปิดเสนอขายภายหลังการเสนอขายหน่วยลงทุนครั้งแรก

เวลาทำการ : 09:00 - 15:30 น.

การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ : 1,000.00 บาท

การซื้อครั้งถัดไปขั้นต่ำ : ไม่กำหนด

## การขายคืนหน่วยลงทุน

วันทำการขายคืน :  
เวลาทำการ :  
การขายคืนขั้นต่ำ : ไม่กำหนด  
ยอดคงเหลือขั้นต่ำ : ไม่กำหนด  
ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน :

หมายเหตุ :1. บริษัทจัดการจะดำเนินการรับซื้อคืนหน่วยลงทุนเมื่อสิ้นสุดอายุโครงการ โดยบริษัทจัดการจะประกาศแจ้งวันรับซื้อคืนหน่วยลงทุนอัตโนมัติและวันครบอายุโครงการ โดยประกาศผ่านทางเว็บไซต์ของบริษัทจัดการ ภายใน 30 วันทำการนับจากวันที่จดทะเบียนกองทรัสต์สินเป็นกองทุนรวม

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	1.07	0.4
รวมค่าใช้จ่าย	2.782	0.53375

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
- ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บอาจเปลี่ยนแปลงตามความเหมาะสม โดยเก็บในอัตราไม่เกินจากที่ระบุไว้ในโครงการ

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน	
ประเภททรัพย์สิน	%NAV
ตราสารหนี้ภาคเอกชน	61.13
ตราสารหนี้ภาครัฐ	49.4
เงินฝาก และอื่นๆ	-10.54

ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก	
ทรัพย์สิน	%NAV
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 3/91/66	30.78
ตั๋วเงินคลัง กวดที่ (DM)2/182/66	16.33
หุ้นกู้บริษัท แอล.พี.เอ็น.ดีเวลลอปเม้นท์ จำกัด (มหาชน) ครั้งที่ 2/2564	10.03
หุ้นกู้ของบริษัท ไมเนอร์ อินเตอร์เนชั่นแนล จำกัด (มหาชน) ครั้งที่ 1/2564	9.56
หุ้นกู้ของ บริษัท ศรีตรังแอโรอินดัสทรี จำกัด(มหาชน) ครั้งที่1/2564 ชุดที่ 1ครบกำหนดไถ่ถอนปีพ.ศ.2566	9.53

## ข้อมูลเชิงสถิติ

Maximum Drawdown : -0.17%

Recovering Period : N/A ปี 1 เดือน

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน : 0.05 เท่า

อายุเฉลี่ยของตราสารหนี้ : N/A ปี N/A เดือน

Yield to Maturity : 1.88% ต่อปี

## การจัดสรรการลงทุนในต่างประเทศ

ประเทศ	%NAV
ไทย	100

## ผู้ออกตราสาร 5 อันดับแรก

อุตสาหกรรม	%NAV
BANK OF THAILAND	33.08
MINISTRY OF FINANCE	16.33
L.P.N. DEVELOPMENT PUBLIC COMPANY LIMITED	10.03
MINOR INTERNATIONAL PUBLIC COMPANY LIMITED	9.56
SRI TRANG AGRO-INDUSTRY PUBLIC COMPANY LIMITED	9.53

## การจัดสรรการลงทุนตามอันดับความน่าเชื่อถือ (%NAV)

	ในประเทศ	national	international
GOV/AAA/AAA(tha)	49.4		
AA/AA(tha)		3.56	
A/A(tha)	39.13	3.61	
BBB/BBB(tha)	18.4		
ต่ำกว่า BBB			
unrated			

## คำอธิบาย

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

ต่อหน่วยที่จุดสูงสุดไปจนถึงจุดต่ำสุดในช่วงที่ NAV ต่อหน่วยปรับตัวลดลง ค่า Maximum Drawdown เป็นข้อมูลที่ช่วยให้ทราบถึงความเสี่ยงที่อาจจะขาดทุนจากการลงทุนในกองทุนรวม

**Recovering Period** ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาตั้งแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลาานเท่าใด

**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** ระดับและทิศทางของการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุน 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

ซึ่งคำนวณจากดอกเบี้ยที่ได้รับในอนาคตตลอดอายุตราสารและเงินต้นที่ได้รับคืนนำมาคิดลดเป็นมูลค่าปัจจุบัน โดยใช้วัดอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมตราสารหนี้ คำนวณจากค่าเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักของ

Yield to Maturity ของตราสารหนี้แต่ละตัวที่กองทุนมีการลงทุน และเนื่องจาก Yield to Maturity มีหน่วยมาตรฐานเป็นเปอร์เซ็นต์ต่อปี

จึงสามารถนำไปใช้เปรียบเทียบอัตราผลตอบแทนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีนโยบายถือครองตราสารหนี้จนครบกำหนดอายุและมีลักษณะการลงทุนที่ใกล้เคียงกันได้

## บริษัท หลักทรัพย์จัดการกองทุน วรธน จำกัด

เลขที่ 989 อาคารสยามพิพรรณ์ทาวเวอร์ 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/)