

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน วรธร จำกัด

กองทุนเปิด วรธร แอนไท คอร์รัปชั่น

ONE ANTI-CORRUPTION FUND

หน่วยลงทุนชนิดจ่ายเงินปันผล สำหรับผู้ลงทุนทั่วไป

ONE-ACT-RD

ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

ระดับความเสี่ยง

🏠 กองทุนรวมผสม

🏠 Moderate Allocation



เสี่ยงปานกลางค่อนข้างสูง

ลงทุนในตราสารทุน ตราสารหนี้และ/หรือทรัพย์สินทางเลือก โดยมีสัดส่วนการลงทุนในตราสารทุนน้อยกว่า 80 % ของ NAV

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- กองทุนมีนโยบายลงทุนในตราสารแห่งทุน ตราสารกึ่งหนี้กึ่งทุน ตราสารแห่งหนี้ และ/หรือเงินฝาก ของบริษัทที่มีแนวโน้มหรือปัจจัยพื้นฐานดีและดำเนินธุรกิจภายใต้หลักธรรมาภิบาลที่ดี ซึ่งผ่านเกณฑ์การพิจารณาหรือดัชนีชี้วัดในด้าน การกำกับดูแลกิจการที่ดีจากองค์กรหรือสถาบันที่เกี่ยวข้องกับการกำกับดูแลกิจการ การต่อต้านการทุจริตในระดับ 4 ขึ้นไป โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน
- โดยกองทุนจะพิจารณาลงทุนในหลักทรัพย์แต่ละประเภทในสัดส่วนตั้งแต่ร้อยละ 0 ถึงร้อยละ 100 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน
- กองทุนอาจลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) เพื่อเป็นการเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน (Efficient Portfolio Management) หรือลงทุนเพื่อลดความเสี่ยง (Hedging) และกองทุนอาจลงทุนในตราสารที่มีลักษณะของสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแฝง (Structured Note)
- กองทุนมีกลยุทธ์การลงทุนที่มุ่งหวังให้ผลประกอบการสูงกว่าดัชนีชี้วัด (active management)

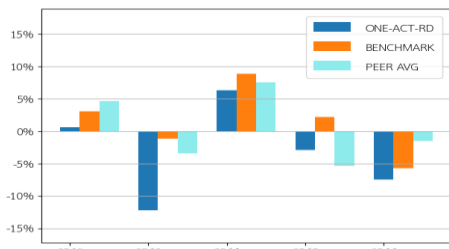
ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน	12 พฤษภาคม 2559
วันเริ่มต้น class	12 พฤษภาคม 2559
นโยบายการจ่ายเงินปันผล	จ่าย
อายุกองทุน	ไม่กำหนด

ผู้จัดการกองทุนรวม

นายชัยพฤกษ์ กุลกาญจนาร	(ตั้งแต่ 3 มกราคม 2564)
นายบัญชา จึงวัฒนกิจ	(ตั้งแต่จดทะเบียน)

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (% ต่อปี)



ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปีกลุ่ม (% ต่อปี)

	2562	2563	2564	2565	2566
ONE-ACT-RD	0.63%	-12.22%	6.35%	-2.85%	-7.46%
BENCHMARK	3.1%	-1.16%	8.87%	2.19%	-5.66%
PEER AVG	4.65%	-3.46%	7.56%	-5.37%	-1.48%

	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี
กองทุน	-2.07	-0.64	-6.28	-6.81
ดัชนีชี้วัด	-1.06	0.31	-5.26	-5.58
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	0.36	2.23	-0.78	-1.24
ความผันผวนกองทุน	5.08	4.92	5.36	5.86
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	5.21	5.07	5.81	6.04

	3 ปี	5 ปี	10 ปี	ตั้งแต่จัดตั้ง
กองทุน	-3.12	-4.22	N/A	-1.08
ดัชนีชี้วัด	0.66	0.52	N/A	2.3
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	-0.69	-0.26	1.65	N/A
ความผันผวนกองทุน	6.88	10.24	N/A	10.56
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	5.77	8.66	N/A	7.66

ดัชนีชี้วัด

ดัชนีผลตอบแทนรวมตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET TRI) สัดส่วนร้อยละ 50 และดัชนีตราสารหนี้ภาครัฐระยะสั้น (ThaiBMA Short-term Government Bond Total Return Index) สัดส่วนร้อยละ 50

คำเตือน

- 🏠 การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- 🏠 ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวมมิได้เป็นสิ่งยืนยันถึง ผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต : ได้รับการรับรอง CAC

จัดอันดับกองทุน Morningstar ★

ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือ

บริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่อง

ได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



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

## การซื้อหน่วยลงทุน

วันทำการซื้อ : ทุกวันทำการ  
เวลาทำการ : 09:00 - 15:00 น.  
การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ : 10,000.00 บาท  
การซื้อครั้งถัดไปขั้นต่ำ : 10,000.00 บาท

## การขายคืนหน่วยลงทุน

วันทำการขายคืน : ทุกวันทำการ  
เวลาทำการ : 09:00 - 15:00 น.  
การขายคืนขั้นต่ำ : ไม่กำหนด  
ยอดคงเหลือขั้นต่ำ : 100 หน่วย  
ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน : T+3 คือ 3 วันทำการ  
หลังจากวันทำการขายคืน

## ข้อมูลเชิงสถิติ

Maximum Drawdown : -13.89%  
Recovering Period : N/A  
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน : 0.38 เท่า

## การจัดสรรการลงทุนในต่างประเทศ

ประเทศ	%NAV
ไทย	100

## การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม

อุตสาหกรรม	%NAV
พัฒนาอสังหาริมทรัพย์	18.33
เงินทุนและหลักทรัพย์	15.13
พลังงานและสาธารณูปโภค	14.24
ธนาคาร	12.6
รัฐบาล	9.76

## ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	2.675	2.675
รวมค่าใช้จ่าย	6.42	3.7664

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	2.14	1.0
การรับซื้อคืน	2.14	ยกเว้น
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า	2.14	1.0
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก	2.14	ยกเว้น
การโอนหน่วยลงทุน	ตามที่นายทะเบียนเรียกเก็บ	ตามที่นายทะเบียนเรียกเก็บ

หมายเหตุ :

- ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่มภาษีธุรกิจเฉพาะ หรือภาษีอื่นใดแล้ว
- ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บอาจเปลี่ยนแปลงตามความเหมาะสม โดยเก็บในอัตราไม่เกินจากที่ระบุไว้ในโครงการ

## สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน

ประเภททรัพย์สิน	%NAV
หุ้นในประเทศ	48.02
ตราสารหนี้ภาคเอกชน	41.04
ตราสารหนี้ภาครัฐ	9.76
เงินฝาก และอื่นๆ	1.19

## ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก

ทรัพย์สิน	%NAV
หุ้นกู้ไม่ด้อยสิทธิและไม่มีประกันของบริษัท แลนด์ แอนด์ เฮ้าส์ จำกัด (มหาชน) ครั้งที่ 1/2565 ครบ2567 (LH2444B)	6.51
หุ้นกู้ของบริษัท บริหารสินทรัพย์ กรุงเทพพาณิชย์ จำกัด ครั้งที่ 1/2564 ชุดที่3 ครบกำหนดปี2567 (BAM244A)	5.49
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 8/91/67 (CB24523A)	5.41
หุ้นกู้ของธนาคารเกียรตินาคินภัทร จำกัด (มหาชน) ครั้งที่ 6/2566 ครบกำหนดไถ่ถอนปี พ.ศ. 2567 (KKP24OB)	5.36
หุ้นกู้ไม่ด้อยสิทธิและไม่มีประกันของบริษัท เอพี(ไทยแลนด์) จำกัด (มหาชน) ครั้งที่1/2567 ครบกำหนด2570 (AP271A)	4.39

## 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 จำนวนจากค่าเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักของ 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/)