

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน วรณ จำกัด

กองทุนเปิดวรณเอเอ็มสมาร์ตหุ้นระยะยาว

1 A.M. Smart Long Term Equity Fund

1SMART-LTF

ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

🏠 กองทุนรวมตราสารทุน

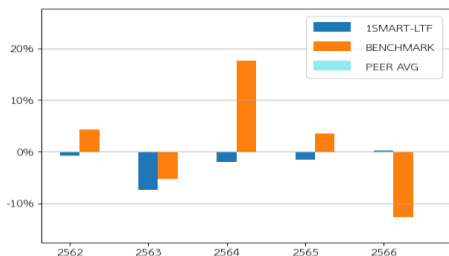
🏠 กองทุนรวมหุ้นระยะยาว

🏠 Miscellaneous

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- ลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งหุ้นสามัญของบริษัทจดทะเบียนหรือตราสารแห่งทุนซึ่งผลตอบแทนของตราสารดังกล่าวอ้างอิงกับผลตอบแทนของหุ้นหรือกลุ่มหุ้นของบริษัทจดทะเบียนที่มีปัจจัยพื้นฐานดี มีความมั่นคง และให้ผลตอบแทนที่เหมาะสมเมื่อเทียบกับระดับความเสี่ยง โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 65 ของ NAV
- กองทุนอาจลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเพื่อลดความเสี่ยงจากการเปลี่ยนแปลงของราคาหลักทรัพย์หรือเพื่อเป็นการเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน
- กลยุทธ์ในการบริหารจัดการลงทุนมุ่งหวังให้ผลประกอบการสูงกว่าดัชนีชี้วัด (active management)

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (% ต่อปี)



ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปีกumul (% ต่อปี)

	2562	2563	2564	2565	2566
1SMART-LTF	-0.76%	-7.38%	-1.93%	-1.5%	0.25%
BENCHMARK	4.29%	-5.24%	17.67%	3.53%	-12.66%
PEER AVG	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี	
กองทุน	0.04	0.09	-0.01	-0.02	
ดัชนีชี้วัด	-3.62	-1.08	-11.39	-16.0	
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	N/A	N/A	N/A	N/A	
ความผันผวนกองทุน	2.06	2.15	2.29	2.38	
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	11.62	11.44	11.78	12.02	
	3 ปี	5 ปี	10 ปี	ตั้งแต่จัดตั้ง	
กองทุน	-1.05	-2.34	-1.48	-0.27	
ดัชนีชี้วัด	0.43	-0.71	3.84	7.2	
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	N/A	N/A	N/A	N/A	
ความผันผวนกองทุน	1.41	2.43	1.89	2.32	
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	11.64	17.61	14.77	19.18	

ระดับความเสี่ยง



เสี่ยงสูง

ลงทุนในตราสารทุนเป็นหลักโดยเฉลี่ยในรอบปีไม่น้อยกว่า 80 % ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน	26 มิถุนายน 2550
วันเริ่มต้น class	26 มิถุนายน 2550
นโยบายการจ่ายเงินปันผล	ไม่จ่าย
อายุกองทุน	ไม่กำหนด

ผู้จัดการกองทุนรวม

- นายชัยพฤกษ์ กุลกาญจนธรร (ตั้งแต่ 3 มกราคม 2564)
- นายบัญชา จึงวัฒนกิจ (ตั้งแต่จดทะเบียน)

ดัชนีชี้วัด

ดัชนีผลตอบแทนรวมตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET TRI)

คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวมมิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต : ได้รับการรับรอง CAC

ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือ
บริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่อง
ได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



www.one-asset.com

การซื้อขายหน่วยลงทุน

วันทำการซื้อ :

เวลาทำการ :

การซื้อขายครั้งแรกขั้นต่ำ : ไม่กำหนด

การซื้อขายครั้งถัดไปขั้นต่ำ : ไม่กำหนด

การขายคืนหน่วยลงทุน

วันทำการขายคืน :

ทุกวันทำการสุดท้ายก่อนหน้าวันทำการสุดท้าย

ของทุกเดือน

เวลาทำการ : 09:00 - 15:30 น.

การขายคืนขั้นต่ำ : ไม่กำหนด

ยอดคงเหลือขั้นต่ำ : ไม่กำหนด

ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน : T+3 คือ 3 วันทำการ

หลังจากวันทำการขายคืน

หมายเหตุ :

- ตั้งแต่วันที่ 1 กุมภาพันธ์ 2555 เป็นต้นไป บริษัทจัดการจะไม่เปิดรับคำสั่งซื้อหน่วยลงทุนเพิ่มเติม เพื่อให้เป็นไปตามประกาศของคณะกรรมการกำกับตลาดทุน
- ผู้ถือหน่วยลงทุนต้องส่งคำสั่งขายคืนหน่วยลงทุนล่วงหน้าเป็นเวลาไม่น้อยกว่า 1 วันทำการก่อนวันทำการขายคืนหน่วยลงทุน โดยหากตรงกับวันหยุดทำการให้เลื่อนเป็นวันทำการถัดไป

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	1.94954	1.769459
รวมค่าใช้จ่าย	6.42	1.913909

หมายเหตุ :

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

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การขาย	1.07	0.25
การรับซื้อคืน	1.07	0.25
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า	1.07	0.25
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก	1.07	0.25
การโอนหน่วยลงทุน	ตามที่นายทะเบียนเรียกเก็บ	ตามที่นายทะเบียนเรียกเก็บ

หมายเหตุ :

- ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่มภาษีธุรกิจเฉพาะ หรือภาษีอื่นใดแล้ว
- ค่าใช้จ่ายที่กองทุนเรียกเก็บอาจเปลี่ยนแปลงตามความเหมาะสม โดยเก็บในอัตราไม่เกินจากที่ระบุไว้ในโครงการ
- ค่าธรรมเนียมการสับเปลี่ยนหน่วยลงทุน
 - (3.1) กรณีกองทุนเป็นกองทุนต้นทาง
 - โอนย้ายไปยังกองทุนรวมหุ้นระยะยาวอื่นภายใต้การจัดการของบริษัทจัดการอื่น: 1.07% แต่ไม่ต่ำกว่า 200 บาท
 - โอนย้ายไปยังกองทุนรวมหุ้นระยะยาวอื่นภายใต้การจัดการของบริษัทจัดการ: ยกเว้นการเรียกเก็บ
 - (3.2) กรณีกองทุนเป็นกองทุนปลายทางการขายหน่วยลงทุน: เป็นไปตามค่าธรรมเนียม
- ค่าธรรมเนียมการขายและรับซื้อคืนหน่วยลงทุนข้างต้นเรียกเก็บเข้ากองทุน

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน

ประเภททรัพย์สิน	%NAV
หุ้นในประเทศ	72.13
เงินฝาก และอื่นๆ	27.87

ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก

ทรัพย์สิน	%NAV
เงินหลักประกัน บริษัทหลักทรัพย์ เคจีไอ (ประเทศไทย) (KGI MARGIN_SMART)	22.63
บริษัท เอลต้า อีเลคโทรนิคส์ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) (DELTA)	6.24
บริษัท ปตท. จำกัด (มหาชน) (PTT)	6.13
บริษัท ท่าอากาศยานไทย จำกัด (มหาชน) (AOT)	5.43
บริษัท แอดวานซ์ อินโฟร์ เซอร์วิส จำกัด (มหาชน) (ADVANC)	4.12

ข้อมูลเชิงสถิติ

Maximum Drawdown : -3.88%

Recovering Period : N/A

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน : 0.01 เท่า

Sharpe Ratio : -0.74

Alpha : -1.48%

Beta : -0.01

การจัดสรรการลงทุนในต่างประเทศ

ประเทศ	%NAV
ไทย	100

การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม

อุตสาหกรรม	%NAV
ธนาคาร	31.4
พลังงานและสาธารณูปโภค	18.83
เทคโนโลยีสารสนเทศและการสื่อสาร	6.96
ขนส่งและโลจิสติกส์	6.64
ชิ้นส่วนอิเล็กทรอนิกส์	6.56

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/