

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน วรธน จำกัด

กองทุนเปิดวรรณเอเอ็มหุ้นคุณค่าปันผล

หน่วยลงทุนชนิดจ่ายเงินปันผล สำหรับผู้ลงทุนทั่วไป

1 A.M. VALUED STOCK FUND-DIVIDEND FUND

1VAL-RD

ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

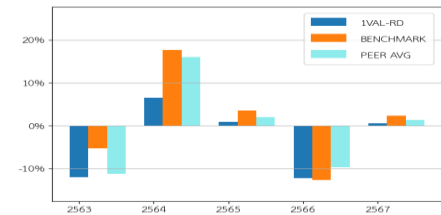
 กองทุนรวมตราสารทุน

 Equity Large Cap

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- กองทุนมีนโยบายลงทุนในหุ้นที่มีปัจจัยพื้นฐานดี และ/หรือ หุ้นที่มีการจ่ายเงินปันผลสูงกว่าอัตราค่าเฉลี่ยของตลาดหลักทรัพย์ฯ รวมทั้งหุ้นที่มีแนวโน้มการเติบโตดี และมีราคาต่ำเมื่อเทียบกับปัจจัยพื้นฐานในระยะปานกลางถึงระยะยาว โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุนรวม
- กองทุนมีกลยุทธ์การลงทุนเพื่อมุ่งหวังให้ผลประกอบการสูงกว่าดัชนีชี้วัด (active management)

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (% ต่อปี)



| | 2563 | 2564 | 2565 | 2566 | 2567 |
|-----------|---------|--------|-------|---------|-------|
| 1VAL-RD | -12.02% | 6.48% | 0.91% | -12.24% | 0.58% |
| BENCHMARK | -5.24% | 17.67% | 3.53% | -12.66% | 2.33% |
| PEER AVG | -11.22% | 16.03% | 1.98% | -9.68% | 1.34% |

ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปีกลุ่ม (%)

| | YTD | 3 เดือน | 6 เดือน | 1 ปี* |
|--------------------------|--------|---------|---------|-----------------|
| กองทุน | -16.46 | -4.65 | -18.19 | -12.39 |
| ดัชนีชี้วัด | -15.49 | -2.29 | -17.05 | -10.98 |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน | -14.8 | -4.2 | -16.32 | -10.44 |
| ความผันผวนกองทุน | 20.24 | 22.22 | 19.48 | 15.82 |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด | 19.9 | 22.08 | 18.95 | 15.7 |
| | 3 ปี* | 5 ปี* | 10 ปี* | ตั้งแต่จัดตั้ง* |
| กองทุน | -9.74 | -4.57 | -3.06 | 3.11 |
| ดัชนีชี้วัด | -8.48 | 0.03 | 0.58 | 6.54 |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน | -7.97 | -0.55 | -0.52 | N/A |
| ความผันผวนกองทุน | 12.7 | 13.3 | 13.54 | 18.34 |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด | 12.79 | 13.56 | 14.81 | 18.33 |

* หมายเหตุ: % ต่อปี

ระดับความเสี่ยง



เสี่ยงสูง

ลงทุนในตราสารทุนเป็นหลักโดยเฉลี่ยในรอบปีไม่น้อยกว่า 80 % ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน 1 มิถุนายน 2548


วันเริ่มต้น class 1 มิถุนายน 2548

นโยบายการจ่ายเงินปันผล จ่าย

อายุกองทุน ไม่กำหนด

ผู้จัดการกองทุนรวม

 นายชัยพฤกษ์ กุลกาญจนาธร (ตั้งแต่ 3 มกราคม 2564)

 นายบัญชา จิ้งวัฒนกิจ (ตั้งแต่ 3 มกราคม 2549)

ดัชนีชี้วัด

ดัชนีผลตอบแทนรวมตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET TRI)

คำเตือน

 การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน

 ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวมมิได้เป็นสิ่งยืนยันถึง ผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต : ได้รับการรับรอง CAC

จัดอันดับกองทุน Morningstar ★★

ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือ

บริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่อง

ได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



www.one-asset.com

การซื้อขายหน่วยลงทุน

วันทำการซื้อ : ทุกวันทำการ
เวลาทำการ : 09:00 - 15:30 น.
การซื้อขายครั้งแรกขั้นต่ำ : 1,000.00 บาท
การซื้อขายครั้งถัดไปขั้นต่ำ : 1,000.00 บาท

การขายคืนหน่วยลงทุน

วันทำการขายคืน : ทุกวันทำการ
เวลาทำการ : 09:00 - 15:30 น.
การขายคืนขั้นต่ำ : ไม่กำหนด
ยอดคงเหลือขั้นต่ำ : 100 หน่วย
ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน : T+3 คือ3 วันทำการ
หลังจากวันทำการการขายคืน

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)

| ค่าธรรมเนียม | สูงสุดไม่เกิน | เก็บจริง |
|---------------|---------------|----------|
| การจัดการ | 2.04798 | 2.04798 |
| รวมค่าใช้จ่าย | 6.42 | 2.19243 |

- หมายเหตุ :
- 1.ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่มภาษีธุรกิจเฉพาะ หรือภาษีอื่นใดแล้ว
 - 2.ค่าใช้จ่ายที่กองทุนเรียกเก็บอาจเปลี่ยนแปลงตามความเหมาะสม โดยเก็บในอัตราไม่เกินจากที่ระบุไว้ในโครงการ
 - 3. สามารถดูข้อมูลค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายย้อนหลัง 3 ปี ของกองทุนในหนังสือชี้ชวนส่วนข้อมูลกองทุนรวม ได้ที่ www.one-asset.com

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)

| ค่าธรรมเนียม | สูงสุดไม่เกิน | เก็บจริง |
|-----------------------------|---------------------------|---------------------------|
| การขาย | 0.535 | 0.2675 |
| การรับซื้อคืน | 0.2675 | 0.25 |
| การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า | 0.535 | 0.2675 |
| การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก | 0.2675 | 0.25 |
| การโอนหน่วยลงทุน | ตามที่นายทะเบียนเรียกเก็บ | ตามที่นายทะเบียนเรียกเก็บ |

- หมายเหตุ :
- 1.ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่มภาษีธุรกิจเฉพาะ หรือภาษีอื่นใดแล้ว
 - 2.ค่าธรรมเนียมการรับซื้อคืนและสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก เรียกเก็บเข้ากองทุน
 - 2.ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บอาจเปลี่ยนแปลงตามความเหมาะสม โดยเก็บในอัตราไม่เกินจากที่ระบุไว้ในโครงการ

| สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน | |
|--------------------------------|-------|
| ประเภททรัพย์สิน | %NAV |
| หุ้นในประเทศ | 93.72 |
| เงินฝาก และอื่นๆ | 6.28 |

| ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก | |
|---|-------|
| ทรัพย์สิน | %NAV |
| บริษัท แอดวานซ์ อินโฟร์ เซอร์วิส จำกัด (มหาชน) | 10.06 |
| บริษัท เบลต้า อีเลคโทรนิคส์ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) | 7.6 |
| บริษัท กัลฟ์ ดีเวลลอปเม้นท์ จำกัด (มหาชน) | 7.11 |
| บริษัท ปตท. จำกัด (มหาชน) | 6.01 |
| บริษัท กรุงเทพดุสิตเวชการ จำกัด (มหาชน) | 5.0 |

ข้อมูลเชิงสถิติ

Maximum Drawdown : -33.49%
Recovering Period : N/A
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน : 0.41 เท่า
Sharpe Ratio : -0.9
Alpha : -1.26%
Beta : 0.97

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

| การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม | |
|------------------------------------|-------|
| อุตสาหกรรม | %NAV |
| พลังงานและสาธารณูปโภค | 18.53 |
| ธนาคาร | 15.98 |
| เทคโนโลยีสารสนเทศและการสื่อสาร | 13.83 |
| พาณิชย์ | 9.9 |
| ชิ้นส่วนอิเล็กทรอนิกส์ | 7.77 |

คำอธิบาย

Maximum Drawdown เพอร์เซ็นต์ผลขาดทุนสูงสุดของกองทุนรวมในระยะเวลา 5 ปีย้อนหลัง (หรือตั้งแต่จัดตั้งกองทุนกรณีที่ยังไม่ครบ 5 ปี) โดยวัดจากระดับ NAV ต่อหน่วยที่จุดสูงสุดไปจนถึงจุดต่ำสุดในช่วงที่ NAV ต่อหน่วยปรับตัวลดลง ค่า Maximum Drawdown เป็นข้อมูลที่ช่วยให้ทราบถึงความเสี่ยงที่อาจจะขาดทุนจากการลงทุนในกองทุนรวม

Recovering Period ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาดังแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลานานเท่าใด

FX Hedging เพอร์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตกองทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลาหนึ่ง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์กับผลรวมของมูลค่าการขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 1 ปีหารด้วยมูลค่า NAV ของกองทุนรวมเฉลี่ยในรอบระยะเวลาเดียวกัน กองทุนรวมที่มีค่า portfolio turnover สูง บ่งชี้ถึงการซื้อขายหลักทรัพย์บ่อยครั้งของผู้จัดการกองทุนและทำให้มีต้นทุนการซื้อขายหลักทรัพย์ที่สูง 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

อายุเฉลี่ยของตราสารหนี้ อายุเฉลี่ยของตราสารหนี้ที่กองทุนลงทุน

Yield to Maturity อัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในตราสารหนี้โดยถือจนครบกำหนดอายุ ซึ่งคำนวณจากดอกเบี้ยที่จะได้รับในอนาคตตลอดอายุตราสารและเงินต้นที่จะได้รับคืนนำมาคิดลดเป็นมูลค่าปัจจุบัน 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/