

ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

ระดับความเสี่ยง

🏠 กองทุนรวมตราสารทุน

🏠 กองทุนรวมเพื่อการเลี้ยงชีพ/กองทุนรวมหน่วยลงทุน (Fund of Funds)

🏠 Global Equity



ลงทุนในตราสารทุนเป็นหลักโดยเฉลี่ยในรอบปีไม่น้อยกว่า 80 % ของ NAV

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

• เน้นลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมตราสารทุนต่างประเทศทั่วโลก ซึ่งจัดตั้งหรือมีผู้ออกหลักทรัพย์อยู่ในต่างประเทศ อย่างน้อย 2 กองทุน ในสัดส่วนกองทุนละไม่เกินร้อยละ 79 ของ NAV โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีรวมกันไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของ NAV

• กองทุนอาจลงทุนในตราสารหนี้ที่มีลักษณะของสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแฝง ตราสารหนี้ที่มีอันดับความน่าเชื่อถือต่ำกว่าที่สามารถลงทุนได้ ตราสารหนี้ที่ไม่ได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือ และตราสารทุนของบริษัทที่ไม่ได้จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ ตามหลักเกณฑ์ที่สำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ต. ประกาศกำหนด

• กองทุนอาจลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเพื่อเป็นการเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน รวมถึงอาจลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่มีตัวแปรเป็นอัตราแลกเปลี่ยนเงิน โดยมีวัตถุประสงค์เพื่อป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศโดยขึ้นอยู่กับดุลยพินิจของผู้จัดการกองทุน ซึ่งพิจารณาจากสภาพของตลาดในขณะนั้น

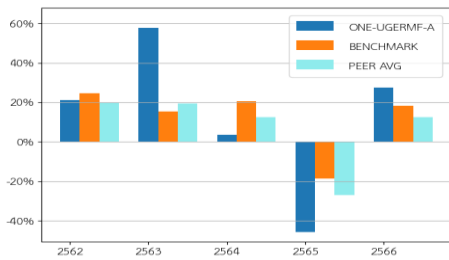
ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน	21 ธันวาคม 2559
วันเริ่มต้น class	21 ธันวาคม 2559
นโยบายการจ่ายเงินปันผล	ไม่จ่าย
อายุกองทุน	ไม่กำหนด

ผู้จัดการกองทุนรวม

นายสุทธิโรจน์ สิทธิพัฒนานนท์	(ตั้งแต่งจดทะเบียน)
นายธัชธรรม วิจารณ์กรม	(ตั้งแต่งจดทะเบียน)

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (% ต่อปี)



ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปีกลุ่ม (% ต่อปี)

	2562	2563	2564	2565	2566
ONE-UGERMF-A	21.05%	57.82%	3.64%	-45.69%	27.44%
BENCHMARK	24.73%	15.43%	20.55%	-18.73%	18.28%
PEER AVG	20.02%	19.5%	12.5%	-26.93%	12.61%

	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี
กองทุน	10.69	3.67	16.88	20.9
ดัชนีชี้วัด	8.46	3.42	13.11	20.77
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	4.01	1.63	8.88	10.48
ความผันผวนกองทุน	18.41	18.44	17.75	19.77
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	10.37	11.2	9.98	10.25

	3 ปี	5 ปี	10 ปี	ตั้งแต่จัดตั้ง
กองทุน	-8.32	7.33	N/A	7.71
ดัชนีชี้วัด	3.96	10.69	8.01	9.45
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	-4.45	7.02	3.27	N/A
ความผันผวนกองทุน	26.24	23.94	N/A	21.45
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	15.36	16.64	14.22	15.15

ดัชนีชี้วัด

ดัชนี FTSE All-World Net Total Return Index USD สัดส่วนร้อยละ 100 โดยปรับด้วยต้นทุนการป้องกันความเสี่ยงอัตราแลกเปลี่ยนเพื่อคำนวณผลตอบแทนเป็นสกุลเงินบาท ณ วันที่ลงทุน ประมาณร้อยละ 85 และปรับด้วยอัตราแลกเปลี่ยนเพื่อเทียบกับค่าสกุลเงินบาท ณ วันที่คำนวณผลตอบแทน ประมาณร้อยละ 15

ค่าธรรมเนียม

🏠 การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช้การฝากเงิน

🏠 ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวมมิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต : ได้รับการรับรอง CAC

ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือ

บริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่อง

ได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



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

**การซื้อขายหน่วยลงทุน**

วันทำการซื้อ : ทุกวันทำการ

เวลาทำการ : 09:00 - 16:00 น.

การซื้อขายครั้งแรกขั้นต่ำ : 1.00 บาท

การซื้อขายครั้งถัดไปขั้นต่ำ : 1.00 บาท

**การขายคืนหน่วยลงทุน**

วันทำการขายคืน : ทุกวันทำการ

เวลาทำการ : 09:00 - 16:00 น.

การขายคืนขั้นต่ำ : ไม่กำหนด

ยอดคงเหลือขั้นต่ำ : 100 หน่วย

ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน : T+4 คือ 4 วันทำการ

หลังจากวันทำการขายคืน

**ข้อมูลเชิงสถิติ**

Maximum Drawdown : -54.8%

Recovering Period : N/A

FX Hedging : 77.99%

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน : 0.001 เท่า

Sharpe Ratio : -0.32

Alpha : -12.28%

Beta : 0.65

**ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)**

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	2.675	2.14
รวมค่าใช้จ่าย	6.42	2.28445

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

หมายเหตุ :

- ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่มภาษีธุรกิจเฉพาะ หรือภาษีอื่นใดแล้ว
- ค่าใช้จ่ายที่กองทุนเรียกเก็บอาจเปลี่ยนแปลงตามความเหมาะสม โดยเก็บในอัตราไม่เกินจากที่ระบุไว้ในโครงการ
- ค่าธรรมเนียมการสับเปลี่ยนหน่วยลงทุน
  - กรณีกองทุนเป็นกองทุนต้นทาง
    - โอนย้ายไปยังกองทุนรวมเพื่อการเลี้ยงชีพอื่นภายใต้การจัดการของบริษัทจัดการอื่น : 1.07% แต่ไม่ต่ำกว่า 200 บาท
    - โอนย้ายไปยังกองทุนรวมเพื่อการเลี้ยงชีพอื่นภายใต้การจัดการของบริษัทจัดการ : ยกเว้นการเรียกเก็บ
  - กรณีกองทุนเป็นกองทุนปลายทาง : เป็นไปตามค่าธรรมเนียมการขายหน่วยลงทุน

**สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน**

ประเภททรัพย์สิน	%NAV
หน่วยลงทุนในต่างประเทศ	99.61
เงินสด และอื่นๆ	0.39

**ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก**

ทรัพย์สิน	%NAV
BAI GIF WW LT GB GR-BUSD ACC	71.59
Baillie Gifford Long Term Global Growth Investment Fund	28.02

**การจัดสรรการลงทุนในต่างประเทศ**

ประเทศ	%NAV
ไอร์แลนด์	71.59
สหราชอาณาจักร	28.02

**การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม**

อุตสาหกรรม	%NAV
หน่วยลงทุน	99.61

ชื่อกองทุน : BAI GIF WW LT GB GR-BUSD ACC

ISIN Code : IE00BYQG5606

Bloomberg Code : BGWLBUA ID EQUITY

ชื่อกองทุน : Baillie Gifford Long Term Global Growth Investment Fund

ISIN Code : GB00BD5Z0Z54

Bloomberg Code : BGGGBNA LN

## คำอธิบาย

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

**Recovering Period** ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาตั้งแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินลงทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลานานเท่าใด

**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 อาคารสยามพิพรรธน์ทาวเวอร์ ชั้น 9, 24 ถนนพระราม 1 แขวงปทุมวัน เขตปทุมวัน

กรุงเทพมหานคร 10330

โทรศัพท์ 0-2659-8888 โทรสาร 0-2659-8860-1

www.one-asset.com/