

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน วรณ จำกัด

กองทุนเปิด วรณ โกลบอล อพพอร์ทูนิตี้ บอนด์ ฟันด์

1 A.M. GLOBAL OPPORTUNITY BOND FUND

1GLOBALBOND

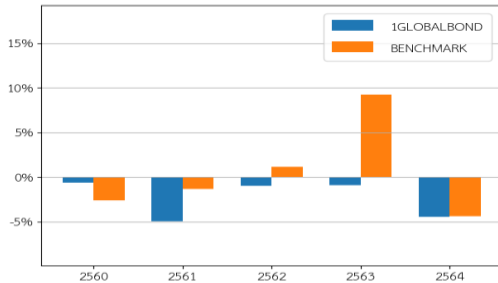
ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- 🏠 กองทุนรวมตราสารหนี้
- 🏠 กองทุนรวมหน่วยลงทุน (Fund of Funds)
- 🏠 Global Bond Discretionary F/X Hedge or Unhedge

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- กองทุนที่มีนโยบายลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมตราสารหนี้ และ/หรือกองทุนรวมอียิปต์ต่างประเทศในภูมิภาคต่างๆ ของโลก
- กองทุนนี้อาจพิจารณาการลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) เพื่อเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน (Efficient Portfolio Management) และเพื่อป้องกันความเสี่ยง (Hedging)
- กองทุนมีกลยุทธ์การลงทุนเพื่อมุ่งหวังให้ผลประกอบการเคลื่อนไหวตามดัชนีชี้วัด และในบางโอกาสอาจสร้างผลตอบแทนสูงกว่าดัชนีชี้วัด

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (% ต่อปี)



	2560	2561	2562	2563	2564
1GLOBALBOND	-0.62%	-4.93%	-0.97%	-0.91%	-4.48%
BENCHMARK	-2.62%	-1.36%	1.16%	9.24%	-4.37%

ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปีกลุ่ม (%) ต่อปี

	YTD	3เดือน	6เดือน	1ปี
กองทุน	-14.08	-7.52	-8.43	-14.68
ดัชนีชี้วัด	-20.46	-8.68	-10.64	-20.97
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	-9.42	-5.53	-9.42	-9.41
ความผันผวนกองทุน	4.13	5.73	4.76	3.94
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	7.69	9.78	8.64	7.25
	3ปี	5ปี	10ปี	ตั้งแต่จัดตั้ง
กองทุน	-6.98	-5.22	-2.98	-0.78
ดัชนีชี้วัด	-6.16	-3.79	-0.77	0.82
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	-1.24	-0.38	-0.19	N/A
ความผันผวนกองทุน	6.3	5.04	4.72	5.05
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	6.47	5.92	5.5	5.88

ระดับความเสี่ยง



เสี่ยงปานกลางค่อนข้างต่ำ

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

ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน	18 กุมภาพันธ์ 2551
วันเริ่มต้น class	18 กุมภาพันธ์ 2551
นโยบายการจ่ายเงินปันผล	ไม่จ่าย
อายุกองทุน	ไม่กำหนด

ผู้จัดการกองทุนรวม

- นายสุทธิโรจน์ สิทธิพัฒนานนท์ (ตั้งแต่ 27 มีนาคม 2555)
- นายสิทธิ์ จ่างตระกูล (ตั้งแต่ 11 มกราคม 2559)

ดัชนีชี้วัด

อัตราผลตอบแทนของ Bloomberg Barclays Global - Aggregate Total Return Index\* ปรับด้วยต้นทุนการป้องกันความเสี่ยงอัตราแลกเปลี่ยนเพื่อคำนวณผลตอบแทนเป็นสกุลเงินบาท ณ วันที่ลงทุน ตามสัดส่วนการทำ hedging ประมาณร้อยละ 95 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน และอัตราผลตอบแทนของ Bloomberg Barclays Global - Aggregate Total Return Index ปรับด้วยอัตราแลกเปลี่ยนเพื่อเทียบกับค่าสกุลเงินบาท ณ วันที่คำนวณผลตอบแทนในส่วนที่เหลือที่ไม่ได้ทำสัญญาป้องกันความเสี่ยงอัตราแลกเปลี่ยน

คำเตือน

- 🏠 การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- 🏠 ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวมมิได้เป็นที่ยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต
- การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต : ได้รับการรับรอง CAC
- จัดอันดับกองทุน Morningstar ★

ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเรื่องมี  
บริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่อง  
ได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



## การซื้อขายหน่วยลงทุน

วันทำการซื้อ : ทุกวันทำการ  
 เวลาทำการ : 09:00 - 16:00 น.  
 การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ : 1,000.0 บาท  
 การซื้อครั้งถัดไปขั้นต่ำ : 1,000.0 บาท

## การขายคืนหน่วยลงทุน

วันทำการขายคืน : ทุกวันทำการ  
 เวลาทำการ : 09:00 - 16:00 น.  
 การขายคืนขั้นต่ำ : ไม่กำหนด  
 ยอดคงเหลือขั้นต่ำ : 100 หน่วย  
 ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน : T+5 คือ 5  
 วันทำการหลังจากวันทำการขายคืน

## ข้อมูลเชิงสถิติ

Maximum Drawdown : -20.73%  
 Recovering Period : 0 ปี 0 เดือน  
 FX Hedging : 90.15%  
 อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน : 0.0  
 Sharpe Ratio : N/A  
 Alpha : N/A  
 Beta : N/A  
 Tracking Error : N/A  
 อายุเฉลี่ยของตราสารหนี้ : 0 ปี 0 เดือน  
 Yield to Maturity : 0.01

หมายเหตุ :

### ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	0.842625	0.8025
รวมค่าใช้จ่าย	4.28	0.939995

หมายเหตุ :

- ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว
- ค่าใช้จ่ายที่กองทุนเรียกเก็บอาจเปลี่ยนแปลงตามความเหมาะสม โดยเก็บในอัตราไม่เกินจากที่ระบุไว้ในหนังสือชี้ชวนเสนอขายหน่วยลงทุน
- สามารถดูข้อมูลค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายย้อนหลัง 3 ปี ของกองทุนในหนังสือชี้ชวนสรุปข้อมูลกองทุนรวม ได้ที่ [www.one-asset.com](http://www.one-asset.com)

### ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การขาย	0.535	ยกเว้น
การรับซื้อคืน	0.535	ยกเว้น
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า	0.535	ยกเว้น
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก	0.535	ยกเว้น
การโอนหน่วยลงทุน	ตามที่นายทะเบียนเรียกเก็บ ตามที่นายทะเบียนเรียกเก็บ	

หมายเหตุ :

- ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว
- ค่าใช้จ่ายที่กองทุนเรียกเก็บอาจเปลี่ยนแปลงตามความเหมาะสม โดยเก็บในอัตราไม่เกินจากที่ระบุไว้ในหนังสือชี้ชวนเสนอขายหน่วยลงทุน

### สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน

Assets	%
หน่วยลงทุนในต่างประเทศ	85.43
เงินฝาก และอื่นๆ	14.57

### ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก

Assets	%
SPDR BBGBCR GLOBAL AGG ETF	34.87
SCHRODER INTL GL CORP BD-CAC	30.74
AMUNDI FLOAT RATE USD CORP	19.83

### การจัดสรรการลงทุนในต่างประเทศ

Country	%
ลักเซมเบิร์ก	50.57
ไอร์แลนด์	34.87

### การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม / ผู้ออกตราสาร 5 อันดับแรก

Sector	%
State Street ETFs/Ireland	34.87
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT S.A. (LUXEMBOURG)	30.74
Amundi ETFs/France	19.83
JPMORGAN CHASE & CO	12.53
THE SIAM COMMERCIAL BANK PUBLIC COMPANY LIMITED	3.1

### การจัดสรรการลงทุนตามอันดับความน่าเชื่อถือ (%)

ในประเทศ	national	international
GOV/AAA/AAA(tha)		
AA/AA(tha)	4.51	
A/A(tha)		12.53
BBB/BBB(tha)		
ต่ำกว่า BBB		
unrated		

การลงทุนในกองทุนอื่นเกินกว่า 20% (กองทุนในประเทศ และหรือกองทุนต่างประเทศ)

ชื่อกองทุน : SPDR BBGBARC GLOBAL AGG ETF

ISIN Code : IE00B43QJ40 Bloomberg Code : GALG LN EQUITY ชื่อกองทุน :

SCHRODER INTL GL CORP BD-CAC

ISIN Code : LU0106258741 Bloomberg Code : SCHHGCA LX Equity

## 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

ซึ่งคำนวณจากดอกเบี้ยที่ได้รับในอนาคตตลอดอายุตราสารและเงินต้นที่จะได้รับคืนนำมาคิดลดเป็นมูลค่าปัจจุบัน โดยใช้วัดอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมตราสารหนี้ คำนวณจากค่าเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักของ

Yield to Maturity ของตราสารหนี้แต่ละตัวที่กองทุนมีการลงทุน และเนื่องจาก Yield to Maturity มีหน่วยมาตรฐานเป็นเปอร์เซ็นต์ต่อปี

จึงสามารถนำไปใช้เปรียบเทียบอัตราผลตอบแทนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีนโยบายถือครองตราสารหนี้จนครบกำหนดอายุและมีลักษณะการลงทุนที่ใกล้เคียงกันได้

บริษัท หลักทรัพย์จัดการกองทุน วรธร 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/