

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน วรณ จำกัด

กองทุนเปิด วรณ โกลบอล อีเมอร์จิง มาร์เก็ต เอควิตี้

ONE GLOBAL EMERGING MARKET EQUITY FUND

ONE-GEM

ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

🏠 กองทุนรวมตราสารทุน

🏠 กองทุนรวมหน่วยลงทุน (Fund of Funds)

🏠 Emerging Market

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

กองทุนมีนโยบายลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมตราสารแห่งทุนที่ลงทุนในประเทศที่เป็นตลาดเกิดใหม่ในภูมิภาคต่างๆ ของโลก (Emerging Markets) ทั้งที่จดทะเบียนในประเทศที่เป็นตลาดเกิดใหม่และที่จดทะเบียนในประเทศที่พัฒนาแล้ว โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน

- กองทุนอาจลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) เพื่อป้องกันความเสี่ยง (Hedging) และเพื่อเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน (Efficient Portfolio Management) และสำหรับการลงทุนในต่างประเทศ กองทุนจะป้องกันความเสี่ยงด้านอัตราแลกเปลี่ยน (Hedging) โดยขึ้นอยู่กับดุลยพินิจของผู้จัดการกองทุน
- กองทุนมีกลยุทธ์การลงทุนเพื่อมุ่งหวังให้ผลประกอบการเคลื่อนไหวตามดัชนีชี้วัด และในบางโอกาสอาจสร้างผลตอบแทนสูงกว่าดัชนีชี้วัด

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (% ต่อปี)



ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปีหมุน (% ต่อปี)

	2562	2563	2564	2565	2566
ONE-GEM	8.88%	21.57%	3.32%	-23.3%	-1.36%
BENCHMARK	10.98%	18.18%	9.49%	-15.32%	8.98%
PEER AVG	14.48%	9.34%	-3.39%	-24.38%	4.34%

	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี
กองทุน	8.92	8.92	6.67	6.71
ดัชนีชี้วัด	6.07	6.07	6.73	12.66
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	2.93	2.93	7.1	4.62
ความผันผวนกองทุน	11.81	11.81	11.96	13.02
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	10.35	10.35	11.11	11.61
	3 ปี	5 ปี	10 ปี	ตั้งแต่จัดตั้ง
กองทุน	-6.81	0.93	0.89	0.35
ดัชนีชี้วัด	-0.07	5.53	4.69	4.83
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	-8.7	-1.74	-0.15	N/A
ความผันผวนกองทุน	11.03	13.0	11.89	16.89
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	11.27	14.06	13.18	17.57

ระดับความเสี่ยง

ต่ำ	1	2	3	4	5	6	7	8	8+	สูง
-----	---	---	---	---	---	---	---	---	----	-----

เสี่ยงสูง

ลงทุนในตราสารทุนเป็นหลักโดยเฉลี่ยในรอบปีไม่น้อยกว่า 80 % ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน 2 ธันวาคม 2548

วันเริ่มต้น class 2 ธันวาคม 2548

นโยบายการจ่ายเงินปันผล จ่าย

อายุกองทุน ไม่กำหนด

ผู้จัดการกองทุนรวม

🏠 นายสุทธิโรจน์ สิทธิพัฒนานนท์ (ตั้งแต่ 27 มีนาคม 2555)

🏠 นายสิทธิ์ จ่างตระกูล (ตั้งแต่ 11 มกราคม 2559)

ดัชนีชี้วัด

ดัชนี FTSE Emerging inc Korea Net Total Return Index USD สัดส่วนร้อยละ 100 โดยปรับด้วยต้นทุนการป้องกันความเสี่ยงอัตราแลกเปลี่ยนเพื่อคำนวณผลตอบแทนเป็นสกุลเงินบาท ณ วันที่ลงทุน ประมาณร้อยละ 85 และปรับด้วยอัตราแลกเปลี่ยนเพื่อเทียบกับค่าสกุลเงินบาท ณ วันที่คำนวณผลตอบแทน ประมาณร้อยละ 15

ค่าเตือน

🏠 การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน

🏠 ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวมมิได้เป็นสิ่งยืนยันถึง

ผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต : ได้รับการรับรอง CAC

จัดอันดับกองทุน Morningstar ★★★★★

ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือ

บริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่อง

ได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



www.one-asset.com

การซื้อขายหน่วยลงทุน

วันทำการซื้อ : ทุกวันทำการ
เวลาทำการ :09:00 - 16:00 น.
การซื้อขายครั้งแรกขั้นต่ำ : 5,000.00 บาท
การซื้อขายครั้งถัดไปขั้นต่ำ : 5,000.00 บาท

การขายคืนหน่วยลงทุน

วันทำการขายคืน : ทุกวันทำการ
เวลาทำการ :09:00 - 16:00 น.
การขายคืนขั้นต่ำ : ไม่กำหนด
ยอดคงเหลือขั้นต่ำ : 100 หน่วย
ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน : T+5 คือ5 วันทำการ
หลังจากวันทำการขายคืน

ข้อมูลเชิงสถิติ

Maximum Drawdown : -31.79%
Recovering Period : N/A
FX Hedging : N/A
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน : N/A
Sharpe Ratio : -0.53
Alpha : -6.74%
Beta : 0.89

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	1.68525	1.07
รวมค่าใช้จ่าย	6.42	1.217125

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

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การขาย	1.07	1.07
การรับซื้อคืน	1.07	0.2675
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า	1.07	1.07
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก	1.07	0.2675
การโอนหน่วยลงทุน	ตามที่นายทะเบียนเรียกเก็บ	ตามที่นายทะเบียนเรียกเก็บ

- หมายเหตุ :
- 1.ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่มภาษีธุรกิจเฉพาะ หรือภาษีอื่นใดแล้ว
 - 2.ค่าใช้จ่ายที่กองทุนเรียกเก็บอาจเปลี่ยนแปลงตามความเหมาะสม โดยเก็บในอัตราไม่เกินจากที่ระบุไว้ในโครงการ

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน		ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก	
ประเภททรัพย์สิน	%NAV	ทรัพย์สิน	%NAV
หน่วยลงทุนในต่างประเทศ	95.99	GS EMRG MARKET EQTY IA (GSEMEIA LX EQUITY)	57.43
เงินฝาก และอื่นๆ	4.01	ISHARES MSCI EMERGING MARKET (US4642872349)	31.11
		i SHARES MSCI EM LATIN AMERICA UCITS ETF (IE00B27YCK28)	2.81
		UBS EQ-ALL CHINA USD-IA1 ACC (UBAIA1A LX EQUITY)	2.34
		SISF ALL CHINA EQUITY-C USD (SCHACEC LX Equity)	2.29

การจัดสรรการลงทุนในต่างประเทศ	
ประเทศ	%NAV
ลักเซมเบิร์ก	62.07
สหรัฐอเมริกา	31.11
ไอร์แลนด์	2.81

การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม	
อุตสาหกรรม	%NAV
หน่วยลงทุน	95.99

ชื่อกองทุน : GS EMRG MARKET EQTY IA

ISIN Code : LU0234572450

Bloomberg Code : GSEMEIA LX EQUITY

ชื่อกองทุน : ISHARES MSCI EMERGING MARKET

ISIN Code : US4642872349

Bloomberg Code : EEM US

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

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/