บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน วรรณ จำกัด

กองทุนเปิด วรรณ ตราสารหนี้ต่างประเทศ

ONE-FFI

ONE FOREIGN FIXED INCOME FUND

ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมตราสารหนี้
- Miscellaneous

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

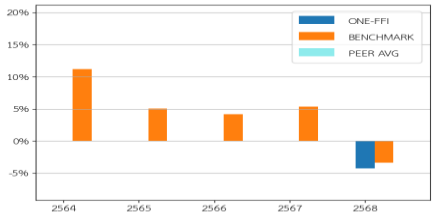
• กองทุนมีนโยบายลงทุนในตราสารหนี้ที่เสนอขายในต่างประเทศ โดยจะลงทุนในตราสารหนี้ภาครัฐ และ/หรือ รัฐวิสาหกิจ และ/หรือตราสารหนี้ภาคเอกชน รวมถึงตราสารหนี้อื่นใดที่เสนอขายในต่างประเทศ และ/หรือเงินฝาก หรือตราสารเทียบเท่าเงินฝากต่างประเทศ ไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน

• กองทุนอาจลงทุนในตราสารหนี้ที่มีอันดับความน่าเชื่อถือต่ำกว่าอันดับที่สามารถลงทุนได้ (Non-Investment Grade) และ/หรือที่ไม่ได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือ (Unrated) รวมกันไม่เกินร้อยละ 20 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน

• กองทุนอาจลงทุนในตราสารที่มีสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแฝง (Structured Note) รวมทั้งกองทุนอาจลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) เพื่อป้องกันความเสี่ยง (Hedging) และเพื่อเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน (Efficient Portfolio Management) และสำหรับการลงทุนในต่างประเทศ กองทุนจะป้องกันความเสี่ยงด้านอัตราแลกเปลี่ยน (Hedging) โดยขึ้นอยู่กับดุลยพินิจของผู้จัดการกองทุน

• กองทุนมีกลยุทธ์การลงทุนเพื่อมุ่งหวังให้ผลประกอบการเคลื่อนไหวสูงกว่าดัชนีชี้วัด (active management) โดยมีการบริหารจัดการในเชิงรุก ซึ่งมีวัตถุประสงค์ที่จะอ้างอิงดัชนีชี้วัดเพื่อเปรียบเทียบกับผลการดำเนินงานของกองทุนรวม (Performance Objective) ทั้งนี้ กองทุนอาจเลือกลงทุนในตราสารที่มีอายุแตกต่างกันตามสถานการณ์และจังหวะการลงทุน

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (% ต่อปี)



	2564	2565	2566	2567	2568
ONE-FFI	N/A	N/A	N/A	N/A	-4.25%
BENCHMARK	11.17%	5.03%	4.13%	5.36%	-3.41%
PEER AVG	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A

ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด (%)

	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี*
กองทุน	8.7	1.63	3.43	6.77
ดัชนีชี้วัด	9.55	1.94	3.95	7.78
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	N/A	N/A	N/A	N/A
ความผันผวนกองทุน	7.84	6.11	6.97	7.36
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	7.86	6.13	7.0	7.37

	3 ปี*	5 ปี*	10 ปี*	ตั้งแต่จัดตั้ง*
กองทุน	N/A	N/A	N/A	3.65
ดัชนีชี้วัด	1.92	3.73	2.22	4.81
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	N/A	N/A	N/A	N/A
ความผันผวนกองทุน	N/A	N/A	N/A	7.75
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	8.06	8.38	6.81	7.77

* หมายเหตุ: % ต่อปี

ระดับความเสี่ยง

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

เสี่ยงปานกลางค่อนข้างต่ำ

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

ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน	18 กันยายน 2567
วันเริ่มต้น class	18 กันยายน 2567
นโยบายการจ่ายเงินปันผล	ไม่จ่าย
อายุกองทุน	ไม่กำหนด
การป้องกันความเสี่ยง	ตามดุลพินิจของผู้จัดการกองทุน (dynamic hedging)

ผู้จัดการกองทุนรวม

นายธัชธรรม วิจารณกรณ์	(ตั้งแต่จดทะเบียน)
นายสิทธิ์ จ่างตระกูล	(ตั้งแต่จดทะเบียน)

ดัชนีชี้วัด

ดัชนี FTSE 6 Month US T-Bill Index USD สัดส่วนร้อยละ 100 โดยปรับด้วยอัตราแลกเปลี่ยนเพื่อเทียบกับค่าสกุลเงินบาท ณ วันที่คำนวณผลตอบแทน

คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวมมิได้เป็นสิ่งยืนยันถึง ผลการดำเนินงานในอนาคต
- กองทุนที่ไม่เหมาะสมกับผู้ลงทุนที่ต้องการผลตอบแทนอย่างสม่ำเสมอหรือต้องการรักษาเงินต้น ผู้ลงทุนโปรดศึกษาและลงทุนให้เหมาะกับระดับความเสี่ยงที่ยอมรับได้

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต : ได้รับการรับรอง CAC

ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือบริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่องได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

www.one-asset.com

การซื้อหน่วยลงทุน

วันทำการซื้อ : ทุกวันทำการ
เวลาทำการ : 09:00 - 15:30 น.
การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ : 1,000.00 บาท
การซื้อครั้งถัดไปขั้นต่ำ : ไม่กำหนด

การขายคืนหน่วยลงทุน

วันทำการขายคืน : ทุกวันทำการ
เวลาทำการ : 09:00 - 15:30 น.
การขายคืนขั้นต่ำ : ไม่กำหนด
ยอดคงเหลือขั้นต่ำ : 100 หน่วย
ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน : T+2 คือ2 วันทำการหลังจากวันทำรายการขายคืน

ข้อมูลเชิงสถิติ

Maximum Drawdown : -8.69%
Recovering Period : 6 เดือน
FX Hedging : N/A
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน : 0.87 เท่า
อายุเฉลี่ยของตราสารหนี้ : 7 เดือน 24 วัน
Yield to Maturity : 4.13% ต่อปี

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	2.14	0.25
กองทุนรวม (trailer fee) : มี		
รวมค่าใช้จ่าย	4.50	0.38589

หมายเหตุ :
ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะ หรือภาษีอื่นใดแล้ว

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การขาย	2.14	0.25
การรับซื้อคืน	2.14	ยกเว้น
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า	2.14	0.25
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก	2.14	ยกเว้น
การโอนหน่วยลงทุน	ตามที่นายทะเบียนเรียกเก็บ	ตามที่นายทะเบียนเรียกเก็บ

หมายเหตุ :
ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะ หรือภาษีอื่นใดแล้ว

การจัดสรรการลงทุนในต่างประเทศ

ประเทศ	%NAV
สหรัฐอเมริกา	99.41

การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม

อุตสาหกรรม	%NAV
รัฐบาล	99.41
ธนาคาร	0.15

การจัดสรรการลงทุนตามอันดับความน่าเชื่อถือ (%NAV)

	ในประเทศ	national	international
GOV/AAA/AAA(tha)			99.41
AA/AA(tha)		0.48	
A/A(tha)			0.15
BBB/BBB(tha)			
ต่ำกว่า BBB			
unrated			

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน

ประเภททรัพย์สิน	%NAV
ตราสารหนี้ต่างประเทศ	99.41
เงินฝาก และอื่นๆ	0.59

ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก

ทรัพย์สิน	%NAV
TREASURY BILL	99.41

คำอธิบาย

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

Recovering Period ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาตั้งแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลานานเท่าใด

FX Hedging เปอร์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตกองทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลาหนึ่ง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อหลักทรัพย์กับผลรวมของมูลค่าการขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 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

อายุเฉลี่ยของตราสารหนี้ อายุเฉลี่ยของตราสารหนี้ที่กองทุนลงทุน

Yield to Maturity อัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในตราสารหนี้โดยถือจนครบกำหนดอายุ ซึ่งคำนวณจากดอกเบี้ยที่จะได้รับในอนาคตตลอดอายุตราสารและเงินต้นที่จะได้รับคืนนำมาคิดลดเป็นมูลค่าปัจจุบัน โดยใช้วัดอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมตราสารหนี้ คำนวณจากค่าเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักของ Yield to Maturity ของตราสารหนี้แต่ละตัวที่กองทุนมีการลงทุน และเนื่องจาก Yield to Maturity มีหน่วยมาตรฐานเป็นเปอร์เซ็นต์ต่อปี จึงสามารถนำไปใช้เปรียบเทียบอัตราผลตอบแทนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีนโยบายถือครองตราสารหนี้จนครบกำหนดอายุและมีลักษณะการลงทุนที่ใกล้เคียงกันได้

บริษัท หลักทรัพย์จัดการกองทุน วรรณ 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/