



กองทุนเปิด วรรณ หุ้นไทยเพื่อความยั่งยืนแบบพิเศษ ONE EQUITY THAILAND ESG EXTRA FUND

ชนิดเงินลงทุนเดิม
ONE-THAIESGX-L

ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- ประเภทกองทุนรวม : กองทุนรวมตราสารทุน, กองทุนรวมไทยเพื่อความยั่งยืนแบบพิเศษ, กองทุนรวมที่มีนโยบายเปิดให้มีการลงทุนในกองทุนรวมอื่นภายใต้ บลจ. เดียวกัน
- กลุ่มกองทุนรวม : Equity General

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- กองทุนมีนโยบายลงทุนโดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV ในหุ้นที่เป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET) บนกระดานหลัก หรือ กระดานเอ็ม เอ ไอ (mai) ที่มีลักษณะอย่างใดอย่างหนึ่งหรือหลายอย่างดังนี้
 - 1) ได้รับการคัดเลือกจากตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยว่ามีความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน (Environmental, Social and Governance: ESG)
 - 2) มีการเปิดเผยข้อมูลการปล่อยก๊าซเรือนกระจก แผนการจัดการ และการตั้งเป้าหมายเพื่อให้บรรลุเป้าหมายในการลดปริมาณการปล่อยก๊าซเรือนกระจกของประเทศไทย รวมทั้งจัดทำมีการทวนสอบการวัดค่าคาร์บอนฟุตพริ้นท์โดยผู้ทวนสอบที่สำนักงาน ก.ล.ต. ยอมรับ
 - 3) มีบรรษัทภิบาล (governance: G) ในระดับดีเลิศ ซึ่งต้องได้รับ CGR ซึ่งจัดทำโดย IOD ตั้งแต่ 90 คะแนนเป็นต้นไป และมีการเปิดเผยเป้าหมายและแผนการเพิ่มมูลค่าบริษัท (corporate value up plan) และการยกระดับการดำเนินงานด้านสิ่งแวดล้อม และมีการรายงานความคืบหน้าการดำเนินการตามแผน
- กองทุนอาจลงทุนในทรัพย์สินดังต่อไปนี้ โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่เกิน 20% ของ NAV และไม่ทำให้กองทุนมีฐานะการลงทุนสุทธิ (Net exposure) ในหุ้นตามลักษณะที่กล่าวข้างต้นโดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีน้อยกว่า 80% ของ NAV
 - กองทุนรวมอื่นซึ่งอยู่ภายใต้การบริหารของบริหารจัดการ โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่เกิน 20% ของ NAV และกองทุนรวมอื่นนั้นมีการลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งหน่วยลงทุนของกองทุนรวมใด ๆ ที่บริหารจัดการเดียวกันเป็นผู้รับผิดชอบในการดำเนินการต่อไปได้อีกไม่เกิน 1 กอด ทั้งนี้ กองทุนปลายทางไม่สามารถลงทุนย้อนกลับในกองทุนต้นทางได้
 - ตราสารที่มีสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแฝง (Structured Note) รวมทั้งสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) เพื่อป้องกันความเสี่ยง (Hedging) และเพื่อเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน (Efficient Portfolio Management)
- กองทุนมีกลยุทธ์การลงทุนเพื่อมุ่งหวังให้ผลตอบแทนการเคลื่อนไหวสูงกว่าดัชนีชี้วัด (active management)

หมายเหตุ: สามารถดูรายละเอียดนโยบายการลงทุนเพิ่มเติมได้ที่หน้า 3

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (% ต่อปี)

ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปีกลุ่ม (% ต่อปี)

	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี
กองทุน				
ดัชนีชี้วัด				
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน				
ความผันผวนกองทุน				
ความผันผวนดัชนีชี้วัด				
	3 ปี	5 ปี	10 ปี	ตั้งแต่จัดตั้ง

กองทุน
ดัชนีชี้วัด
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน
ความผันผวนกองทุน
ความผันผวนดัชนีชี้วัด

ระดับความเสี่ยง

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

เสี่ยงสูง

กองทุนลงทุนในตราสารทุนในประเทศ
โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน : 9 พ.ค. 2568 (อาจเปลี่ยนแปลงได้)
วันเริ่มต้น class : 9 พ.ค. 2568 (อาจเปลี่ยนแปลงได้)
นโยบายการจ่ายเงินปันผล : ไม่จ่าย
อายุกองทุน : ไม่กำหนด

ผู้จัดการกองทุนรวม

นายชัยพฤกษ์ ฤทธิกุลานารส (ตั้งแต่วันที่ 28 เมษายน 2568)
นายบัญชา จิรวินิจกิจ (ตั้งแต่วันที่ 28 เมษายน 2568)

ดัชนีชี้วัด

ดัชนีผลตอบแทน SET ESG (SETESG TRI)
สัดส่วน 100%

โดยเป็นดัชนีที่วัดผลตอบแทนโดยรวมซึ่งสะท้อนการเคลื่อนไหวราคาของกลุ่มหลักทรัพย์ของบริษัทย่อยที่มีการดำเนินธุรกิจอย่างยั่งยืน โดยคำนึงถึงปัจจัยด้านสิ่งแวดล้อม สังคม และบรรษัทภิบาล (ESG) ทั้งนี้ สามารถดูข้อมูลของดัชนีชี้วัดได้ที่ <https://www.set.or.th/th/market/index/setesg/profile>

กองทุนมีการบริหารจัดการในเชิงรุก ซึ่งมีวัตถุประสงค์ที่จะอ้างอิงดัชนีชี้วัดเพื่อเปรียบเทียบกับผลการดำเนินงานของกองทุนรวม (Performance Objective)

คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวมไม่ได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต : ได้รับการรับรอง CAC
จัดอันดับกองทุน Morningstar:

ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือ
บริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่อง
ได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



www.one-asset.com

การซื้อขายหน่วยลงทุน

วันทำการซื้อ : 13 พ.ค. – 30 มิ.ย. 2568
เวลาทำการ : 9:00 – 15.30 น.
มูลค่าขั้นต่ำการซื้อครั้งแรก : ไม่กำหนด
มูลค่าขั้นต่ำการซื้อครั้งถัดมา : ไม่กำหนด

การขายคืนหน่วยลงทุน

วันทำการขายคืน : ทุกวันทำการ
เวลาทำการ : 9:00 – 15.30 น.
มูลค่าขั้นต่ำการขายคืน : ไม่กำหนด
ยอดคงเหลือขั้นต่ำ : ไม่กำหนด
ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน : T + 3
(3 วันทำการนับแต่วันขายคืน)

ข้อมูลเชิงสถิติ

Maximum Drawdown : ***
Recovering Period : ***
อัตราส่วนเบี่ยงเบนการลงทุน : ***
Sharpe Ratio : ***
Alpha : ***
Beta : ***

หมายเหตุ : บริษัทจัดการจะรับชำระค่าซื้อหน่วยลงทุนเป็นหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินอื่นแทนเงิน ในกรณีที่ผู้ถือหน่วยลงทุนทำการสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนมาจากกองทุนรวมหุ้นระยะยาวเพื่อรับสิทธิประโยชน์ทางภาษี

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	2.5000	1.0700
รวมค่าใช้จ่าย	5.1000	2.1614

หมายเหตุ :

- ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะ หรือภาษีอื่นใดแล้ว
- ค่าใช้จ่ายที่กองทุนเรียกเก็บอาจเปลี่ยนแปลงตามความเหมาะสม โดยเก็บในอัตราไม่เกินจากที่ระบุไว้ในโครงการ
- สามารถดูข้อมูลค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายย้อนหลัง 3 ปี ของกองทุนในหนังสือชี้ชวนส่วนข้อมูลกองทุนรวม ได้ที่ www.one-asset.com
- กรณีกองทุนลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมอื่นซึ่งอยู่ภายใต้การบริหารจัดการของบริษัทจัดการเดียวกัน (กองทุนปลายทาง) บริษัทจัดการจะไม่คิดค่าธรรมเนียมการจัดการซ้ำซ้อนกับกองทุนปลายทาง รวมถึงกรณีที่กองทุนปลายทางอาจลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมใด ๆ ของบริษัทจัดการอีกทอดหนึ่ง บริษัทจัดการจะไม่เรียกเก็บค่าธรรมเนียมดังกล่าวซ้ำซ้อนเช่นกัน

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การขาย	2.14	ยกเว้น
การรับซื้อคืน	2.14	ยกเว้น
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า	2.14	รายละเอียดตามที่ระบุในหมายเหตุ
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก	2.14	รายละเอียดตามที่ระบุในหมายเหตุ
การโอนหน่วยลงทุน	ตามที่นายทะเบียนเรียกเก็บ	ตามที่นายทะเบียนเรียกเก็บ
ค่าใช้จ่ายอื่นๆ	ตามที่จ่ายจริง	ตามที่จ่ายจริง

หมายเหตุ :

- ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะ หรือภาษีอื่นใดแล้ว
- ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วยลงทุนอาจเปลี่ยนแปลงตามความเหมาะสม โดยเก็บในอัตราไม่เกินจากที่ระบุไว้ในโครงการ
- กรณีกองทุนลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมอื่นซึ่งอยู่ภายใต้การบริหารจัดการของบริษัทจัดการเดียวกัน (กองทุนปลายทาง) บริษัทจัดการจะไม่คิดค่าธรรมเนียมการขายและรับซื้อคืนหน่วยลงทุนซ้ำซ้อนกับกองทุนปลายทาง รวมถึงกรณีที่กองทุนปลายทางอาจลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมใด ๆ ของบริษัทจัดการอีกทอดหนึ่ง บริษัทจัดการจะไม่เรียกเก็บค่าธรรมเนียมดังกล่าวซ้ำซ้อนเช่นกัน
- ค่าธรรมเนียมการสับเปลี่ยนหน่วยลงทุน จะเรียกเก็บในอัตราดังต่อไปนี้

กรณีกองทุนเป็นกองทุนต้นทาง

- สับเปลี่ยนไปยังกองทุนรวมไทยเพื่อความยั่งยืนแบบพิเศษภายใต้การจัดการของบริษัทจัดการอื่น: 2.14% แต่ไม่ต่ำกว่า 200 บาท
- สับเปลี่ยนไปยังกองทุนรวมไทยเพื่อความยั่งยืนแบบพิเศษภายใต้การจัดการของบริษัทจัดการ: ยกเว้น

กรณีกองทุนเป็นกองทุนปลายทาง: เป็นไปตามค่าธรรมเนียมการขายหน่วยลงทุน

ประเภททรัพย์สินที่ลงทุน

ประเภททรัพย์สิน	%NAV

ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก

ทรัพย์สิน	%NAV

การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม

ผู้ออกตราสาร	%NAV

นโยบายการลงทุนเพิ่มเติม

1) วัตถุประสงค์การลงทุนที่เกี่ยวกับความยั่งยืน

กองทุนจะลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งหุ้นของบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยและ/หรือตลาดหลักทรัพย์เอ็ม เอ ไอ (บริษัทจดทะเบียน) โดยจะเน้นลงทุนในบริษัทจดทะเบียนที่ 1) มีความโดดเด่นในการบริหารจัดการสิ่งแวดล้อม สังคม และธรรมาภิบาล (ESG) ซึ่งผ่านกระบวนการวิเคราะห์การลงทุนแบบ ESG Integration และ/หรือ 2) มีการเปิดเผยข้อมูลเกี่ยวกับการปล่อยก๊าซเรือนกระจก แผนการจัดการ และการตั้งเป้าหมายเพื่อให้บรรลุเป้าหมายในการลดปริมาณการปล่อยก๊าซเรือนกระจกของประเทศไทย รวมทั้งจัดให้มีการทวนสอบการจัดทำคาร์บอนฟุตพริ้นท์โดยผู้ทวนสอบที่สำนักงาน ก.ล.ต. ยอมรับ และ/หรือ 3) มีธรรมาภิบาล (Governance) โดยได้รับการประเมินการกำกับดูแลกิจการบริษัทจดทะเบียน (Corporate Governance Report of Thai Listed Companies: CGR) จากสมาคมส่งเสริมสถาบันกรรมการบริษัทไทย ตั้งแต่ 90 คะแนนขึ้นไป หรือเทียบเท่า และมีการเปิดเผยเป้าหมายและแผนธุรกิจที่เกี่ยวข้องกับการเพิ่มมูลค่าของกิจการ (cooperate value up plan) และแผนการยกระดับการดำเนินงานด้านความยั่งยืนตามมาตรฐานสากลหรือการดำเนินการเพื่อลดปริมาณการปล่อยก๊าซเรือนกระจกของประเทศไทย และรายงานความคืบหน้าการปฏิบัติตามเป้าหมายหรือแผน ผ่านช่องทางของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย ซึ่งจัดไว้สำหรับการเปิดเผยข้อมูลดังกล่าวโดยเฉพาะ รวมทั้งมีการเพิ่มประสิทธิภาพการสื่อสารกับผู้ลงทุน ตามที่ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยกำหนด โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV

2) เป้าหมายด้านความยั่งยืน

กองทุนจะเน้นลงทุนในบริษัทจดทะเบียน ที่มีความโดดเด่นในการบริหารจัดการสิ่งแวดล้อม สังคม และธรรมาภิบาล (ESG) และ/หรือมีการเปิดเผยข้อมูลเกี่ยวกับการปล่อยก๊าซเรือนกระจก แผนการจัดการ และการตั้งเป้าหมายเพื่อให้บรรลุเป้าหมายในการลดปริมาณการปล่อยก๊าซเรือนกระจกของประเทศไทย และ/หรือมีธรรมาภิบาล (Governance) โดยได้รับการประเมินการกำกับดูแลกิจการบริษัทจดทะเบียน (Corporate Governance Report of Thai Listed Companies: CGR) จากสมาคมส่งเสริมสถาบันกรรมการบริษัทไทย ตั้งแต่ 90 คะแนนขึ้นไป หรือเทียบเท่า และมีการเปิดเผยเป้าหมายและแผนธุรกิจที่เกี่ยวข้องกับการเพิ่มมูลค่าของกิจการ (cooperate value up plan) และแผนการยกระดับการดำเนินงานด้านความยั่งยืนตามมาตรฐานสากลหรือการดำเนินการเพื่อลดปริมาณการปล่อยก๊าซเรือนกระจกของประเทศไทย เพื่อสร้างผลตอบแทนที่ยั่งยืนให้กับผู้ถือหุ้นรายย่อย รวมทั้งเป็นการส่งเสริมให้กิจกรรมที่มุ่งเน้นการดำเนินงานที่คำนึงถึงปัจจัยด้าน ESG ให้มากขึ้น ส่งผลให้เกิดระบบนิเวศที่ยั่งยืนต่อระบบเศรษฐกิจไทย และเป็นกลไกหนึ่งที่จะช่วยสนับสนุนบริษัทจดทะเบียน และประเทศไทยให้บรรลุเป้าหมายการพัฒนาที่ยั่งยืน (Sustainable Development Goals : SDGs) ขององค์การสหประชาชาติ

3) กรอบการลงทุน

กองทุนจะลงทุนในหุ้นของบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยและ/หรือตลาดหลักทรัพย์เอ็ม เอ ไอ โดยจะเน้นลงทุนในบริษัทจดทะเบียนที่มีความโดดเด่นในการบริหารจัดการสิ่งแวดล้อม สังคม และธรรมาภิบาล (ESG) ที่ผ่านเกณฑ์การคัดเลือกของ SET ESG Ratings ในระดับ A ขึ้นไป โดยจะพิจารณาผนวกปัจจัยด้าน ESG ในกระบวนการตัดสินใจลงทุน (ESG Integration) และ/หรือมีการเปิดเผยข้อมูลเกี่ยวกับการปล่อยก๊าซเรือนกระจก แผนการจัดการ และการตั้งเป้าหมายเพื่อให้บรรลุเป้าหมายในการลดปริมาณการปล่อยก๊าซเรือนกระจกของประเทศไทย และ/หรือมีธรรมาภิบาล (Governance) โดยได้รับการประเมินการกำกับดูแลกิจการบริษัทจดทะเบียน (Corporate Governance Report of Thai Listed Companies: CGR) จากสมาคมส่งเสริมสถาบันกรรมการบริษัทไทย ตั้งแต่ 90 คะแนนขึ้นไป หรือเทียบเท่า และมีการเปิดเผยเป้าหมายและแผนธุรกิจที่เกี่ยวข้องกับการเพิ่มมูลค่าของกิจการ (cooperate value up plan) และแผนการยกระดับการดำเนินงานด้านความยั่งยืนตามมาตรฐานสากลหรือการดำเนินการเพื่อลดปริมาณการปล่อยก๊าซเรือนกระจกของประเทศไทย

4) การอ้างอิงดัชนีชี้วัดที่เกี่ยวกับความยั่งยืน

ดัชนีชี้วัดของกองทุน คือ ดัชนีผลตอบแทนรวม SET ESG (SETESG TRI) ในสัดส่วนร้อยละ 100 โดยเป็นดัชนีที่สะท้อนการเคลื่อนไหวราคาของกลุ่มหลักทรัพย์ของบริษัทจดทะเบียนที่มีการดำเนินธุรกิจอย่างยั่งยืน โดยคำนึงถึงปัจจัยด้านสิ่งแวดล้อม สังคม และธรรมาภิบาล (ESG) ซึ่งมีขนาดและสภาพคล่องผ่านตามเกณฑ์ที่ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยกำหนด และเป็นดัชนีที่คำนวณจากผลตอบแทนทุกประเภทของการลงทุนในหลักทรัพย์ดังกล่าว (การวัดผลตอบแทนโดยรวม)

ดัชนีดังกล่าวมีแนวทางการคัดเลือกหุ้นเพื่อเป็นองค์ประกอบของดัชนี ดังนี้

- เป็นบริษัทที่อยู่ในผลประเมินหุ้นยั่งยืน SET ESG Ratings ที่ประกาศล่าสุด ก่อนรอบการทบทวนรายชื่อหลักทรัพย์ในดัชนี
- เป็นหลักทรัพย์ที่มีมูลค่าหลักทรัพย์ตามราคาตลาด (Market capitalization) ไม่น้อยกว่า 5,000 ล้านบาท
- มีสัดส่วนผู้ถือหุ้นหลักน้อยรายย่อย (Free-float) ไม่น้อยกว่าร้อยละ 20 ของทุนชำระแล้ว
- จำนวนหุ้นซื้อขายไม่น้อยกว่าร้อยละ 0.5 ของจำนวนหุ้นจดทะเบียนของบริษัท เป็นเวลาไม่ต่ำกว่า 9 ใน 12 เดือน
- ไม่จำกัดจำนวนหลักทรัพย์ในดัชนี

นอกจากนี้ ผู้ลงทุนสามารถศึกษาวิธีการทำดัชนี (Index methodologies) ได้ที่ <https://www.set.or.th/th/market/index/setesg/profile> แหล่งข้อมูล: www.set.or.th

บริษัทจัดการขอสงวนสิทธิ์ที่จะเปลี่ยนแปลงตัวชี้วัดในการเปรียบเทียบตามที่บริษัทจัดการเห็นควรและเหมาะสม ซึ่งอยู่ภายใต้กรอบนโยบายการลงทุนที่กำหนด ทั้งนี้ บริษัทจัดการจะเปลี่ยนตัวชี้วัดข้างต้นที่จัดทำโดยตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เมื่อตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยมีการจัดทำดัชนีผลตอบแทนรวม (TRI) ที่นำสัดส่วนผู้ถือหุ้นหลักน้อยรายย่อยของแต่ละหลักทรัพย์มาถ่วงน้ำหนักในการคำนวณดัชนี เพื่อให้เป็นไปตามประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน โดยบริษัทจัดการจะเปิดเผยข้อมูลและแจ้งให้ผู้ลงทุนทราบล่วงหน้าอย่างชัดเจนถึงวันที่มีการเปลี่ยนตัวชี้วัด คำอธิบายเกี่ยวกับตัวชี้วัด และเหตุผลในการเปลี่ยนตัวชี้วัดดังกล่าวผ่านการลงประกาศในเว็บไซต์ของบริษัทจัดการ ภายในเวลาที่ผู้ลงทุนสามารถใช้ประโยชน์จากข้อมูลในการตัดสินใจลงทุนได้

อย่างไรก็ตาม ในกรณีที่มีการเปลี่ยนแปลงตัวชี้วัดเพื่อให้เป็นไปตามประกาศ เจโอไอ และข้อกำหนดของสมาคมบริษัทจัดการลงทุน และ/หรือประกาศหรือข้อกำหนดของสำนักงาน ก.ล.ต. เกี่ยวกับมาตรฐานการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวม และ/หรือการเปลี่ยนแปลงตัวชี้วัดในการใช้เปรียบเทียบในกรณีที่ผู้ออกตัวชี้วัดของตัวชี้วัดไม่ได้จัดทำหรือเปิดเผยข้อมูล/อัตราดังกล่าวอีกต่อไป บริษัทจัดการจะแจ้งการเปลี่ยนแปลงดังกล่าวให้ผู้ถือหุ้นรายย่อยทราบล่วงหน้าผ่านการประกาศในเว็บไซต์ของบริษัทจัดการ ภายในเวลาที่ผู้ลงทุนสามารถใช้ประโยชน์จากข้อมูลในการตัดสินใจลงทุนได้

คำอธิบาย

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

Recovering Period ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาตั้งแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินลงทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลาสั้นเท่าใด

FX Hedging เพอร์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลานึง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์กับผลรวมของมูลค่าการขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 1 ปี หารด้วยมูลค่า 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 สูงกว่า จะเป็นกองทุนที่มีประสิทธิภาพในการบริหารจัดการลงทุนที่ดีกว่า เนื่องจากได้รับผลตอบแทนส่วนเพิ่มที่สูงกว่าภายใต้ระดับความเสี่ยงเดียวกัน

Alpha ผลตอบแทนส่วนเกินของกองทุนรวมเมื่อเปรียบเทียบกับดัชนีชี้วัด (benchmark) โดยค่า Alpha ที่สูง หมายถึง กองทุนสามารถสร้างผลตอบแทนได้สูงกว่าดัชนีชี้วัด ซึ่งเป็นผลจากประสิทธิภาพของผู้จัดการกองทุนในการคัดเลือกหรือหาจังหวะเข้าลงทุนในหลักทรัพย์ได้อย่างเหมาะสม

Beta ระดับและทิศทางของการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุน โดยเปรียบเทียบกับอัตราการเปลี่ยนแปลงของตลาด Beta น้อยกว่า 1 แสดงว่าหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนน้อยกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด Beta มากกว่า 1 แสดงว่า หลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนมากกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด

Tracking Error อัตราผลตอบแทนของกองทุนมีประสิทธิภาพในการเลียนแบบดัชนีชี้วัด 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

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน วรธน 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