

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน วรณ จำกัด

กองทุนเปิด วรณ ยูโรเปียน อีควิตี้

ONE EUROPEAN EQUITY FUND

ONE-EUROEQ

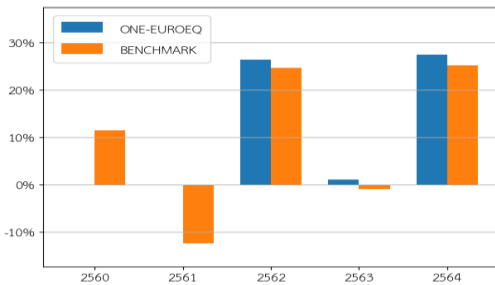
ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- 🏠 กองทุนรวมตราสารทุน
- 🏠 กองทุนรวมฟิเดเดอรั
- 🏠 European Equity

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- กองทุนที่มีนโยบายลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุน Eleva European Selection Fund Class I (EUR) acc (กองทุนหลัก) โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน
- กองทุนหลักมีนโยบายลงทุนในบริษัทที่พิจารณาแล้วเห็นว่ามีแนวโน้มการเติบโตในระดับที่น่าสนใจใน ช่วงระยะเวลา 3 ถึง 5 ปี โดยการเติบโตดังกล่าวไม่สะท้อนในราคาซื้อขายหุ้นของบริษัทนั้น
- กองทุนนี้อาจพิจารณาการลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) เพื่อเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน (Efficient Portfolio Management) และเพื่อป้องกันความเสี่ยง (Hedging) จากอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ ณ ขณะใดขณะหนึ่ง ไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินที่ลงทุนในต่างประเทศ
- กองทุนหลักมีกลยุทธ์การลงทุนเพื่อมุ่งหวังให้ผลประกอบการสูงกว่าดัชนีชี้วัด (active management) ส่วนกองทุนนี้มุ่งหวังให้ผลประกอบการเคลื่อนไหวตามกองทุนหลัก (passive managing)

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (% ต่อปี)



	2560	2561	2562	2563	2564
ONE-EUROEQ	N/A	N/A	26.4%	1.08%	27.53%
BENCHMARK	11.46%	-12.38%	24.77%	-0.87%	25.3%

ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปีกลุ่ม (% ต่อปี)

	YTD	3เดือน	6เดือน	1ปี
กองทุน	-14.42	-4.02	-7.75	-11.74
ดัชนีชี้วัด	-14.23	-3.67	-7.56	-11.92
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	-22.88	-13.94	-22.88	-16.79
ความผันผวนกองทุน	19.81	18.19	18.58	19.14
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	20.91	18.82	19.92	20.24
	3ปี	5ปี	10ปี	ตั้งแต่จัดตั้ง
กองทุน	5.11	N/A	N/A	5.39
ดัชนีชี้วัด	3.78	2.84	7.4	4.88
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	2.93	2.39	5.59	N/A
ความผันผวนกองทุน	18.52	N/A	N/A	16.83
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	17.8	15.42	13.41	15.88

ระดับความเสี่ยง



เสี่ยงสูง

ลงทุนในตราสารทุนเป็นหลักโดยเฉลี่ยในรอบปีไม่น้อยกว่า 80 % ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน	27 มีนาคม 2561
วันเริ่มต้น class	27 มีนาคม 2561
นโยบายการจ่ายเงินปันผล	ไม่จ่าย
อายุกองทุน	ไม่กำหนด

ผู้จัดการกองทุนรวม

- 🏠 นายสุทธิโรจน์ สิทธิพัฒนานนท์ (ตั้งแต่งจดทะเบียน)
- 🏠 นายสิทธิ์ งามตระกูล (ตั้งแต่งจดทะเบียน)

ดัชนีชี้วัด

อัตราผลตอบแทนของ STOXX Europe 600 EUR (net return) ซึ่งเป็นดัชนีชี้วัดของกองทุนหลัก
ปรับด้วยต้นทุนการป้องกันความเสี่ยงอัตราแลกเปลี่ยนเพื่อคำนวณผลตอบแทนเป็นสกุลเงินบาท ณ วันที่ลงทุน ตามสัดส่วนการทำ hedging ประมาณร้อยละ 90 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน และอัตราผลตอบแทนของ STOXX Europe 600 EUR (net return) ปรับด้วยอัตราแลกเปลี่ยนเพื่อเทียบกับค่าสกุลเงินบาท ณ วันที่คำนวณผลตอบแทนในส่วนที่เหลือที่ไม่ได้ทำสัญญาป้องกันความเสี่ยงอัตราแลกเปลี่ยน

คำเตือน

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

ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือ

บริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่อง

ได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



การซื้อหน่วยลงทุน

วันทำการซื้อ : ทุกวันทำการ
เวลาทำการ : 09:00 - 16:00 น.
การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ : 1.0 บาท
การซื้อครั้งถัดไปขั้นต่ำ : 1.0 บาท

การขายคืนหน่วยลงทุน

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

ข้อมูลเชิงสถิติ

Maximum Drawdown : -35.66%
Recovering Period : 0 ปี 11 เดือน
FX Hedging : 85.16%
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน : 0.08
Sharpe Ratio : 0.23
Alpha : 1.33%
Beta : 0.91
Tracking Error : N/A
อายุเฉลี่ยของตราสารหนี้ : N/A ปี N/A เดือน
Yield to Maturity : N/A

หมายเหตุ :

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	2.675	1.07
รวมค่าใช้จ่าย	6.42	1.2091

หมายเหตุ :

- ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว
- ค่าใช้จ่ายที่กองทุนเรียกเก็บอาจเปลี่ยนแปลงตามความเหมาะสม โดยเก็บในอัตราไม่เกินจากที่ระบุไว้ในหนังสือชี้ชวนเสนอขายหน่วยลงทุน
- สามารถดูข้อมูลค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายย้อนหลัง 3 ปี ของกองทุนในหนังสือชี้ชวนส่วนสรุปข้อมูลกองทุนรวม ได้ที่ www.one-asset.com

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การขาย	2.14	1.5
การรับซื้อคืน	2.14	ยกเว้น
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า	2.14	1.5
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก	2.14	ยกเว้น
การโอนหน่วยลงทุน	ตามที่นายทะเบียนเรียกเก็บ ตามที่นายทะเบียนเรียกเก็บ	

หมายเหตุ :

- ค่าธรรมเนียมดังกล่าวรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว
- ค่าใช้จ่ายที่กองทุนเรียกเก็บอาจเปลี่ยนแปลงตามความเหมาะสม โดยเก็บในอัตราไม่เกินจากที่ระบุไว้ในหนังสือชี้ชวนเสนอขายหน่วยลงทุน

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน

Assets	%
หน่วยลงทุน Eleva	101.34
European Selection	
Fund Class I (EUR) acc	
เงินฝาก และอื่นๆ	-1.34

ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก

Assets	%
NOVO NORDISK A/S-B	4.69
ASTRAZENECA PLC	4.09
NESTLE SA-REG	3.37
SCHNEIDER ELECTRIC SE	3.25
TOTAL SA	0.34

การจัดสรรการลงทุนในต่างประเทศ

Country	%
ฝรั่งเศส	25.0
สหราชอาณาจักร	22.1
เยอรมนี	11.7
เดนมาร์ก	7.8
สวีตเซอร์แลนด์	7.7

การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม / ผู้ออกตราสาร 5 อันดับแรก

Sector	%
Financials	16.9
Industrials	16.5
Consumer Discretionary	12.6
Health Care	12.0
Materials	11.7

การจัดสรรการลงทุนตามอันดับความน่าเชื่อถือ (%)

ตาราง 1)การจัดสรรการลงทุนในต่างประเทศ 2)การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม/ผู้ออกตราสาร 5 อันดับแรก 3) ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก มาจาก Factsheet กองทุน ELEVA European Selection - Class I ณ วันที่ 31 ต.ค. 65

การลงทุนในกองทุนอื่นเกินกว่า 20% (กองทุนในประเทศ และหรือกองทุนต่างประเทศ)

ชื่อกองทุน : ELEVA EUROPEAN SEL-I EUR A

ISIN Code : LU1111643042 Bloomberg Code : ELVESIE LX

คำอธิบาย

Maximum Drawdown เปรอ์เซ็นต์ผลขาดทุนสูงสุดของกองทุนรวมในระยะเวลา 5 ปีย้อนหลัง (หรือตั้งแต่จัดตั้งกองทุนกรณีที่ยังไม่ครบ 5 ปี) โดยวัดจากระดับ NAV

ต่อหน่วยที่จุดสูงสุดไปจนถึงจุดต่ำสุดในช่วงที่ NAV ต่อหน่วยปรับตัวลดลง ค่า Maximum Drawdown เป็นข้อมูลที่ช่วยให้ทราบถึงความเสี่ยงที่อาจจะขาดทุนจากการลงทุนในกองทุนรวม

Recovering Period ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาตั้งแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินลงทุนเริ่มต้นใช้เวลานานเท่าใด

FX Hedging เปรอ์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตกองทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลาหนึ่ง

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

ซึ่งเป็นผลจากประสิทธิภาพของผู้จัดการกองทุนในการคัดเลือกหรือหาจังหวะการลงทุนในหลักทรัพย์ได้อย่างเหมาะสม

Beta ระดับและทิศทางของการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุน 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

ซึ่งคำนวณจากดอกเบี้ยที่ได้รับในอนาคตตลอดอายุตราสารและเงินต้นที่ได้รับคืนนำมาคิดลดเป็นมูลค่าปัจจุบัน โดยใช้วัดอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมตราสารหนี้ คำนวณจากค่าเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักของ

Yield to Maturity ของตราสารหนี้แต่ละตัวที่กองทุนมีการลงทุน และเนื่องจาก Yield to Maturity มีหน่วยมาตรฐานเป็นเปอร์เซ็นต์ต่อปี

จึงสามารถนำไปใช้เปรียบเทียบอัตราผลตอบแทนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีนโยบายถือครองตราสารหนี้จนครบกำหนดอายุและมีลักษณะการลงทุนที่ใกล้เคียงกันได้

บริษัท หลักทรัพย์จัดการกองทุน 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/