

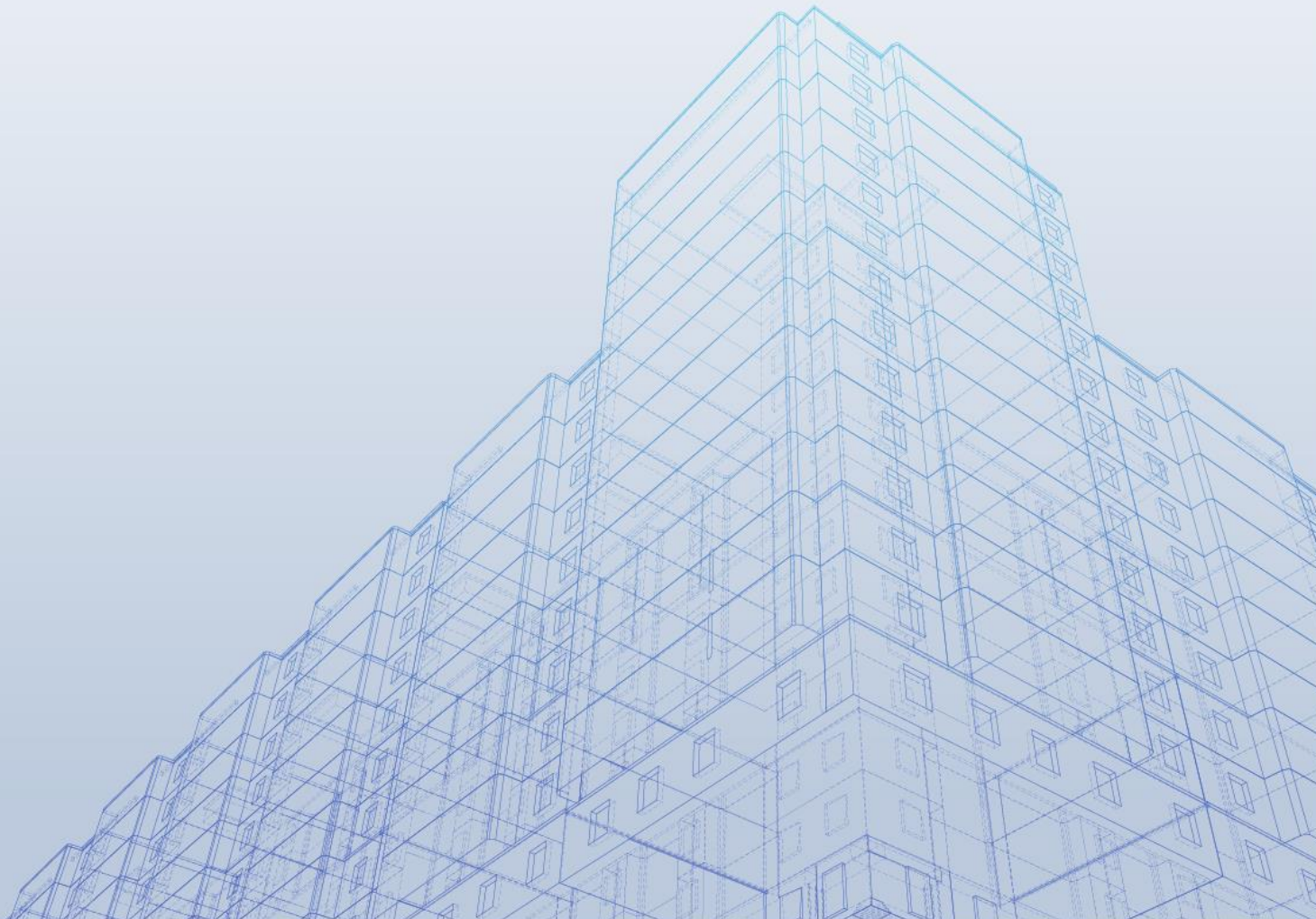
รายงานประจำปี

1 พฤษภาคม 2565 – 30 เมษายน 2566

กองทุนเปิด ดาโอ ตราสารหนี้ 6M2 ห้ามขายผู้ลงทุนรายย่อย

DAOL BOND FUND 6M2 NOT FOR RETAIL INVESTORS

(DAOL-BOND6M2)



ความเห็นของบริษัทจัดการ

เรียน ผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุน

กองทุนเปิด ดาโอ ตราสารหนี้ 6M2 ห้ามขายผู้ลงทุนรายย่อย (DAOL-BOND6M2)

กองทุนเปิด ดาโอ ตราสารหนี้ 6M2 ห้ามขายผู้ลงทุนรายย่อย กองทุนมีนโยบายลงทุนในพันธบัตร ตราสารหนี้ ตราสารทางการเงิน และ/หรือเงินฝากที่มีคุณภาพและให้ผลตอบแทนที่เหมาะสม ที่เสนอขายในประเทศและ/หรือต่างประเทศ โดยได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือของตราสารหรือของผู้ออกตราสารจากสถาบันจัดอันดับความน่าเชื่อถือที่ได้รับการยอมรับจากสำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ต. อยู่ในอันดับที่สามารถลงทุนได้ (Investment Grade) โดยกองทุนจะลงทุนในทรัพย์สินประเภทตราสารหนี้รวมกันทุกขณะไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน

อัตราการขยายตัวทางเศรษฐกิจไตรมาส 1 ปี 2566 ขยายตัวร้อยละ 2.7 ปรับตัวดีขึ้นจากการขยายตัวร้อยละ 1.4 ในไตรมาส 4 ปี 2565 จากภาคบริการที่ขยายตัวโดยมีปัจจัยสนับสนุนจากการการท่องเที่ยวฟื้นตัว ผลผลิตในภาคการเกษตรเพิ่มขึ้น และเงินเฟ้อที่ชะลอตัวลง และคาดการณ์ว่าทั้งปี 2566 เศรษฐกิจจะมีอัตราการขยายตัวร้อยละ 2.7 – 3.7 โดยมีปัจจัยสนับสนุนจากการท่องเที่ยว การอุปโภคบริโภคภาคเอกชน และการลงทุนภาครัฐและเอกชนที่ขยายตัวต่อเนื่อง จากเศรษฐกิจที่ฟื้นตัวทำให้คณะกรรมการนโยบายการเงินปรับขึ้นดอกเบี้ย 6 ครั้ง ทำให้อัตราดอกเบี้ยนโยบายมาอยู่ที่ร้อยละ 2 และคาดการณ์ว่าอัตราดอกเบี้ยนโยบายปี 2566 จะคงที่ที่ร้อยละ 2

การลงทุนของกองทุน DAOL-BOND6M2 มีการลงทุนในตราสารหนี้ที่ออกโดยภาครัฐและบริษัทเอกชนไทยร้อยละ 98.4 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิและมีอันดับความน่าเชื่อถืออยู่ในระดับที่ลงทุนได้

การเปลี่ยนแปลงที่เกิดขึ้นในรอบปีบัญชีปัจจุบันเมื่อเทียบกับรอบปีบัญชีก่อนหน้า

กองทุนมีส่วนการลงทุนในพันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยและตัวเงินคลังลดลงจากรอบปีบัญชีก่อนหน้าร้อยละ 11.16 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิ และตัวแลกเงินเพิ่มขึ้นจากรอบปีบัญชีก่อนหน้าร้อยละ 9.66 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิ

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ดาโอ จำกัด ขอขอบพระคุณผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุนทุกท่านที่ให้ความไว้วางใจลงทุนในกองทุนรวมของบริษัทจัดการด้วยดีตลอดมา

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ดาโอ จำกัด

ความเห็นของผู้ดูแลผลประโยชน์



รายงานความเห็นผู้ดูแลผลประโยชน์

เสนอ ผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุน
กองทุนเปิด คาโอ ตราสารหนี้ 6M2 ห้ามขายผู้ลงทุนรายย่อย

ตามที่ ธนาคารกรุงศรีอยุธยา จำกัด (มหาชน) ("ธนาคารฯ") ในฐานะผู้ดูแลผลประโยชน์ กองทุนเปิด คาโอ ตราสารหนี้ 6M2 ห้ามขายผู้ลงทุนรายย่อย ("กองทุน") ซึ่งมี บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน คาโอ จำกัด เป็นผู้จัดตั้ง และจัดการกองทุน ได้ปฏิบัติหน้าที่ดูแลผลประโยชน์ของกองทุนดังกล่าว สำหรับรอบปีบัญชีกองทุนตั้งแต่วันที่ 1 พฤษภาคม 2565 ถึงวันที่ 30 เมษายน 2566 นั้น

ธนาคารฯ เห็นว่า บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน คาโอ จำกัด ได้ปฏิบัติหน้าที่ในการจัดการโดยถูกต้อง ตามที่ควรตามวัตถุประสงค์ที่ได้กำหนดไว้ในโครงการจัดการที่ได้รับอนุมัติจากสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์ และตลาดหลักทรัพย์ และภายใต้พระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535

ผู้ดูแลผลประโยชน์

ธนาคารกรุงศรีอยุธยา จำกัด (มหาชน)

(นายจตุภูมิ ปัทมยางค์ปรีชา)

ผู้อำนวยการ ฝ่ายบริหารฝ่าย

ฝ่ายพัฒนามลิตภัณฑ์และควบคุมดูแลผลประโยชน์

ฝ่ายพัฒนามลิตภัณฑ์และควบคุมดูแลผลประโยชน์
วันที่ 3 พฤษภาคม 2566

รายชื่อผู้จัดการกองทุน
ของรอบบัญชีตั้งแต่วันที่ 1 พฤษภาคม 2565 – 30 เมษายน 2566

ลำดับ	รายชื่อผู้จัดการกองทุน
1	นิสาร์ตน์ ชมภูพวงษ์
2	รณิษฐา เพชรนรงค์
3	วสวัตต์ จิรวิชญ
4	นันทิชา จุงศิริวัฒน์

ตารางสรุปผลการดำเนินงานของกองทุน

วันจดทะเบียนกองทุน 27 พฤษภาคม 2565

วันสิ้นสุดรอบบัญชี 30 เมษายน 2566

DAOL-BOND6M2	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี	Since inception
ผลตอบแทนกองทุนรวม	0.41%	0.46%	0.67%	1.29%	1.40%
ผลตอบแทนตัวชี้วัด	-	-	-	-	-
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	-	-	-	-	-
ความผันผวนของกองทุน	0.34%	0.09%	0.30%	0.23%	0.21%
ความผันผวนของตัวชี้วัด	-	-	-	-	-

หมายเหตุ

- ดัชนีชี้วัด คือ ไม่มี เนื่องจากกองทุนมีกลยุทธ์การลงทุนครั้งเดียวและถือครองจนครบกำหนดอายุของทรัพย์สิน หรือครบอายุของรอบการลงทุนของกองทุนรวม หรือครบอายุของกองทุนรวม (buy-and-hold) เพื่อให้ได้ผลตอบแทนที่คาดหวังตามระยะเวลาที่กำหนดไว้
- เอกสารการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวมฉบับนี้ ได้จัดทำขึ้นตามมาตรฐานการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวมของสมาคมบริษัทจัดการลงทุน
- ผลการดำเนินงานในอดีต มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

รายละเอียดการลงทุน การกู้ยืมเงิน และการก่อภาระผูกพัน

กองทุนเปิด ดาโอ ตราสารหนี้ 6M2 ห้ามขายผู้ลงทุนรายย่อย (DAOL-BOND6M2)

ณ วันที่ 30 เมษายน 2566

รายละเอียดการลงทุน การกู้ยืมและการก่อภาระผูกพัน

	มูลค่าตามราคาตลาด	%NAV
หลักทรัพย์หรือทรัพย์สินในประเทศ		
ตั๋วแลกเงิน ตั๋วสัญญาใช้เงิน	244,614,215.10	83.34
หุ้นกู้	35,224,289.45	12.00
ตั๋วเงินคลัง	8,991,520.11	3.06
เงินฝาก	4,864,418.39	1.66
อื่นๆ	-174,777.77	-0.06
มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ	293,519,665.28	100.00

รายงานสรุปเงินลงทุน
กองทุนเปิด ดาโอ ตราสารหนี้ 6M2 ห้ามขายผู้ลงทุนรายย่อย (DAOL-BOND6M2)
ณ วันที่ 30 เมษายน 2566

- รายละเอียดการลงทุนในตราสารหนี้ที่ออกโดยนิติบุคคลไทยหรือตราสารหนี้ที่เสนอขายในประเทศไทย

กลุ่มของตราสาร	มูลค่าตามราคาตลาด	%NAV
(ก) พันธบัตร	8,991,520.11	3.06
(ข) ตราสารที่ธนาคารที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้น ธนาคารพาณิชย์ หรือบริษัท เงินทุนเป็นผู้ออก ผู้รับรอง ผู้อาวัว ผู้สืบทอด หรือผู้ค้ำประกัน	4,864,418.39	1.66
(ค) ตราสารที่มีบริษัทที่ได้รับ rating ในระดับ Investment grade เป็นผู้ออก ผู้รับรอง ผู้อาวัว ผู้สืบทอด หรือผู้ค้ำประกัน	279,838,504.55	95.34
(ง) ตราสารที่มีบริษัทที่ได้รับ rating ในระดับที่ต่ำกว่า Investment grade หรือไม่มี rating เป็นผู้ออก ผู้รับรอง ผู้อาวัว ผู้สืบทอด หรือผู้ค้ำประกัน	-	-

สัดส่วนสูงสุด (Upper Limit) ที่บริษัทจัดการคาดว่าจะลงทุนในกลุ่ม (ง) 0% NAV

รายละเอียดตัวตราสารและอันดับความน่าเชื่อถือของตราสารทุกตัว
กองทุนเปิด ดาโอ ตราสารหนี้ 6M2 ห้ามขายผู้ลงทุนรายย่อย (DAOL-BOND6M2)
ณ วันที่ 30 เมษายน 2566

ประเภท	ผู้ออก	ผู้ค้า/ผู้ รับรอง ผู้สืบทอด	วันครบกำหนด	อันดับความ น่าเชื่อถือ	มูลค่าหน้าตั๋ว	มูลค่าตาม ราคาตลาด
ตั๋วแลกเงิน						
TSFC23526A	บมจ.บส. เพื่อบริหารกิจหลักทรัพย์		26 พ.ค. 66	BBB	60,000,000.00	59,874,318.60
SIRI23526A	บมจ. แสตนลิส		26 พ.ค. 66	BBB+	55,000,000.00	54,930,109.85
MST23526A	บมจ.บส.เมย์แบงก์ (ประเทศไทย)		26 พ.ค. 66	AA(thai)	45,000,000.00	44,942,953.05
KTX23526A	บล.กรุงไทย เอ็กซ์สเปิร์ต		26 พ.ค. 66	AA-(thai)	45,000,000.00	44,942,745.60
TLS23526A	บจก.ที เอสซี		26 พ.ค. 66	BBB	40,000,000.00	35,224,289.45
หุ้นระยะสั้น						
KKP23526A	ร.เกียรตินาคินภัทร		26 พ.ค. 66	A	35,000,000.00	35,224,289.45
พันธบัตร/ตั๋วเงินคลัง						
TB23524A	กระทรวงการคลัง		24 พ.ค. 66		9,000,000.00	8,991,520.11
					รวม	288,830,024.66

คำอธิบายการจัดอันดับตราสารของสถาบันจัดอันดับความน่าเชื่อถือ

ระดับการลงทุน	TRIS	Fitch	Moody's	S&P	คำอธิบาย
ระดับที่น่าลงทุน	AAA	AAA(thai)	Aaa	AAA	อันดับเครดิตสูงที่สุด มีความเสี่ยงต่ำที่สุดที่จะไม่สามารถชำระหนี้ได้ตามกำหนด
	AA	AA(thai)	Aa	AA	อันดับเครดิตรองลงมาและถือว่ามีความเสี่ยงต่ำมากที่จะไม่สามารถชำระหนี้ได้ตามกำหนด
	A	A(thai)	A	A	ความเสี่ยงต่ำที่จะไม่สามารถชำระหนี้ได้ตามกำหนด
	BBB	BBB(thai)	Baa	BBB	ความเสี่ยงปานกลางที่จะไม่สามารถชำระหนี้ได้ตามกำหนด
ระดับที่ต่ำกว่า น่าลงทุน	ต่ำกว่า BBB	ต่ำกว่า BBB(thai)	ต่ำกว่า Baa	ต่ำกว่า BBB	ความเสี่ยงสูงที่จะไม่สามารถชำระหนี้ได้ตามกำหนด

ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุน

แบบแสดงค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม
 กองทุนเปิด ดาโอ ตราสารหนี้ 6M2 ห้ามขายผู้ลงทุนรายย่อย (DAOL-BOND6M2)
 พงรอบบัญชีตั้งแต่วันที่ 1 พฤษภาคม 2565 ถึงวันที่ 30 เมษายน 2566

ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (Fund's Direct Expenses)	จำนวนเงิน (บาท)	ร้อยละของมูลค่า ทรัพย์สินสุทธิ
ค่าธรรมเนียมการจัดการ (Management Fee)	588,547.96	0.20
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ (Trustee Fee)	77,952.27	0.03
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน (Registrar Fee)	588,547.96	0.20
ค่าที่ปรึกษาการลงทุน (Advisory Fee)	ไม่มี	ไม่มี
ค่าธรรมเนียมวิชาชีพ	33,500.00	0.01
ค่าใช้จ่ายภาษี	35,612.81	0.01
ค่าใช้จ่ายอื่นๆ	1,095.00	0.00
รวมค่าใช้จ่ายทั้งหมด *	1,325,256.00	0.45

หมายเหตุ

*ค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวมข้างต้น เป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่มหรือภาษีธุรกิจเฉพาะ หรือภาษีอื่นใดแล้ว

*ไม่รวมค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพ์ และค่าธรรมเนียมต่างๆ ที่เกิดขึ้นจากการซื้อขายหลักทรัพ์

ข้อมูลเกี่ยวกับมูลค่าเงินลงทุนและอัตราส่วนการลงทุนในกองทุนรวมอื่น
ที่บริษัทจัดการกองทุนรวมเดียวกันเป็นผู้รับผิดชอบดำเนินการ

- ไม่มี -

รายละเอียดเกี่ยวกับค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์
ของรอบบัญชีตั้งแต่วันที่ 1 พฤษภาคม 2565 – 30 เมษายน 2566

ชื่อบริษัทนายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์	ค่านายหน้าซื้อขาย หลักทรัพย์	ร้อยละของค่านายหน้า ซื้อขายหลักทรัพย์รวม
-		

รายละเอียดเกี่ยวกับการรับผลประโยชน์ตอบแทนเนื่องจากการที่ใช้บริการบุคคลอื่นๆ

ลำดับที่	บริษัทที่ให้ผลประโยชน์	ผลประโยชน์ที่ได้รับ	เหตุผลในการรับผลประโยชน์
1	ธนาคาร ซีไอเอ็มบี ไทย จำกัด (มหาชน)	ข่าวสาร และบทวิเคราะห์	เพื่อใช้เป็นข้อมูลประกอบการตัดสินใจลงทุน
2	ธนาคารเกียรตินาคิน จำกัด (มหาชน)		
3	ธนาคารไทยพาณิชย์ จำกัด (มหาชน)		
4	ธนาคารกรุงเทพ จำกัด (มหาชน)		
5	ธนาคารกรุงศรีอยุธยา จำกัด (มหาชน)		
6	ธนาคารสีกกรไทย จำกัด (มหาชน)		
7	ธนาคารทีสโตร์ จำกัด (มหาชน)		
8	ธนาคารทหารไทยธนชาต จำกัด (มหาชน)		
9	ธนาคารยูโอบี จำกัด (มหาชน)		
10	ธนาคารออมสิน		
11	บริษัท หลักทรัพย์ ดาโอ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)		
12	บริษัทหลักทรัพย์ เคจีไอ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)		
13	บริษัทหลักทรัพย์ กรุงไทย เอ็กซ์สปริง จำกัด		
14	บริษัทหลักทรัพย์ เมย์แบงก์ (ประเทศไทย) จำกัด		
15	บริษัทหลักทรัพย์ เอเชีย พลัส จำกัด (มหาชน)		
16	บริษัทหลักทรัพย์ ภัทร จำกัด (มหาชน) จำกัด		
17	บริษัทหลักทรัพย์ หยวนต้า (ประเทศไทย) จำกัด		
18	บริษัทหลักทรัพย์ กรุงศรี พัฒนสิน จำกัด (มหาชน)		

ข้อมูลอัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุนของกองทุนรวม (PTR)
ของรอบบัญชีตั้งแต่วันที่ 1 พฤษภาคม 2565 – 30 เมษายน 2566

1.75%

ข้อมูลการลงทุน และเหตุผลในกรณีที่การลงทุนไม่เป็นไปตามนโยบายการลงทุน
ของรอบบัญชีตั้งแต่วันที่ 1 พฤษภาคม 2565 – 30 เมษายน 2566

วันที่	ชื่อหลักทรัพย์	อัตราส่วน ณ สิ้นวัน (%NAV)	อัตราส่วนตามโครงการ (%NAV)	สาเหตุ	การดำเนินการ
- ไม่มี -					

รายชื่อบุคคลที่เกี่ยวข้องกับการทำธุรกรรมของกองทุนรวม
ของรอบบัญชีตั้งแต่วันที่ 1 พฤษภาคม 2565 – 30 เมษายน 2566

รายชื่อบุคคลที่เกี่ยวข้อง
ไม่มีรายชื่อบุคคลที่เกี่ยวข้องกับการทำธุรกรรมของกองทุนรวม

หมายเหตุ :

- ผู้ลงทุนสามารถตรวจสอบรายละเอียดการทำธุรกรรมกับบุคคลที่เกี่ยวข้องกับกองทุนรวมได้ที่บริษัทจัดการโดยตรง หรือที่เว็บไซต์ของบริษัทจัดการ www.daolinvestment.co.th

ข้อมูลการบันทึกมูลค่าตราสารหนี้หรือสิทธิเรียกร้องดังกล่าวเป็นศูนย์
ในกรณีที่ผู้ออกตราสารหนี้หรือลูกหนี้แห่งสิทธิเรียกร้องผิดนัดชำระหนี้หรือมีเหตุการณ์ว่าจะไม่สามารถชำระหนี้ได้

- ไม่มี -

ข้อมูลการรับชำระหนี้ด้วยทรัพย์สินอื่น

- ไม่มี -

ข้อมูลการใช้สิทธิออกเสียงในที่ประชุมผู้ถือหุ้น
ในนามกองทุนรวมของรอบปีปฏิทินล่าสุด

ผู้ลงทุนสามารถตรวจสอบรายละเอียดแนวทางการใช้สิทธิออกเสียงได้ที่
เว็บไซต์ของบริษัทจัดการ www.daolinvestment.co.th

ข้อมูลการถือหน่วยลงทุนเกิน 1 ใน 3
ณ วันที่ 28 เมษายน 2566

ชื่อกองทุน	สัดส่วนการถือหน่วยลงทุน (ร้อยละ)	จำนวนกลุ่มบุคคลใดบุคคลหนึ่ง
กองทุนเปิด ดาโอ ตราสารหนี้ 6M2 ห้ามขายผู้ลงทุนรายย่อย (DAOL-BOND6M2)		- ไม่มี -

หมายเหตุ :

- ผู้ลงทุนสามารถตรวจสอบข้อมูลการถือหน่วยลงทุนเกิน 1 ใน 3 ได้ที่เว็บไซต์ของบริษัทจัดการ

www.daolinvestment.co.th

กองทุนเปิด ดาโอ ตราสารหนี้ 6M2 ห้ามขายผู้ลงทุนรายย่อย
งบการเงินและรายงานของผู้สอบบัญชีรับอนุญาต
สำหรับปีสิ้นสุดวันที่ 30 เมษายน 2566