

รายงานประจำรอบ 6 เดือนแรก

1 พฤษภาคม 2566 – 31 ตุลาคม 2566

กองทุนเปิด ดาโอ แคนนาบิส บิสซิเนส

DAOL CANNABIS BUSINESS FUND

(DAOL -CANAB)

ความเห็นของบริษัจัดการ

เรียน ผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุน
กองทุนเปิด ดาโอ แคนนาบิส บิสสินส (DAOL-CANAB)

กองทุนเปิด ดาโอ แคนนาบิส บิสสินส จะลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งหน่วยลงทุนของกองทุนรวมตราสารทุนต่างประเทศ และ/หรือ กองทุนรวมอสังหาริมทรัพย์ต่างประเทศ ที่มีนโยบายการลงทุนในหลักทรัพย์หรือตราสารของบริษัที่ดำเนินธุรกิจ หรือได้รับประโยชน์จากการเติบโตทางธุรกิจที่เกี่ยวข้องกับอุตสาหกรรมที่ใช้ประโยชน์จากกัญชา หรือกัญชง หรือสารสกัดอื่นใดที่เกี่ยวข้องกับกัญชาอย่างถูกกฎหมาย อาทิ การปลูก การผลิต หรือการจำหน่ายกัญชา กัญชาเพื่อการอุตสาหกรรม กัญชาเพื่อวัตถุประสงค์ทางการแพทย์หรือที่ไม่ใช่ทางการแพทย์ การใช้กัญชาทางเภสัชกรรม สินค้าอุปโภคบริโภคที่ใช้กัญชาเป็นส่วนประกอบ รวมถึงธุรกิจอื่นที่เกี่ยวข้องกับระบบนิเวศทางธุรกิจ (Ecosystem) เช่น การให้บริการทางการเงินหรือจัดหาเงินทุนให้กับบริษัทที่ดำเนินธุรกิจที่เกี่ยวข้องกับกัญชา การผลิตและจำหน่ายอุปกรณ์เพื่อใช้ในการปลูกกัญชา เป็นต้น โดยการลงทุนในหลักทรัพย์ดังกล่าว กองทุนจะกระจายการลงทุนในภูมิภาคต่างๆ ทั่วโลกโดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน โดยขึ้นอยู่กับดุลยพินิจของผู้จัดการกองทุนตามสภาวะการลงทุนหรือการคาดการณ์สภาวะการลงทุนในแต่ละขณะ ทั้งนี้ บริษัทจัดการจะลงทุนในกองทุนรวมต่างประเทศ และ/หรือกองทุนรวมอสังหาริมทรัพย์ต่างประเทศที่มีนโยบายการลงทุนข้างต้นตั้งแต่ 2 กองทุนขึ้นไป โดยมีสัดส่วนการลงทุนในแต่ละกองทุนโดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีของทุนละไม่เกินร้อยละ 79 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน

โดยในช่วงที่ผ่านมาตั้งแต่วันที่ 1 พฤษภาคม 2566 ถึง 31 ตุลาคม 2566 กองทุนมีผลตอบแทน -15.89% โดยในช่วงที่ผ่านมาธุรกิจกัญชาและอื่นๆที่เกี่ยวข้องยังคงไม่ได้รับความสนใจจากทางด้านธุรกิจเนื่องจากในหลายประเทศยังคงมีการห้ามผลิตและนำเข้ากัญชาเพื่อนำมาใช้ในทางเพื่อสังสรรค์โดยยกเว้นไว้เพียงการนำกัญชาที่นำมาใช้เพื่อทางการแพทย์เท่านั้น ประกอบกับภาวะเงินเฟ้อในระบบเศรษฐกิจหลายประเทศที่ถึงแม้จะมีการชะลอตัวลงแต่ธนาคารกลางหลายแห่งยังคงคงอัตราดอกเบี้ยในระดับที่สูงเพื่อควบคุมให้เงินเฟ้ออยู่ในกรอบที่คาดการณ์ไว้ที่ 2%

การเปลี่ยนแปลงที่เกิดขึ้นในรอบบัญชีที่ผ่านมาเมื่อเทียบกับรอบบัญชีก่อนหน้า

กองทุนมีสถานะการลงทุน ณ วันที่ 31 ตุลาคม 2566 ดังนี้ กองทุนลงทุนในหน่วยลงทุนกองทุนต่างประเทศ 90.74% และมีเงินฝากเพื่อการดำเนินงาน 13.95% โดยกองทุนมีการทำสัญญาป้องกันความเสี่ยงอัตราแลกเปลี่ยนประมาณร้อยละ 85.61 ของทรัพย์สินที่อยู่ในรูปเงินตราต่างประเทศ

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ดาโอ จำกัด ขอขอบพระคุณผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุนทุกท่านที่ให้ความไว้วางใจลงทุนในกองทุนรวมของบริษัทจัดการด้วยดี ตลอดมา

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ดาโอ จำกัด

ความเห็นของผู้ดูแลผลประโยชน์



Make REAL Change

ปก.ปกท. 23/2756

7 พฤศจิกายน 2566

ความเห็นของผู้ดูแลผลประโยชน์

เรียน ผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุน
กองทุนเปิด ดาโอ แคนนาบิส บิสซิเนส

ธนาคารทหารไทยธนชาต จำกัด (มหาชน) ในฐานะผู้ดูแลผลประโยชน์ของ
กองทุนเปิด ดาโอ แคนนาบิส บิสซิเนส ได้ปฏิบัติหน้าที่ดูแลการจัดการของกองทุนดังกล่าวซึ่ง
บริหารและจัดการโดย บริษัท หลักทรัพย์จัดการกองทุนดาโอ จำกัด สำหรับรอบระยะเวลาบัญชี
ตั้งแต่วันที่ 1 พฤษภาคม พ.ศ. 2566 ถึงวันที่ 31 ตุลาคม พ.ศ. 2566 นั้น

ธนาคารฯ เห็นว่า บริษัท หลักทรัพย์จัดการกองทุนดาโอ จำกัด ได้ปฏิบัติหน้าที่
ในการบริหารและจัดการ กองทุนเปิด ดาโอ แคนนาบิส บิสซิเนส โดยถูกต้องตามที่ควร ตาม
วัตถุประสงค์ที่ได้กำหนดไว้ในโครงการจัดการที่ได้รับอนุมัติจากสำนักงานคณะกรรมการกำกับ
หลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ และภายใต้พระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ.
2535


(มณีวรรณ อิงควิธาน)

ผู้ดูแลผลประโยชน์

ธนาคารทหารไทยธนชาต จำกัด (มหาชน)

ธนาคารทหารไทยธนชาต จำกัด (มหาชน)
TMBThanachart Bank Public Company Limited

3000 ถนนพหลโยธิน แขวงจตุจักร เขตจตุจักร กรุงเทพฯ 10900 ทะเบียนเลขที่/เลขประจำตัวผู้เสียภาษี 0107537000017 โทร. 0 2299 1111
3000 Phahon Yothin Rd., Chatuchak, Bangkok 10900 Reg No./Tax ID No. 0107537000017 Tel. 0 2299 1111
ttbbank.com

ตารางสรุปผลการดำเนินงานของกองทุน

วันจดทะเบียนกองทุน 13 พฤษภาคม 2564

วันสิ้นสุดรอบบัญชี 31 ตุลาคม 2566

DAOL-CANAB	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี	Since inception
ผลการดำเนินงานของกองทุน	-35.51%	-14.34%	-17.14%	-51.89%	-57.09%
ดัชนีชี้วัด	11.22%	-4.32%	3.76%	4.81%	4.36%
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	-1.94%	-13.34%	-7.09%	-2.71%	-
ความผันผวนของกองทุน	42.99%	58.13%	49.95%	44.22%	46.37%
ความผันผวนของดัชนี	11.79%	9.59%	9.96%	12.46%	14.53%

หมายเหตุ

- ดัชนีชี้วัด คือ ดัชนี MSCI ACWI Net Total Return USD สัดส่วน 100.00% ปรับด้วยอัตราแลกเปลี่ยน เพื่อคำนวณผลตอบแทนเป็นสกุลเงินบาท ณ วันที่คำนวณผลตอบแทน
- เอกสารการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวมฉบับนี้ ได้จัดทำขึ้นตามมาตรฐานการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวมของสมาคมบริษัทจัดการลงทุน
- ผลการดำเนินงานในอดีต มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

งบดุล งบกำไรขาดทุน และงบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน

กองทุนเปิด ดาโอ แคนนาบิส บิสสิเนส (DAOL-CANAB)

งบแสดงฐานะทางการเงิน

ณ วันที่ 31 ตุลาคม 2566

	บาท
สินทรัพย์	
เงินลงทุนตามมูลค่ายุติธรรม (49,254,105.16 บาท)	14,578,829.29
เงินฝากธนาคาร	2,239,388.91
ลูกหนี้	
จากดอกเบี้ย และเงินปันผล	1,106.57
ค่าใช้จ่ายรอการตัดบัญชี	92.55
รวมสินทรัพย์	16,819,417.32
หนี้สิน	
เจ้าหนี้	
จากการรับซื้อคืนหน่วยลงทุน	6,276.44
จากสัญญาตราสารอนุพันธ์	693,372.54
ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย	50,933.04
หนี้สินอื่นๆ	1,474.87
รวมหนี้สิน	752,056.89
สินทรัพย์สุทธิ	16,067,360.43
สินทรัพย์สุทธิ:	
ทุนที่ได้รับจากผู้ถือหน่วยลงทุน	129,966,531.84
บัญชีปรับสมดุล	(32,479,341.14)
กำไรสะสม (ยกดยกมา)	(77,834,128.23)
กำไร (ขาดทุน) จากการดำเนินงาน	(3,585,702.04)
สินทรัพย์สุทธิ	16,067,360.43
จำนวนหน่วยลงทุนที่จำหน่ายแล้วทั้งหมด ณ วันสิ้นรอบบัญชี (หน่วย)	12,996,653.2479
สินทรัพย์สุทธิต่อหน่วย	1.2362
หมายเหตุ :	* งบการเงินนี้ยังไม่ได้ผ่านการสอบทานหรือรับรองจากผู้สอบบัญชี

กองทุนเปิด ดาโอ แคนนาบิส บิสซิเนส (DAOL-CANAB)
งบกำไรขาดทุน
สำหรับรอบบัญชีตั้งแต่วันที่ 1 พฤษภาคม 2566 ถึงวันที่ 31 ตุลาคม 2566

	บาท
รายได้จากการลงทุน	
รายได้ดอกเบี้ย และเงินปันผล	311,689.88
รวมรายได้	311,689.88
ค่าใช้จ่าย	
ค่าธรรมเนียมการจัดการ	152,394.39
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์	2,539.93
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน	30,478.91
ค่าธรรมเนียมวิชาชีพ	17,595.92
ค่าใช้จ่ายอื่นๆ	42,087.68
รวมค่าใช้จ่าย	245,096.83
รายได้จากการลงทุนสุทธิ	66,593.05
รายการกำไร (ขาดทุน) สุทธิจากเงินลงทุน	
รายการกำไร (ขาดทุน) สุทธิที่เกิดขึ้นจากเงินลงทุน	(5,413,536.69)
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิที่ยังไม่เกิดขึ้นจากสัญญาอนุพันธ์	(822,088.85)
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิจากอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ	2,583,330.45
รวมรายการกำไร (ขาดทุน) สุทธิจากเงินลงทุนที่เกิดขึ้นและยังไม่ได้เกิดขึ้น	(3,652,295.09)
การเพิ่มขึ้น (ลดลง) ในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงาน	(3,585,702.04)

หมายเหตุ : * งบการเงินนี้ยังไม่ได้ผ่านการสอบทานหรือรับรองจากผู้สอบบัญชี

กองทุนเปิด ดาโอ แคนนาบิส บิสซิเนส (DAOL-CANAB)

งบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน

ณ วันที่ 31 ตุลาคม 2566

		วันครบกำหนด	อัตราดอกเบี้ย ร้อยละ	จำนวนหน่วย / มูลค่าที่ตราไว้	มูลค่ายุติธรรม (บาท)	% เงินลงทุน
หน่วยลงทุน						
ETFMG Alternative Harvest ETF	MJ US			116,878.0000	12,097,377.91	82.98
Global X Cannabis ETF	POTX US			12,930.0000	2,481,451.38	17.02
รวมหน่วยลงทุน					14,578,829.29	100.00
รวมเงินลงทุน					14,578,829.29	100.00

รายละเอียดการลงทุน การกู้ยืมเงิน และการก่อการผูกพัน

รายละเอียดการลงทุน การกู้ยืมเงินและการก่อการผูกพันของ

กองทุนเปิด ดาโอ แคนนาบิส บิสซิเนส (DAOL-CANAB)

ข้อมูล ณ วันที่ 31 ตุลาคม 2566

หลักทรัพย์	มูลค่าตามราคา	%NAV
	ตลาด (บาท)	
หน่วยลงทุนของกองทุนต่างประเทศ	14,578,829.29	90.74
ETFMG Alternative Harvest ETF	12,097,377.91	75.29
The Global X Cannabis ETF	2,481,451.38	15.44
สินฝากธนาคาร	2,240,495.48	13.95
ธนาคารที่เอ็มบีรสนชาติ จำกัด (มหาชน)	420,268.51	2.62
JP MORGAN CHASE BANK, LONDON	1,820,226.97	11.33
สัญญาซื้อขายล่วงหน้า / FORWARD	-58,591.8	-0.37
อื่นๆ	-693,372.54	-4.32
<u>มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ</u>	<u>16,067,360.43</u>	<u>100</u>

รายงานสรุปเงินลงทุน

กองทุนเปิด ดาโอ แคนนาบิส บิสสินส (DAOL-CANAB)

ข้อมูล ณ วันที่ 31 ตุลาคม 2566

กลุ่มของตราสาร	มูลค่าตามราคาตลาด	%NAV
(ก) ตราสารภาครัฐไทยและตราสารภาครัฐต่างประเทศ	-	-
(ข) ตราสารที่ธนาคารที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้น ธนาคารพาณิชย์หรือบริษัทเงินทุน เป็นผู้ออก ผู้ส่งจ่าย ผู้รับรอง ผู้รับอาวัล ผู้สืบทอด หรือผู้ค้ำประกัน	2,240,495.48	13.95
(ค) <u>ตราสารที่มีอันดับความน่าเชื่อถืออยู่ในอันดับที่สามารถลงทุนได้(investment grade)</u>	-	-
(ง) ตราสารที่มีอันดับความน่าเชื่อถืออยู่ในอันดับต่ำกว่า <u>อันดับที่สามารถลงทุนได้(investment grade)</u> หรือ ตราสารที่ไม่ได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือ	-	-

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

**รายละเอียดและอันดับความน่าเชื่อถือของตราสารแห่งนี้เป็นฝาก หรือ ตราสารที่หนี้นักลงทุน
ที่ลงทุนลงทุนหรือมีไว้เป็นรายตัว**

ประเภท	ผู้ออก	วันครบกำหนด	อันดับความน่าเชื่อถือของผู้ออก/ค่าประกัน	มูลค่าหน้าตั๋ว	มูลค่าตามราคาตลาด
1 เงินฝากธนาคาร	ธนาคารทีเอ็มบีธนชาต จำกัด (มหาชน)		AAA(tha)		420,268.51
2 เงินฝากธนาคาร	JP MORGAN CHASE BANK, LONDON		Aa2		1,820,226.97

คำอธิบายการจัดอันดับตราสารของสถาบันจัดอันดับความน่าเชื่อถือ

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

ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุน

แบบแสดงค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม
กองทุนเปิด ดาโอ แคนนาบิส บิสสินส (DAOL-CANAB)
ของรอบบัญชีตั้งแต่วันที่ 1 พฤษภาคม 2566 ถึงวันที่ 31 ตุลาคม 2566

ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (Fund's Direct Expenses)	จำนวนเงิน (บาท)	ร้อยละของมูลค่า ทรัพย์สินสุทธิ
ค่าธรรมเนียมการจัดการ (Management Fee)	152,394.39	0.81
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ (Trustee Fee)	2,539.93	0.01
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน (Registrar Fee)	30,478.91	0.16
ค่าที่ปรึกษาการลงทุน (Advisory Fee)	ไม่มี	ไม่มี
ค่าธรรมเนียมวิชาชีพ	17,595.92	0.09
ค่าธรรมเนียมการทำรายการ	20,544.00	0.11
ค่าธรรมเนียมการใช้ดัชนี	6,384.21	0.03
ค่าใช้จ่ายอื่นๆ	1,248.50	0.01
รวมค่าใช้จ่ายทั้งหมด *	231,185.86	1.22

หมายเหตุ

*ค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวมข้างต้น เป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่มหรือภาษีธุรกิจเฉพาะ หรือภาษีอื่นใดแล้ว

*ไม่รวมค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ และค่าธรรมเนียมต่างๆ ที่เกิดขึ้นจากซื้อขายหลักทรัพย์

ข้อมูลเกี่ยวกับมูลค่าเงินลงทุนและอัตราส่วนการลงทุนในกองทุนรวมอื่น
ที่บริษัทจัดการกองทุนรวมเดียวกันเป็นผู้รับผิดชอบดำเนินการ

- ไม่มี -

รายละเอียดเกี่ยวกับค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์
ของรอบบัญชีตั้งแต่วันที่ 1 พฤษภาคม 2566 – 31 ตุลาคม 2566

ชื่อบริษัทนายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์	ค่านายหน้าซื้อขาย หลักทรัพย์	ร้อยละของค่านายหน้าซื้อ ขายหลักทรัพย์รวม
DAOL Securities (Thailand) Public Company Limited	11,561.37	47.96
UOB KAY HIAN SECURITIES (THAILAND) PUBLIC COMPANY LIMITED	12,545.89	52.04
รวม		100.00

รายละเอียดเกี่ยวกับการรับผลประโยชน์ตอบแทนเนื่องจากการที่ใช้บริการบุคคลอื่นๆ

ลำดับ	บริษัทที่ให้ผลประโยชน์	ผลประโยชน์ที่ได้รับ	เหตุผลในการรับผลประโยชน์
1	บริษัทหลักทรัพย์ ดาโอ (ประเทศไทย) จำกัด	ข่าวสาร และบทวิเคราะห์	เพื่อใช้เป็นข้อมูลในการประกอบการตัดสินใจลงทุน
2	บริษัทหลักทรัพย์ ยูโอบี เคย์เฮียน (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)		
3	LGT Bank (Singapore) Ltd		
4	บริษัทหลักทรัพย์ ซีจีเอส-ซีไอเอ็มบี (ประเทศไทย) จำกัด		
5	บริษัทหลักทรัพย์ กรุงศรี พัฒนสิน จำกัด		
6	บริษัทหลักทรัพย์ ธนชาติ จำกัด		
7	บริษัทหลักทรัพย์ กรุงศรี จำกัด (มหาชน)		
8	บริษัทหลักทรัพย์ เมย์แบงก์ (ประเทศไทย) จำกัด		
9	บริษัทหลักทรัพย์ หยวนต้า (ประเทศไทย) จำกัด		
10	บริษัทหลักทรัพย์ อินโนเวสต์ เอกซ์ จำกัด		

ข้อมูลอัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุนของกองทุนรวม (PTR)
ของรอบบัญชีตั้งแต่วันที่ 1 พฤษภาคม 2566 – 31 ตุลาคม 2566

79.86%

ข้อมูลการลงทุน และเหตุผลในกรณีที่การลงทุนไม่เป็นไปตามนโยบายการลงทุน
ของรอบบัญชีตั้งแต่วันที่ 1 พฤษภาคม 2566 – 31 ตุลาคม 2566

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

รายชื่อบุคคลที่เกี่ยวข้องกับการทำธุรกรรมของกองทุนรวม
ของรอบบัญชีตั้งแต่วันที่ 1 พฤษภาคม 2566 – 31 ตุลาคม 2566

รายชื่อบุคคลที่เกี่ยวข้อง
1. บริษัทหลักทรัพย์ ดาโอ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)

หมายเหตุ :

- ผู้ลงทุนสามารถตรวจสอบรายละเอียดการทำธุรกรรมกับบุคคลที่เกี่ยวข้องกับกองทุนรวมได้ที่บริษัทจัดการโดยตรง หรือที่เว็บไซต์ของบริษัทจัดการ www.daolinvestment.co.th

ข้อมูลการถือหน่วยลงทุนเกิน 1 ใน 3
ณ วันที่ 31 ตุลาคม 2566

ชื่อกองทุน	สัดส่วนการถือหน่วยลงทุน (ร้อยละ)	จำนวนกลุ่มบุคคลใด บุคคลหนึ่ง
กองทุนเปิด ดาโอ แคนนาบิส บิสสินส (DAOL -CANAB)	- ไม่มี -	

หมายเหตุ :

- ผู้ลงทุนสามารถตรวจสอบข้อมูลการถือหน่วยลงทุนเกิน 1 ใน 3 ได้ที่เว็บไซต์ของบริษัทจัดการ

www.daolinvestment.co.th