

รายงานประจำรอบ 6 เดือนแรก

1 สิงหาคม 2565 – 31 มกราคม 2566

กองทุนเปิด ดาโอ ยุโรป ออฟฟอร์ทูนิตี้

DAOL EUROPE OPPORTUNITY FUND

(DAOL-EUROPE)

ความเห็นของบริษัทจัดการ

เรียน ผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุน
กองทุนเปิด ดาโอ ยุโรป ออฟฟอร์ดนิติ (DAOL-EUROPE)

กองทุนเปิด ดาโอ ยุโรป ออฟฟอร์ดนิติ (DAOL-EUROPE) จะเน้นลงทุนในหลักทรัพย์ที่จัดตั้งขึ้น หรือดำเนินธุรกิจ หรือได้รับประโยชน์จากการดำเนินธุรกิจในภูมิภาคยุโรปเป็นหลัก โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน ตั้งแต่ 1 สิงหาคม 2565 – 31 มกราคม 2566 กองทุนปรับตัวลดลง 1.682% จากการที่เศรษฐกิจยุโรปเผชิญแรงกดดันอย่างหนักจากภาวะเงินเฟ้อซึ่งพุ่งขึ้นเป็นประวัติการณ์ โดยทางธนาคารกลางยุโรปได้เดินหน้าปรับอัตราดอกเบี้ยขึ้นอย่างต่อเนื่องในปีที่ผ่านมาเป็นผลทำให้ยุโรปยังคงเสี่ยงต่อภาวะเศรษฐกิจถดถอยต่อไป

การเปลี่ยนแปลงที่เกิดขึ้นในรอบบัญชีที่ผ่านมาเมื่อเทียบกับรอบบัญชีก่อนหน้า

กองทุนจดทะเบียนในวันที่ 6 สิงหาคม 2564 และมีสถานะการลงทุน ณ วันที่ 31 มกราคม 2566 ดังนี้ กองทุนลงทุนในหน่วยลงทุนกองทุนต่างประเทศ 90.57% ของมูลค่าทรัพย์สิน และมีเงินฝากเพื่อการดำเนินงานร้อยละ 2.04 ของมูลค่าทรัพย์สิน โดยกองทุนมีการทำสัญญาป้องกันความความเสี่ยงอัตราแลกเปลี่ยนประมาณร้อยละ 97.55 ของทรัพย์สินที่อยู่ในรูปเงินตราต่างประเทศ

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ดาโอ จำกัด ขอขอบพระคุณผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุนทุกท่านที่ให้ความไว้วางใจลงทุนในกองทุนรวมของบริษัทจัดการด้วยดี ตลอดมา

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ดาโอ จำกัด

ความเห็นของผู้ดูแลผลประโยชน์



ความเห็นของผู้ดูแลผลประโยชน์

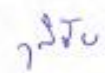
เรียน ผู้ถือหุ้นยelowงทุน กองทุนเปิด คาโอ ยูโรป ออฟฟอรืฐนิตี

ข้าพเจ้า บมจ.ธนาคารกสิกรไทย ในฐานะผู้ดูแลผลประโยชน์ได้ดูแลการจัดการ กองทุนเปิด คาโอ ยูโรป ออฟฟอรืฐนิตี ซึ่งจัดการโดยบริษัท หลักทรัพย์จัดการกองทุนคาโอ จำกัด สำหรับ ระยะเวลาตั้งแต่วันที่ 1 สิงหาคม พ.ศ. 2565 ถึงวันที่ 31 มกราคม พ.ศ. 2566 แล้ว

ข้าพเจ้าเห็นว่า บริษัท หลักทรัพย์จัดการกองทุนคาโอ จำกัด ได้ปฏิบัติหน้าที่ในการ จัดการ กองทุนเปิด คาโอ ยูโรป ออฟฟอรืฐนิตี เหมาะสมตามสมควรแห่งวัตถุประสงค์ ที่ได้กำหนดไว้ใน โครงการและภายใต้พระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535

ขอแสดงความนับถือ
บมจ. ธนาคารกสิกรไทย


(นายวิโรจน์ ลิ้มทองธรรม)
รองผู้อำนวยการฝ่ายบริการธุรกิจหลักทรัพย์


(นายวุฒิชัย รอดภัย)
หัวหน้าส่วน ฝ่ายบริการธุรกิจหลักทรัพย์

วันที่ 10 กุมภาพันธ์ พ.ศ. 2566

ตารางสรุปผลการดำเนินงานของกองทุน

วันจดทะเบียนกองทุน 6 สิงหาคม 2564

วันสิ้นสุดรอบบัญชี 31 มกราคม 2566

DAOL-EUROPE	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี	Since Inception
ผลการดำเนินงานของกองทุน	6.96%	10.96%	1.44%	-9.99%	-15.80%
ดัชนีชี้วัด	2.64%	4.39%	2.00%	-3.79%	-5.61%
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	3.51%	4.94%	-1.01%	-10.39%	-
ความผันผวนของผลการดำเนินงาน	14.50%	17.42%	20.29%	21.95%	20.78%
ความผันผวนของดัชนีชี้วัด	10.30%	13.88%	19.27%	22.49%	20.25%

หมายเหตุ

- ดัชนีชี้วัด คือ ดัชนี MSCI Europe Net Total Return EUR Index สัดส่วน 100.00% ปรับด้วยอัตราแลกเปลี่ยน เพื่อคำนวณผลตอบแทนเป็นสกุลเงินบาท ณ วันที่คำนวณผลตอบแทน
- เอกสารการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวมฉบับนี้ ได้จัดทำขึ้นตามมาตรฐานการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวมของสมาคมบริษัทจัดการลงทุน
- ผลการดำเนินงานในอดีต มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

งบดุล งบกำไรขาดทุน และงบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน

กองทุนเปิด ดาโอ ยูโรป ออฟฟเวอร์กูนิตี (DAOL-EUROPE)

งบแสดงฐานะทางการเงิน

ณ วันที่ 31 มกราคม 2566

	บาท
สินทรัพย์	
เงินลงทุนตามมูลค่ายุติธรรม (87,634,704.38 บาท)	72,757,378.25
เงินฝากธนาคาร	1,633,821.19
ลูกหนี้	
จากดอกเบี้ย และเงินปันผล	277.40
จากการขายเงินลงทุน	5,213,248.76
จากสัญญาตราสารอนุพันธ์	839,903.83
ค่าใช้จ่ายรอการตัดบัญชี	42,868.09
รวมสินทรัพย์	80,487,497.52
หนี้สิน	
ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย	153,886.79
หนี้สินอื่นๆ	3,864.89
รวมหนี้สิน	157,751.68
สินทรัพย์สุทธิ	80,329,745.84
สินทรัพย์สุทธิ:	
ทุนที่ได้รับจากผู้ถือหุ้นเงินลงทุน	103,789,621.96
บัญชีปรับสมดุล	23,437,134.39
กำไรสะสม (ยอดยกมา)	(42,363,717.78)
กำไร (ขาดทุน) จากการดำเนินงาน	(4,533,292.73)
สินทรัพย์สุทธิ	80,329,745.84
จำนวนหน่วยลงทุนที่จำหน่ายแล้วทั้งหมด ณ วันสิ้นรอบบัญชี (หน่วย)	10,378,962.1909
สินทรัพย์สุทธิต่อหน่วย	7.7396
หมายเหตุ :	* งบการเงินนี้ยังไม่ได้ผ่านการสอบทานหรือรับรองจากผู้สอบบัญชี

กองทุนเปิด ดาโอ ยุโรป ออฟฟเวอร์กูนิตี (DAOL-EUROPE)
งบกำไรขาดทุน
สำหรับรอบบัญชีตั้งแต่วันที่ 1 สิงหาคม 2565 ถึงวันที่ 31 มกราคม 2566

	บาท
รายได้จากการลงทุน	
รายได้ดอกเบี้ย และเงินปันผล	53,294.58
รวมรายได้	53,294.58
ค่าใช้จ่าย	
ค่าธรรมเนียมการจัดการ	845,472.68
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์	14,091.21
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน	169,094.49
ค่าธรรมเนียมวิชาชีพ	18,652.08
ค่าใช้จ่ายอื่นๆ	81,749.10
รวมค่าใช้จ่าย	1,129,059.56
รายได้จากการลงทุนสุทธิ	(1,075,764.98)
รายการกำไร (ขาดทุน) สุทธิจากเงินลงทุน	
รายการกำไร (ขาดทุน) สุทธิที่เกิดขึ้นจากเงินลงทุน	(2,147,932.33)
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิที่ยังไม่เกิดขึ้นจากสัญญาอนุพันธ์	2,571,280.91
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิจากอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ	(3,880,876.33)
รวมรายการกำไร (ขาดทุน) สุทธิจากเงินลงทุนที่เกิดขึ้นและยังไม่ได้เกิดขึ้น	(3,457,527.75)
การเพิ่มขึ้น (ลดลง) ในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงาน	(4,533,292.73)

หมายเหตุ : * งบการเงินนี้ยังไม่ได้ผ่านการสอบทานหรือรับรองจากผู้สอบบัญชี

กองทุนเปิด ดาโอ ยุโรป ออฟฟเวอร์นิตี้ (DAOL-EUROPE)

งบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน

ณ วันที่ 31 มกราคม 2566

	วันครบกำหนด	อัตราดอกเบี้ย ร้อยละ	จำนวนหน่วย / มูลค่าที่ตราไว้	มูลค่ายุติธรรม (บาท)	% เงินลงทุน
หน่วยลงทุน					
Berenberg European Focus Fund	BEREUF1 LX		6,974.0730	36,079,052.99	49.59
Janus Henderson Pan European Smaller Companies Fund	HENPCEU LX		13,093.7140	36,678,325.26	50.41
รวมหน่วยลงทุน				72,757,378.25	100.00
รวมเงินลงทุน				72,757,378.25	100.00

รายละเอียดการลงทุน การกู้ยืมเงิน และการก่อการะผูกพัน

รายละเอียดการลงทุน การกู้ยืมเงินและการก่อการะผูกพันของ

กองทุนเปิด ดาโอ ยุโรป ออฟฟเวอร์นูตี (DAOL-EUROPE)

ข้อมูล ณ วันที่ 31 มกราคม 2566

หลักทรัพย์	มูลค่าตามราคาตลาด	%NAV
	(บาท)	
หน่วยลงทุนของกองทุนต่างประเทศ	72,757,378.25	90.57
BERENBERG EUROPEAN FOCUS FUND	36,079,052.99	44.91
JANUS HENDERSON PAN EUROPEAN SMALLER COMPANIES FUND	36,678,325.26	45.66
เงินฝากธนาคาร	1,634,098.59	2.04
ธนาคารกสิกรไทย จำกัด (มหาชน)	478,438.20	0.60
LGT Bank AG, Hong Kong	1,155,660.39	1.44
สัญญาซื้อขายล่วงหน้า / FORWARD	839,903.83	1.05
อื่นๆ	5,098,365.17	6.34
<u>มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ</u>	<u>80,329,745.84</u>	<u>100</u>

รายงานสรุปเงินลงทุน
กองทุนเปิด ดาโอ ยุโรป ออฟฟอร์ดนิวส์ (DAOL-EUROPE)
ข้อมูล ณ วันที่ 31 มกราคม 2566

กลุ่มของตราสาร	มูลค่าตามราคาตลาด	%NAV
(ก) ตราสารภาครัฐไทยและตราสารภาครัฐต่างประเทศ	-	-
(ข) ตราสารที่ธนาคารที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้น ธนาคารพาณิชย์หรือบริษัทเงินทุน เป็นผู้ออก ผู้ส่งจ่าย ผู้รับรอง ผู้รับอาวัล ผู้สืบทอด หรือผู้ค้ำประกัน	1,634,098.59	2.04
(ค) ตราสารที่มีอันดับความน่าเชื่อถืออยู่ในอันดับที่สามารถลงทุน ได้ (investment grade)	-	-
(ง) ตราสารที่มีอันดับความน่าเชื่อถืออยู่ในอันดับต่ำกว่า อันดับที่สามารถลงทุนได้ (investment grade) หรือ ตราสารที่ไม่ได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือ	-	-

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

รายละเอียดและอันดับความน่าเชื่อถือของตราสารแห่งนี้ เงินฝาก หรือ ตราสารกึ่งหนี้กึ่งทุน
ที่กองทุนลงทุนหรือมีไว้เป็นรายตัว

ประเภท	ผู้ออก	วันครบกำหนด	อันดับความน่าเชื่อถือของผู้ออก/ค่าประกัน	มูลค่าหน้าตั๋ว	มูลค่าตามราคาตลาด
1 เงินฝากธนาคาร	ธนาคารกสิกรไทย จำกัด (มหาชน)		BBB+		478,438.20
2 เงินฝากธนาคาร	LGT Bank AG, Hong Kong		A+		1,155,660.39

คำอธิบายการจัดอันดับตราสารของสถาบันจัดอันดับความน่าเชื่อถือ

ระดับการลงทุน	TRIS	Fitch	Moody's	S&P	คำอธิบาย
ระดับที่นำลงทุน	AAA	AAA(tha)	Aaa	AAA	อันดับเครดิตสูงที่สุด มีความเสี่ยงต่ำที่สุดที่จะไม่สามารถชำระหนี้ได้ตามกำหนด
	AA	AA(tha)	Aa	AA	อันดับเครดิตรองลงมาและถือว่ามีความเสี่ยงต่ำมากที่จะไม่สามารถชำระหนี้ได้ตามกำหนด
	A	A(tha)	A	A	ความเสี่ยงต่ำที่จะไม่สามารถชำระหนี้ได้ตามกำหนด
	BBB	BBB(tha)	Baa	BBB	ความเสี่ยงปานกลางที่จะไม่สามารถชำระหนี้ได้ตามกำหนด
ระดับที่ต่ำกว่านำลงทุน	ต่ำกว่า BBB	ต่ำกว่า BBB(tha)	ต่ำกว่า Baa	ต่ำกว่า BBB	ความเสี่ยงสูงที่จะไม่สามารถชำระหนี้ได้ตามกำหนด

ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุน

แบบแสดงค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม
 กองทุนเปิด ดาโอ ยุโรป ออฟฟอร์ดยูนิตี (DAOL-EUROPE)
 ของรอบบัญชีตั้งแต่วันที่ 1 สิงหาคม 2565 ถึงวันที่ 31 มกราคม 2566

ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (Fund's Direct Expenses)	จำนวนเงิน (บาท)	ร้อยละของมูลค่า ทรัพย์สินสุทธิ
ค่าธรรมเนียมการจัดการ (Management Fee)	845,472.68	0.81
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ (Trustee Fee)	14,091.21	0.01
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน (Registrar Fee)	169,094.49	0.16
ค่าที่ปรึกษาการลงทุน (Advisory Fee)	ไม่มี	ไม่มี
ค่าธรรมเนียมวิชาชีพ	18,652.08	0.02
ค่าธรรมเนียมการทำรายการ	29,104.00	0.03
ค่าธรรมเนียมการใช้ดัชนี	20,912.17	0.02
ค่าใช้จ่ายอื่นๆ	1,141.37	0.00
รวมค่าใช้จ่ายทั้งหมด *	1,098,468.00	1.05

หมายเหตุ

*ค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวมข้างต้น เป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่มหรือภาษีธุรกิจเฉพาะ หรือภาษีอื่นใดแล้ว

*ไม่รวมค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ และค่าธรรมเนียมต่างๆ ที่เกิดขึ้นจากซื้อขายหลักทรัพย์

ข้อมูลเกี่ยวกับมูลค่าเงินลงทุนและอัตราส่วนการลงทุนในกองทุนรวมอื่น
ที่บริษัทจัดการกองทุนรวมเดียวกันเป็นผู้รับผิดชอบดำเนินการ

- ไม่มี -

รายละเอียดเกี่ยวกับค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์
ของรอบบัญชีตั้งแต่วันที่ 1 สิงหาคม 2565 – 31 มกราคม 2566

ชื่อบริษัทนายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์	ค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์	ร้อยละของค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์รวม
LGT Bank AG, Hong Kong	108,727.37	100.00
รวม		100.00

รายละเอียดเกี่ยวกับการรับผลประโยชน์ตอบแทนเนื่องจากการที่ใช้บริการบุคคลอื่นๆ

ลำดับ	บริษัทที่ให้ผลประโยชน์	ผลประโยชน์ที่ได้รับ	เหตุผลในการรับผลประโยชน์
1	บริษัทหลักทรัพย์ ดาโอ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)	ข่าวสาร และบทวิเคราะห์	เพื่อใช้เป็นข้อมูลในการประกอบการตัดสินใจลงทุน
2	บริษัทหลักทรัพย์ ยูไอบี เคย์เอียน (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)		
3	LGT Bank (Singapore) Ltd.		
4	บริษัทหลักทรัพย์ ดาโอ (ประเทศไทย) จำกัด		
5	บริษัทหลักทรัพย์ โนมูระ พัฒนสิน จำกัด		
6	บริษัทหลักทรัพย์ ธนชาติ จำกัด		
7	บริษัทหลักทรัพย์ กรุงศรี จำกัด (มหาชน)		
8	บริษัทหลักทรัพย์ เครดิต สวิส (ประเทศไทย) จำกัด		
9	บริษัทหลักทรัพย์ เมย์แบงก์ (ประเทศไทย) จำกัด		

ข้อมูลอัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุนของกองทุนรวม (PTR)
ของรอบบัญชีตั้งแต่วันที่ 1 สิงหาคม 2565 – 31 มกราคม 2566

40.53%

ข้อมูลการลงทุน และเหตุผลในกรณีที่การลงทุนไม่เป็นไปตามนโยบายการลงทุน
ของรอบบัญชีตั้งแต่วันที่ 1 สิงหาคม 2565 – 31 มกราคม 2566

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

รายชื่อบุคคลที่เกี่ยวข้องกับการทำธุรกรรมของกองทุนรวม
ของรอบบัญชีตั้งแต่วันที่ 1 สิงหาคม 2565 – 31 มกราคม 2566

รายชื่อบุคคลที่เกี่ยวข้อง
- ไม่มี -

หมายเหตุ :

- ผู้ลงทุนสามารถตรวจสอบรายละเอียดการทำธุรกรรมกับบุคคลที่เกี่ยวข้องกับกองทุนรวมได้ที่บริษัทจัดการ
โดยตรง หรือที่เว็บไซต์ของบริษัทจัดการ www.daolinvestment.co.th

ข้อมูลการถือหน่วยลงทุนเกิน 1 ใน 3 ณ วันที่ 31 มกราคม 2566

ชื่อกองทุน	สัดส่วนการถือหน่วยลงทุน (ร้อยละ)	จำนวนกลุ่มบุคคลใด บุคคลหนึ่ง
กองทุนเปิด ดาโอ ยุโรป ออฟฟอร์นิตี (DAOL-EUROPE)	- ไม่มี -	

หมายเหตุ :

- ผู้ลงทุนสามารถตรวจสอบข้อมูลการถือหน่วยลงทุนเกิน 1 ใน 3 ได้ที่เว็บไซต์ของบริษัทจัดการ
www.daolinvestment.co.th