

รายงานประจำรอบ 6 เดือนแรก

1 สิงหาคม 2566 – 31 มกราคม 2567

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 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของตั้งแต่ 1 สิงหาคม 2566 – 31 มกราคม 2567 กองทุนปรับตัวลดลง 2.12% ปัจจัยหลักมาจากเศรษฐกิจยุโรปเผชิญแรงกดดันอย่างหนักจากการรายงานตัวเลข GDP ทั้งปี 2023 รายงานออกมาเติบโตเพียง 0.1% เท่านั้น ต่ำกว่าที่นักวิเคราะห์คาดการณ์ไว้ เนื่องจากในปีที่ผ่านมาเงินเฟ้อที่อยู่ในระดับสูงทำให้ธนาคารกลางยุโรป หรือ ECB ต้องปรับอัตราดอกเบี้ยขึ้นตามไปด้วย จึงเป็นเหตุผลหลักทำให้ GDP โดนกดดัน ประกอบกับสงครามรัสเซีย-ยูเครนที่ยังไม่มีทีท่าจะหยุดลงสงครามใหญ่อย่าง อิสราเอล-ฮามาส ที่ก่อตัวขึ้นใกล้ชายแดนยุโรป เป็นแรงกดดันต่อหุ้นยุโรป

การเปลี่ยนแปลงที่เกิดขึ้นในรอบบัญชีที่ผ่านมาเมื่อเทียบกับรอบบัญชีก่อนหน้า

กองทุนจดทะเบียนในวันที่ 6 สิงหาคม 2564 และมีสถานะการลงทุน ณ วันที่ 31 มกราคม 2567 ดังนี้ กองทุนลงทุนในหน่วยลงทุนกองทุนต่างประเทศ 94.89% ของมูลค่าทรัพย์สิน และมีเงินฝากเพื่อการดำเนินงานร้อยละ 6.07 ของมูลค่าทรัพย์สิน โดยกองทุนมีการทำสัญญาป้องกันความเสี่ยงอัตราแลกเปลี่ยนประมาณร้อยละ 82.77 ของทรัพย์สินที่อยู่ในรูปเงินตราต่างประเทศ

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ดาโอ จำกัด ขอขอบพระคุณผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุนทุกท่านที่ให้ความไว้วางใจลงทุนในกองทุนรวมของบริษัทจัดการด้วยดี ตลอดมา

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ดาโอ จำกัด

ความเห็นของผู้ดูแลผลประโยชน์



ธนาคารกสิกรไทย
开泰银行 KASIKORNBANK



ความเห็นของผู้ดูแลผลประโยชน์

เรียน ผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุน กองทุนเปิด ดาโอ ยุโรป ออฟฟอร์ทูนิตี้

ข้าพเจ้า บมจ.ธนาคารกสิกรไทย ในฐานะผู้ดูแลผลประโยชน์ได้ดูแลการจัดการกองทุนเปิด ดาโอ ยุโรป ออฟฟอร์ทูนิตี้ ซึ่งจัดการโดย บริษัท หลักทรัพย์จัดการกองทุนดาโอ จำกัดสำหรับระยะเวลาดังแต่วันที่ 1 สิงหาคม พ.ศ. 2566 ถึงวันที่ 31 มกราคม พ.ศ. 2567 แล้ว

ข้าพเจ้าเห็นว่า บริษัท หลักทรัพย์จัดการกองทุนดาโอ จำกัดได้ปฏิบัติหน้าที่ในการจัดการกองทุนเปิด ดาโอ ยุโรป ออฟฟอร์ทูนิตี้ เหมาะสมตามสมควรแห่งวัตถุประสงค์ ที่ได้กำหนดไว้ในโครงการและภายใต้พระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535

ขอแสดงความนับถือ
บมจ. ธนาคารกสิกรไทย

(นายวิรัตน์ ลิ้มทองธรรม)

รองผู้อำนวยการฝ่ายบริการธุรกิจหลักทรัพย์

(นายวุฒิชัย รอดภัย)

หัวหน้าส่วนฝ่ายบริการธุรกิจหลักทรัพย์

วันที่ 9 กุมภาพันธ์ พ.ศ. 2567

ตารางสรุปผลการดำเนินงานของกองทุน

วันจดทะเบียนกองทุน 6 สิงหาคม 2564

วันสิ้นสุดรอบบัญชี 31 มกราคม 2567

DAOL-EUROPE	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี	Since inception
ผลการดำเนินงานของกองทุน	0.03%	13.21%	-4.42%	-1.88%	-10.46%
ดัชนีชี้วัด	3.35%	12.84%	6.27%	18.68%	3.48%
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	0.05%	8.55%	1.03%	1.65%	-
ความผันผวนของผลการดำเนินงาน	11.98%	13.40%	14.13%	14.59%	18.54%
ความผันผวนของดัชนีชี้วัด	10.86%	12.46%	12.66%	14.78%	18.25%

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 ยุโรป ออฟฟอร์ดยูนิตี (DAOL-EUROPE)

งบแสดงฐานะทางการเงิน

ณ วันที่ 31 มกราคม 2567

	บาท
สินทรัพย์	
เงินลงทุนตามมูลค่ายุติธรรม (49,329,813.86 บาท)	45,776,521.98
เงินฝากธนาคาร	2,880,831.10
ลูกหนี้	
จากดอกเบี้ย และเงินปันผล	442.99
รวมสินทรัพย์	48,657,796.07
หนี้สิน	
เจ้าหนี้	
จากการรับซื้อคืนหน่วยลงทุน	104.98
จากสัญญาตราสารอนุพันธ์	317,412.57
ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย	97,705.37
หนี้สินอื่นๆ	2,527.02
รวมหนี้สิน	417,749.94
สินทรัพย์สุทธิ	48,240,046.13
สินทรัพย์สุทธิ:	
ทุนที่ได้รับจากผู้ถือหน่วยลงทุน	63,524,404.31
บัญชีปรับสมดุล	33,251,757.71
กำไรสะสม (ยอดยกมา)	(45,349,518.03)
กำไร (ขาดทุน) จากการดำเนินงาน	(3,186,597.86)
สินทรัพย์สุทธิ	48,240,046.13
จำนวนหน่วยลงทุนที่จำหน่ายแล้วทั้งหมด ณ วันสิ้นรอบบัญชี (หน่วย)	6,352,440.4273
สินทรัพย์สุทธิต่อหน่วย	7.5939

หมายเหตุ : * งบการเงินนี้ยังไม่ได้ผ่านการสอบทานหรือรับรองจากผู้สอบบัญชี

กองทุนเปิด ดาโอ ยูโรป ออฟฟเวอร์นูตี (DAOL-EUROPE)

งบกำไรขาดทุน

สำหรับรอบบัญชีตั้งแต่วันที่ 1 สิงหาคม 2566 ถึงวันที่ 31 มกราคม 2567

	บาท
รายได้จากการลงทุน	
รายได้ดอกเบี้ย และเงินปันผล	21,264.78
รวมรายได้	21,264.78
ค่าใช้จ่าย	
ค่าธรรมเนียมการจัดการ	410,588.40
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์	6,843.11
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน	82,117.65
ค่าธรรมเนียมวิชาชีพ	17,595.92
ค่าใช้จ่ายอื่นๆ	46,363.43
รวมค่าใช้จ่าย	563,508.51
รายได้จากการลงทุนสุทธิ	(542,243.73)
รายการกำไร (ขาดทุน) สุทธิจากเงินลงทุน	
รายการกำไร (ขาดทุน) สุทธิที่เกิดขึ้นจากเงินลงทุน	(2,282,464.74)
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิที่ยังไม่เกิดขึ้นจากสัญญาอนุพันธ์	883,800.64
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิจากอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ	(1,245,690.03)
รวมรายการกำไร (ขาดทุน) สุทธิจากเงินลงทุนที่เกิดขึ้นและยังไม่ได้เกิดขึ้น	(2,644,354.13)
การเพิ่มขึ้น (ลดลง) ในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงาน	(3,186,597.86)

หมายเหตุ : * งบการเงินนี้ยังไม่ได้ผ่านการสอบทานหรือรับรองจากผู้สอบบัญชี

กองทุนเปิด ดาโอ ยุโรป ออฟฟเวอร์พูนิตี้ (DAOL-EUROPE)

งบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน

ณ วันที่ 31 มกราคม 2567

		วันครบกำหนด	อัตราดอกเบี้ย ร้อยละ	จำนวนหน่วย / มูลค่าที่ตราไว้	มูลค่ายุติธรรม (บาท)	% เงินลงทุน
หน่วยลงทุน						
Berenberg European Focus Fund M	BEREUF1 LX			5,021.7320	29,363,500.72	64.15
Janus Henderson Horizon Pan European Smaller Companies Fund I2 EUR	HENPCEU LX			2,541.2020	7,708,778.62	16.84
iShares STOXX Europe 600 UCITS ETF (DE)	SXXPIEX GY			4,726.0000	8,704,242.64	19.01
รวมหน่วยลงทุน					45,776,521.98	100.00
รวมเงินลงทุน					45,776,521.98	100.00

รายละเอียดการลงทุน การกู้ยืมเงิน และการก่อภาระผูกพัน

รายละเอียดการลงทุน การกู้ยืมเงินและการก่อภาระผูกพันของ

กองทุนเปิด ดาโอ ยุโรป ออฟฟเวอร์นูตี (DAOL-EUROPE)

ข้อมูล ณ วันที่ 31 มกราคม 2567

หลักทรัพย์	มูลค่าตามราคาตลาด	%NAV
	(บาท)	
หน่วยลงทุนของกองทุนต่างประเทศ	45,776,521.98	94.89
BERENBERG EUROPEAN FOCUS FUND	29,363,500.72	60.87
JANUS HENDERSON PAN EUROPEAN SMALLER COMPANIES FUND	7,708,778.62	15.98
ISHARES STOXXE600 DE EUR DIS	8,704,242.64	18.04
เงินฝากธนาคาร	2,881,274.09	6.07
ธนาคารกสิกรไทย จำกัด (มหาชน)	806,171.53	1.67
LGT Bank AG, Singapore	2,075,102.56	4.30
สัญญาซื้อขายล่วงหน้า / FORWARD	-317,412.57	-0.66
อื่นๆ	-100,337.37	-0.30
<u>มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ</u>	<u>48,240,046.13</u>	<u>100</u>

รายงานสรุปเงินลงทุน
กองทุนเปิด ดาโอ ยุโรป ออฟฟอร์มูนิตี (DAOL-EUROPE)
ข้อมูล ณ วันที่ 31 มกราคม 2567

กลุ่มของตราสาร	มูลค่าตามราคาตลาด	%NAV
(ก) ตราสารภาครัฐไทยและตราสารภาครัฐต่างประเทศ	-	-
(ข) ตราสารที่ธนาคารที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้น ธนาคารพาณิชย์หรือบริษัทเงินทุน เป็นผู้ออก ผู้ส่งจ่าย ผู้รับรอง ผู้รับอาวัล ผู้สืบทอดหรือผู้ค้ำประกัน	2,881,274.09	6.07
(ค) ตราสารที่มีอันดับความน่าเชื่อถืออยู่ในอันดับที่สามารถลงทุนได้ (Investment grade)	-	-
(ง) ตราสารที่มีอันดับความน่าเชื่อถืออยู่ในอันดับต่ำกว่าอันดับที่สามารถลงทุนได้ (Investment grade) หรือตราสารที่ไม่ได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือ	-	-

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

รายละเอียดและอันดับความน่าเชื่อถือของตราสารแห่งนี้ เงินฝาก หรือ ตราสารกึ่งหนี้กึ่งทุน
ที่กองทุนลงทุนหรือมีไว้เป็นรายตัว

ประเภท	ผู้ออก	วันครบกำหนด	อันดับความน่าเชื่อถือของผู้ออก/ค้ำประกัน	มูลค่าหน้าตั๋ว	มูลค่าตามราคาตลาด
1 เงินฝากธนาคาร	ธนาคารกสิกรไทย จำกัด (มหาชน)		BBB+		806,171.53
2 เงินฝากธนาคาร	LGT Bank AG, Hong Kong		A+		2,075,102.56

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)
 วงรอบบัญชีตั้งแต่วันที่ 1 สิงหาคม 2566 ถึงวันที่ 31 มกราคม 2567

ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (Fund's Direct Expenses)	จำนวนเงิน (บาท)	ร้อยละของมูลค่า ทรัพย์สินสุทธิ
ค่าธรรมเนียมการจัดการ (Management Fee)	410,588.40	0.81
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ (Trustee Fee)	6,843.11	0.01
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน (Registrar Fee)	82,117.65	0.16
ค่าที่ปรึกษาการลงทุน (Advisory Fee)	ไม่มี	ไม่มี
ค่าธรรมเนียมวิชาชีพ	17,595.92	0.03
ค่าธรรมเนียมการทำรายการ	23,968.00	0.05
ค่าธรรมเนียมการใช้ดัชนี	11,743.33	0.02
ค่าใช้จ่ายอื่นๆ	1,104.25	0.00
รวมค่าใช้จ่ายทั้งหมด *	553,960.66	1.08

หมายเหตุ

*ค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวมข้างต้น เป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่มหรือภาษีธุรกิจเฉพาะ หรือภาษีอื่นใดแล้ว

*ไม่รวมค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ และค่าธรรมเนียมต่างๆ ที่เกิดขึ้นจากซื้อขายหลักทรัพย์

ข้อมูลเกี่ยวกับมูลค่าเงินลงทุนและอัตราส่วนการลงทุนในกองทุนรวมอื่น
ที่บริษัทจัดการกองทุนรวมเดียวกันเป็นผู้รับผิดชอบดำเนินการ

- ไม่มี -

รายละเอียดเกี่ยวกับค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์
ของรอบบัญชีตั้งแต่วันที่ 1 สิงหาคม 2566 – 31 มกราคม 2567

ชื่อบริษัทนายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์	ค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์	ร้อยละของค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์รวม
LGT Bank AG, Hong Kong	30,183.40	100.00
รวม		100.00

รายละเอียดเกี่ยวกับการรับผลประโยชน์ตอบแทนเนื่องจากการที่ใช้บริการบุคคลอื่นๆ

ลำดับ	บริษัทที่ให้ผลประโยชน์	ผลประโยชน์ที่ได้รับ	เหตุผลในการรับผลประโยชน์
1	บริษัทหลักทรัพย์ ดาโอ (ประเทศไทย) จำกัด	ข่าวสาร และบทวิเคราะห์	เพื่อใช้เป็นข้อมูลในการประกอบการตัดสินใจลงทุน
2	บริษัทหลักทรัพย์ ยูไอบี เคย์เอียน (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)		
3	LGT Bank (Singapore) Ltd		
4	บริษัทหลักทรัพย์ ซีจีเอส อินเตอร์เนชั่นแนล (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 สิงหาคม 2566 – 31 มกราคม 2567

89.00%

ข้อมูลการลงทุน และเหตุผลในกรณีที่การลงทุนไม่เป็นไปตามนโยบายการลงทุน
ของรอบบัญชีตั้งแต่วันที่ 1 สิงหาคม 2566 – 31 มกราคม 2567

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

รายชื่อบุคคลที่เกี่ยวข้องกับการทำธุรกรรมของกองทุนรวม
ของรอบบัญชีตั้งแต่วันที่ 1 สิงหาคม 2566 – 31 มกราคม 2567

รายชื่อบุคคลที่เกี่ยวข้อง
- ไม่มี -

หมายเหตุ :

- ผู้ลงทุนสามารถตรวจสอบรายละเอียดการทำธุรกรรมกับบุคคลที่เกี่ยวข้องกับกองทุนรวมได้ที่บริษัทจัดการโดยตรง หรือที่
เว็บไซต์ของบริษัทจัดการ www.daolinvestment.co.th

ข้อมูลการถือหน่วยลงทุนเกิน 1 ใน 3
ณ วันที่ 31 มกราคม 2567

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

หมายเหตุ :

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