

รายงานประจำรอบ 6 เดือนแรก

1 มกราคม 2566 – 30 มิถุนายน 2566

กองทุนเปิด ดาโอ โกลบอล ซีเคียวริตี้ อีควิตี้

DAOL GLOBAL SECURITY EQUITY FUND

(DAOL-GSECURE)

ความเห็นของบริษััทจัดการ

เรียน ผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุน
กองทุนเปิด ดาโอ โกลบอล ซีเคียวริตี้ อีควิตี้ (DAOL-GSECURE)

กองทุนเปิด ดาโอ โกลบอล ซีเคียวริตี้ อีควิตี้ จะเน้นลงทุนในหน่วยลงทุนของ CS Investment Funds 2-Credit Suisse (Lux) Security Equity Fund (กองทุนหลัก) Class IB ในสกุลเงินดอลลาร์สหรัฐ (USD) เพียงกองทุนเดียว โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน ตั้งแต่ 1 มกราคม – 30 มิถุนายน 2566 กองทุนหลักปรับตัวเพิ่มขึ้น 14.46% เป็นผลมาจากนักลงทุนคลายความกังวลเกี่ยวกับการชะลอตัวของเศรษฐกิจและอัตราเงินเฟ้อ จึงทำให้สินทรัพย์เสี่ยงกลับมาได้รับความสนใจจากนักลงทุนอีกครั้ง ผลตอบแทนกองทุน DAOL-GSECURE ตั้งแต่ 1 มกราคม – 30 มิถุนายน 2566 ปรับตัวขึ้น 10.14% ในช่วงระยะเวลา 6 เดือนที่ผ่านมา

การเปลี่ยนแปลงที่เกิดขึ้นในรอบบัญชีที่ผ่านมาเมื่อเทียบกับรอบบัญชีก่อนหน้า

กองทุนจดทะเบียนในวันที่ 31 มกราคม 2563 และมีสถานะการลงทุน ณ วันที่ 30 มิถุนายน 2566 ดังนี้ กองทุนลงทุนในหน่วยลงทุนกองทุนต่างประเทศร้อยละ 95.31 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิ และมีเงินฝากเพื่อการดำเนินงานร้อยละ 6.31 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิ โดยกองทุนมีการทำสัญญาป้องกันความเสี่ยงอัตราแลกเปลี่ยนประมาณร้อยละ 79.59 ของทรัพย์สินที่อยู่ในรูปเงินตราต่างประเทศ

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ดาโอ จำกัด ขอขอบพระคุณผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุนทุกท่านที่ให้ความไว้วางใจลงทุนในกองทุนรวมของบริษััทจัดการด้วยดี ตลอดมา

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ดาโอ จำกัด

ความเห็นของผู้ดูแลผลประโยชน์



รายงานความเห็นผู้ดูแลผลประโยชน์

เสนอ ผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุน
กองทุนเปิด ดาโอ โกลบอล ซีเคียวริตี้ อีควิตี้

ตามที่ ธนาคารกรุงศรีอยุธยา จำกัด (มหาชน) ("ธนาคารฯ") ในฐานะผู้ดูแลผลประโยชน์ กองทุนเปิด ดาโอ โกลบอล ซีเคียวริตี้ อีควิตี้ ("กองทุน") ซึ่งมี บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ดาโอ จำกัด เป็นผู้จัดตั้งและจัดการกองทุน ได้ปฏิบัติหน้าที่ดูแลผลประโยชน์ของกองทุนดังกล่าว สำหรับรอบระยะเวลาหกเดือนของกองทุน ตั้งแต่วันที่ 1 มกราคม 2566 ถึงวันที่ 30 มิถุนายน 2566

ธนาคารฯ เห็นว่า บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ดาโอ จำกัด ได้ปฏิบัติหน้าที่ในการจัดการโดยถูกต้องตามที่ควรตามวัตถุประสงค์ที่ได้กำหนดไว้ในโครงการจัดการที่ได้รับอนุมัติจากสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ และภายใต้พระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535

ผู้ดูแลผลประโยชน์

ธนาคารกรุงศรีอยุธยา จำกัด (มหาชน)

(นายจตุภูมิ ปรีชญางังศิริวิชา)

ผู้อำนวยการ ผู้บริหารฝ่าย

ฝ่ายพัฒนาผลิตภัณฑ์และความคุ้มครองผู้ลงทุน

ฝ่ายพัฒนาผลิตภัณฑ์และความคุ้มครองผู้ลงทุน

วันที่ 5 กรกฎาคม 2566

Bank of Ayudhya Public Company Limited
1222 Rama III Road, Bang Phongphang
Van Nawa, Bangkok 10120 Thailand
Reg. No. 0107536001079
T +66 (0) 2296 2000
www.krungsri.com

ธนาคารกรุงศรีอยุธยา จำกัด (มหาชน)
1222 ถนนพระรามที่ 3 แขวงบางโพงพาง
เขตยานนาวา กรุงเทพมหานคร 10120
ทะเบียนเลขที่ 0107536001079
โทรศัพท์ +66 (0) 2296 2000
www.krungsri.com

04.02.056-1 (300-04/66)

ตารางสรุปผลการดำเนินงานของกองทุน

วันจดทะเบียนกองทุน 31 มกราคม 2563

วันสิ้นสุดรอบบัญชี 30 มิถุนายน 2566

DAOL-GSECURE	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี	3 ปี	ตั้งแต่จัดตั้ง
ผลการดำเนินงานของกองทุน	10.17%	3.10%	10.17%	9.68%	5.69%	4.55%
ดัชนีชี้วัด	17.89%	10.65%	17.89%	17.88%	17.09%	12.90%
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	10.44%	3.97%	10.44%	7.61%	5.71%	-
ความผันผวนของผลการดำเนินงาน	16.94%	14.78%	16.94%	23.05%	21.33%	24.97%
ความผันผวนของดัชนีชี้วัด	14.44%	13.33%	14.44%	16.95%	15.93%	21.09%

หมายเหตุ

- ดัชนีชี้วัด คือ ดัชนี MSCI World ESG Leaders สัดส่วน 100.00% ปรับด้วยอัตราแลกเปลี่ยน เพื่อคำนวณผลตอบแทนเป็นสกุลเงินบาท ณ วันที่คำนวณผลตอบแทน
- เอกสารการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวมฉบับนี้ ได้จัดทำขึ้นตามมาตรฐานการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวมของสมาคมบริษัทจัดการลงทุน
- ผลการดำเนินงานในอดีต มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

งบดุล งบกำไรขาดทุน และงบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน

กองทุนเปิด ดาโอ โกลบอล ซีเคียวริตี้ อีควิตี้ (DAOL-GSECURE)

งบแสดงฐานะทางการเงิน

ณ วันที่ 30 มิถุนายน 2566

	บาท
สินทรัพย์	
เงินลงทุนตามมูลค่ายุติธรรม (115,992,061.86 บาท)	119,468,273.41
เงินฝากธนาคาร	70,057,121.94
ลูกหนี้	
จากดอกเบี้ย และเงินปันผล	790.31
ค่าใช้จ่ายรอการตัดบัญชี	12,524.62
รวมสินทรัพย์	189,538,710.28
หนี้สิน	
เจ้าหนี้	
จากการซื้อเงินลงทุน	67,068,015.68
จากการรับซื้อคืนหน่วยลงทุน	41,169.19
จากสัญญาตราสารอนุพันธ์	1,641,637.89
ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย	126,403.03
หนี้สินอื่นๆ	1,068,508.97
รวมหนี้สิน	69,945,734.76
สินทรัพย์สุทธิ	119,592,975.52
สินทรัพย์สุทธิ:	
ทุนที่ได้รับจากผู้ถือหน่วยลงทุน	102,721,070.69
บัญชีปรับสมดุล	(16,761,795.54)
กำไรสะสม (ยอดยกมา)	25,105,860.95
กำไร (ขาดทุน) จากการดำเนินงาน	8,527,839.42
สินทรัพย์สุทธิ	119,592,975.52
จำนวนหน่วยลงทุนที่จำหน่ายแล้วทั้งหมด ณ วันสิ้นรอบบัญชี (หน่วย)	10,272,107.0389
สินทรัพย์สุทธิต่อหน่วย	11.6425

หมายเหตุ : * งบการเงินนี้ยังไม่ได้ผ่านการสอบทานหรือรับรองจากผู้สอบบัญชี

กองทุนเปิด ดาโอ โกลบอล ซีเคียวริตี้ อีควิตี้ (DAOL-GSECURE)

งบกำไรขาดทุน

สำหรับรอบบัญชีตั้งแต่วันที่ 1 มกราคม 2566 ถึงวันที่ 30 มิถุนายน 2566

	บาท
รายได้จากการลงทุน	
รายได้ดอกเบี้ย และเงินปันผล	4,316.58
รวมรายได้	4,316.58
ค่าใช้จ่าย	
ค่าธรรมเนียมการจัดการ	417,349.73
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์	9,738.11
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน	83,469.93
ค่าธรรมเนียมวิชาชีพ	17,356.09
ค่าใช้จ่ายอื่นๆ	347,572.27
รวมค่าใช้จ่าย	875,486.13
รายได้จากการลงทุนสุทธิ	(871,169.55)
รายการกำไร (ขาดทุน) สุทธิจากเงินลงทุน	
รายการกำไร (ขาดทุน) สุทธิที่เกิดขึ้นจากเงินลงทุน	10,029,109.14
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิที่ยังไม่เกิดขึ้นจากสัญญาอนุพันธ์	(2,050,972.92)
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิจากอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ	1,420,872.75
รวมรายการกำไร (ขาดทุน) สุทธิจากเงินลงทุนที่เกิดขึ้นและยังไม่ได้เกิดขึ้น	9,399,008.97
การเพิ่มขึ้น (ลดลง) ในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงาน	8,527,839.42

หมายเหตุ : * งบการเงินนี้ยังไม่ได้ผ่านการสอบทานหรือรับรองจากผู้สอบบัญชี

กองทุนเปิด ดาโอ โกลบอล ซีเคียวริตี้ อีควิตี้ (DAOL-GSECURE)

งบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน

ณ วันที่ 30 มิถุนายน 2566

	วันครบกำหนด	อัตราดอกเบี้ย ร้อยละ	จำนวนหน่วย / มูลค่าที่ตราไว้	มูลค่ายุติธรรม (บาท)	% เงินลงทุน
หน่วยลงทุน					
CS Investment Funds 2 - Credit Suisse (Lux)	CSEIUSD LX		1,224.3390	119,468,273.41	100.00
Security Equity Fund - Class IB USD					
รวมหน่วยลงทุน				119,468,273.41	100.00
รวมเงินลงทุน				119,468,273.41	100.00

รายละเอียดการลงทุน การกู้ยืมเงิน และการก่อภาระผูกพัน

รายละเอียดการลงทุน การกู้ยืมเงินและการก่อภาระผูกพันของ
กองทุนเปิด ดาโอ โกลบอล ซีเคียวริตี้ อีควิตี้ (DAOL-GSECURE)
ข้อมูล ณ วันที่ 30 มิถุนายน 2566

หลักทรัพย์	มูลค่าตามราคาตลาด (บาท)	%NAV
หน่วยลงทุนของกองทุนต่างประเทศ	115,889,741.99	95.31
CS LUX SECURITY EQUITY-IBUSD	115,889,741.99	95.31
เงินฝากธนาคาร	7,676,275.87	6.31
ธนาคารกรุงศรีอยุธยา จำกัด (มหาชน)	2,070,987.68	1.70
JP MORGAN CHASE BANK, LONDON	5,605,288.19	4.61
สัญญาซื้อขายล่วงหน้า / FORWARD	-1442,175.77	-0.36
อื่นๆ	-533,640.02	-1.26
<u>มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ</u>	<u>121,590,202.07</u>	<u>100</u>

รายงานสรุปเงินลงทุน

กองทุนเปิด ดาโอ โกลบอล ซีเคียวริตี้ อีควิตี้ (DAOL-GSECURE)

ข้อมูล ณ วันที่ 30 มิถุนายน 2566

กลุ่มของตราสาร	มูลค่าตามราคาตลาด	%NAV
(ก) ตราสารภาครัฐไทยและตราสารภาครัฐต่างประเทศ	-	-
(ข) ตราสารที่ธนาคารที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้น ธนาคารพาณิชย์หรือบริษัทเงินทุน เป็นผู้ออก ผู้ส่งจ่าย ผู้รับรอง ผู้รับอาวัล ผู้สืบทอด หรือผู้ค้ำประกัน	7,676,275.87	6.31
(ค) ตราสารที่มีอันดับความน่าเชื่อถืออยู่ในอันดับที่สามารถลงทุน ได้ (investment grade)	-	-
(ง) ตราสารที่มีอันดับความน่าเชื่อถืออยู่ในอันดับต่ำกว่า อันดับที่สามารถลงทุนได้ (investment grade) หรือ ตราสารที่ไม่ได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือ	-	-

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

รายละเอียดและอันดับความน่าเชื่อถือของตราสารแห่งนี้ เงินฝาก หรือ ตราสารหนี้ที่ลงทุน

ที่ลงทุนลงทุนหรือมีไว้เป็นรายตัว

ประเภท	ผู้ออก	วันครบกำหนด	อันดับความน่าเชื่อถือของผู้ออก/ค่าประกัน	มูลค่าหน้าตั๋ว	มูลค่าตามราคาตลาด
1 เงินฝากธนาคาร	ธนาคาร กรุงศรีอยุธยา จำกัด (มหาชน)		AAA(tha)		2,070,987.68
2 เงินฝากธนาคาร	JP MORGAN CHASE BANK, LONDON		A-		5,605,288.19

คำอธิบายการจัดอันดับตราสารของสถาบันจัดอันดับความน่าเชื่อถือ

ระดับการลงทุน	TRIS	Fitch	Moody's	S&P	คำอธิบาย
ระดับที่น่าลงทุน	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
ระดับที่ต่ำกว่าน่าลงทุน	ต่ำกว่า BBB	ต่ำกว่า BBB(tha)	ต่ำกว่า Baa	ต่ำกว่า BBB	ความเสี่ยงสูงที่จะไม่สามารถชำระหนี้ได้ตามกำหนด

ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุน

แบบแสดงค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม
กองทุนเปิด ดาโอ โกลบอล ซีเคียวริตี้ อีควิตี้ (DAOL-GSECURE)
ของรอบบัญชีตั้งแต่วันที่ 1 มกราคม 2566 ถึงวันที่ 30 มิถุนายน 2566

ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (Fund's Direct Expenses)	จำนวนเงิน (บาท)	ร้อยละของมูลค่า ทรัพย์สินสุทธิ
ค่าธรรมเนียมการจัดการ (Management Fee)	417,349.73	0.80
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ (Trustee Fee)	9,738.11	0.02
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน (Registrar Fee)	83,469.93	0.16
ค่าที่ปรึกษาการลงทุน (Advisory Fee)	ไม่มี	ไม่มี
ค่าธรรมเนียมวิชาชีพ	17,356.09	0.03
ค่าธรรมเนียมการใช้ดัชนี	21,292.84	0.04
ค่าใช้จ่ายอื่นๆ	1,752.49	0.00
รวมค่าใช้จ่ายทั้งหมด *	550,959.19	1.05

หมายเหตุ

*ค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวมข้างต้น เป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่มหรือภาษีธุรกิจเฉพาะ หรือภาษีอื่นใดแล้ว

ข้อมูลเกี่ยวกับมูลค่าเงินลงทุนและอัตราส่วนการลงทุนในกองทุนรวมอื่น
ที่บริษัทจัดการกองทุนรวมเดียวกันเป็นผู้รับผิดชอบดำเนินการ

- ไม่มี -

รายละเอียดเกี่ยวกับค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์
ของรอบบัญชีตั้งแต่วันที่ 1 มกราคม 2566 – 30 มิถุนายน 2566

ชื่อบริษัทนายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์	ค่านายหน้าซื้อขาย หลักทรัพย์	ร้อยละของค่านายหน้าซื้อ ขายหลักทรัพย์รวม
DAOL Securities (Thailand) Public Company Limited	571,095.51	100.00
รวม		100.00

รายละเอียดเกี่ยวกับการรับผลประโยชน์ตอบแทนเนื่องจากการที่ใช้บริการบุคคลอื่นๆ

ลำดับ	บริษัทที่ให้ผลประโยชน์	ผลประโยชน์ที่ได้รับ	เหตุผลในการรับ ผลประโยชน์
1	บริษัทหลักทรัพย์ ดาโอ (ประเทศไทย) จำกัด	ข่าวสาร และบท วิเคราะห์	เพื่อใช้เป็นข้อมูลใน การประกอบการ ตัดสินใจลงทุน
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 เคนดิต สวิส (ประเทศไทย) จำกัด		
9	บริษัทหลักทรัพย์ เมย์แบงก์ (ประเทศไทย) จำกัด		
10	บริษัทหลักทรัพย์ หยวนต้า (ประเทศไทย) จำกัด		

ข้อมูลอัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุนของกองทุนรวม (PTR)
ของรอบบัญชีตั้งแต่วันที่ 1 มกราคม 2566 – 30 มิถุนายน 2566

513.49%

ข้อมูลการลงทุน และเหตุผลในกรณีที่การลงทุนไม่เป็นไปตามนโยบายการลงทุน
ของรอบบัญชีตั้งแต่วันที่ 1 มกราคม 2566 – 30 มิถุนายน 2566

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

รายชื่อบุคคลที่เกี่ยวข้องกับการทำธุรกรรมของกองทุนรวม
ของรอบบัญชีตั้งแต่วันที่ 1 มกราคม 2566 – 30 มิถุนายน 2566

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

หมายเหตุ :

- ผู้ลงทุนสามารถตรวจสอบรายละเอียดการทำธุรกรรมกับบุคคลที่เกี่ยวข้องกับกองทุนรวมได้ที่บริษัทจัดการโดยตรง หรือที่เว็บไซต์ของบริษัทจัดการ www.daolinvestment.co.th

ข้อมูลการถือหน่วยลงทุนเกิน 1 ใน 3
ณ วันที่ 30 มิถุนายน 2566

ชื่อกองทุน	สัดส่วนการถือหน่วยลงทุน (ร้อยละ)	จำนวนกลุ่มบุคคลใด บุคคลหนึ่ง
กองทุนเปิด ดาโอ โกลบอล ซีเคียวริตี้ อีควิตี้ (DAOL-GSECURE)	- ไม่มี -	

หมายเหตุ :

- ผู้ลงทุนสามารถตรวจสอบข้อมูลการถือหน่วยลงทุนเกิน 1 ใน 3 ได้ที่เว็บไซต์ของบริษัทจัดการ

www.daolinvestment.co.th