

กองทุนเปิด ดาโอ ตราสารหนี้ 6M3 ห้ามขายผู้ลงทุนรายย่อย

DAOL BOND FUND 6M3 NOT FOR RETAIL INVESTORS (DAOL-BOND6M3)

ประเภทกองทุนรวม/ กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมตราสารหนี้
- กองทุนรวมที่มีนโยบายเปิดให้มีการลงทุนในกองทุนรวมอื่นภายใต้ บลจ. เดียวกัน
- กองทุนที่ลงทุนแบบมีความเสี่ยงทั้งในและต่างประเทศ
- กลุ่มกองทุนรวม: Miscellaneous

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- ลงทุนในพันธบัตร ตราสารหนี้ ตราสารทางการเงิน และ/หรือเงินฝากที่มีคุณภาพและให้ผลตอบแทนที่เหมาะสม ที่เสนอขายในประเทศและ/หรือต่างประเทศ โดยได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถืออยู่ในอันดับที่สามารถลงทุนได้ (Investment Grade)
- กองทุนอาจลงทุนในตราสารหนี้ที่มีอันดับความน่าเชื่อถือต่ำกว่าที่สามารถลงทุนได้ (Non-Investment Grade) และตราสารหนี้ที่ไม่ได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือ (Unrated Securities) ซึ่งเป็นไปตามหลักเกณฑ์ ก.ล.ต.
- กองทุนอาจลงทุนในพันธบัตรหรือตราสารหนี้ที่เสนอขายในต่างประเทศ โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่เกินร้อยละ 79 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน
- กองทุนอาจลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) โดยมีวัตถุประสงค์เพื่อป้องกันความเสี่ยงจากการลงทุน (Hedging) โดยจะทำการป้องกันความเสี่ยงด้านอัตราแลกเปลี่ยนเต็มจำนวนที่มีการลงทุนดังกล่าว (Fully Hedge)
- กลยุทธ์ในการบริหารจัดการการลงทุน: มีกลยุทธ์การลงทุนครั้งเดียว (buy-and-hold)

ระดับความเสี่ยง

ต่ำ	1	2	3	4	5	6	7	8	สูง
-----	---	---	---	---	---	---	---	---	-----

เสี่ยงปานกลางค่อนข้างต่ำ

ลงทุนในพันธบัตรรัฐบาล และตราสารหนี้เอกชน โดยมีตราสาร non-investment grade / unrated ไม่เกิน 20% ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุนรวม	: 27 มกราคม 2565
วันเริ่มต้น Class	: กองทุนไม่มีการแบ่ง Class
นโยบายการจ่ายเงินปันผล	: ไม่จ่าย
อายุกองทุน	: ไม่กำหนด

ผู้จัดการกองทุนรวม

นางสาวนิสาธิตน์ ชมภูพงษ์	ตั้งแต่ 3 ต.ค. 65
นางสาวรณิษฐา เพชรณรงค์	ตั้งแต่ 27 ม.ค. 65

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (%ต่อปี)

N/A

ดัชนีชี้วัด : ไม่มี เนื่องจากกองทุนมีกลยุทธ์การลงทุนครั้งเดียวและถือครองจนครบกำหนดอายุของทรัพย์สิน หรือครบอายุของรอบการลงทุนของกองทุนรวม หรือครบอายุของกองทุนรวม (buy-and-hold) เพื่อให้ได้ผลตอบแทนที่คาดหวังตามระยะเวลาที่กำหนดไว้

ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปีกลุ่ม (%ต่อปี)

	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี
กองทุน	-	0.31%	0.60%	-
ดัชนีชี้วัด	-	-	-	-
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	-	-	-	-
ความผันผวนกองทุน	-	0.02%	0.14%	-
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	-	-	-	-
	3 ปี	5 ปี	10 ปี	ตั้งแต่จัดตั้ง
กองทุน	-	-	-	1.15%
ดัชนีชี้วัด	-	-	-	-
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	-	-	-	-
ความผันผวนกองทุน	-	-	-	0.15%
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	-	-	-	-

คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวมมิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต : ได้รับการรับรองจาก CAC
จัดอันดับกองทุน Morningstar : N/A

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือบริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่องได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

การซื้อหน่วยลงทุน

วันทำการซื้อ : ทุกรอบ 6 เดือน
 เวลาทำการ : 9.00 - 15.30 น.
 การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ : 5,000 บาท
 การซื้อครั้งถัดไปขั้นต่ำ : 1 บาท

การขายคืนหน่วยลงทุน

วันทำการขายคืน : ทุกรอบ 6 เดือน
 เวลาทำการ : 9.00 - 15.30 น.
 การขายคืนขั้นต่ำ : ไม่กำหนด
 ยอดคงเหลือขั้นต่ำ : ไม่กำหนด
 ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน : T+1

หมายเหตุ: ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน : ภายใน 5 วันทำการนับแต่วันคำนวณราคาขายคืนหน่วยลงทุน ทั้งนี้ ปัจจุบันผู้ถือหน่วยลงทุนจะได้รับเงินค่าขายคืนหน่วยลงทุน ภายใน 1 วันทำการนับแต่วันทำรายการ

- วันส่งคำสั่งขายคืนของรอบถัดไป : 20 ม.ค. -25 ม.ค. 66
- วันส่งคำสั่งซื้อของรอบถัดไป : 20 ม.ค. -31 ม.ค. 66
- วันทำการซื้อ-ขายหน่วยลงทุน : 31 ม.ค. 66
- วันรับเงินค่าขายคืนหน่วยลงทุน : 1 ก.พ. 66

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	1.07%	0.192%
รวมค่าใช้จ่าย	4.28%	0.41075%

หมายเหตุ

1. ค่าธรรมเนียมรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว
2. รวมค่าใช้จ่าย ประกอบด้วย ค่าธรรมเนียมการจัดการ ผู้ดูแลผลประโยชน์ นายทะเบียน และค่าใช้จ่ายอื่น โดยอัตราที่เรียกเก็บจริงของค่าใช้จ่ายอื่นเป็นข้อมูลตามรอบปีบัญชีหรือรอบ 6 เดือนล่าสุดของกองทุน
3. ในกรณีที่กองทุนได้รับอัตราผลตอบแทนสูงกว่าอัตราผลตอบแทนที่ได้เปิดเผยไว้ตอนเสนอขายหน่วยลงทุนในแต่ละรอบ การซื้อขายหน่วยลงทุน บริษัทยุติการอาจเรียกเก็บค่าธรรมเนียมการจัดการหรือค่าธรรมเนียมนายทะเบียนหน่วยลงทุนเพิ่ม ทั้งนี้ ไม่เกินเพดานค่าธรรมเนียมการจัดการหรือค่าธรรมเนียมนายทะเบียนหน่วยลงทุนร้อยละ 1.07 ต่อปี
4. บริษัทจัดการอาจลงทุนหรือมีไว้ซึ่งหน่วยลงทุนของกองทุนรวมภายใต้การบริหารของบริษัทยุติการเดียวกัน โดยเป็นไปตามหลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการที่สำนักงาน ก.ล.ด. กำหนด ทั้งนี้ ในกรณีที่กองทุนลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมอื่น ซึ่งอยู่ภายใต้การจัดการของบริษัทยุติการ กองทุนจะไม่เรียกเก็บค่าธรรมเนียมซ้ำซ้อนกับกองทุนรวมปลายทางที่กองทุนลงทุน

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การขาย	ไม่มี	ไม่มี
การรับซื้อคืน	ไม่มี	ไม่มี
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า	ไม่มี	ไม่มี
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก	ไม่มี	ไม่มี
การโอนหน่วย	ตามที่นายทะเบียนเรียกเก็บ	ตามที่นายทะเบียนเรียกเก็บ

หมายเหตุ

1. ค่าธรรมเนียมรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว
2. บริษัทยุติการอาจลงทุนหรือมีไว้ซึ่งหน่วยลงทุนของกองทุนรวมภายใต้การบริหารของบริษัทยุติการเดียวกัน โดยเป็นไปตามหลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการที่สำนักงาน ก.ล.ด. กำหนด ทั้งนี้ ในกรณีที่กองทุนลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมอื่น ซึ่งอยู่ภายใต้การจัดการของบริษัทยุติการ กองทุนจะไม่เรียกเก็บค่าธรรมเนียมซ้ำซ้อนกับกองทุนรวมปลายทางที่กองทุนลงทุน
3. บริษัทยุติการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน

ประเภททรัพย์สิน	สัดส่วน % ของพอร์ต
BILL OF EXCHANGE	84.77%
BOND	15.04%
SAVING ACCOUNT	0.19%

ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก

ชื่อหลักทรัพย์	สัดส่วน % ของพอร์ต
ตั๋วแลกเงินระยะสั้นของบริษัท หลักทรัพย์ กรุงเทพ เอ็กส์เชนจ์ จำกัด	21.20%
ตั๋วแลกเงินระยะสั้นของ บริษัท เอเชีย เซอร์วิส จำกัด (มหาชน)	21.20%
ตั๋วแลกเงิน บริษัท เสนอสิริ จำกัด (มหาชน)	21.19%
ตั๋วแลกเงินของ บริษัท หลักทรัพย์ เพื่อดูธุรกิจหลักทรัพย์ จำกัด (มหาชน)	21.18%
ตั๋วเงินคลัง งวดที่ (DM)22/182/65	15.04%

ข้อมูลเชิงสถิติ

Maximum Drawdown	: 0.00%
Recovering Period	: 0 เดือน
FX Hedging	: N/A
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน	: 0.00%
Sharpe Ratio	: N/A
Alpha	: N/A
Beta	: N/A
Tracking Error	: N/A
อายุเฉลี่ยของตราสารหนี้	: 31 วัน
Yield to Maturity	: 1.6750%

การจัดสรรการลงทุนในต่างประเทศ

N/A

การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม/ผู้ออกตราสาร 5 อันดับแรก

ผู้ออกตราสาร	สัดส่วน % ของพอร์ต
บริษัท หลักทรัพย์ กรุงเทพ เอ็กส์เชนจ์ จำกัด	21.20%
บริษัท เอเชีย เซอร์วิส จำกัด (มหาชน)	21.20%
บริษัท เสนอสิริ จำกัด (มหาชน)	21.19%
บริษัท หลักทรัพย์ เพื่อดูธุรกิจ หลักทรัพย์ จำกัด (มหาชน)	21.18%
กระทรวงการคลัง	15.04%

การจัดสรรการลงทุนตามอันดับความน่าเชื่อถือ (%)

อันดับความน่าเชื่อถือ	ในประเทศ	national	international
Gov bond	15.04 %		
AAA	0.00%		
AA	21.2%		
A	21.2%		
BBB	42.37%		
ต่ำกว่า BBB	0.00%		
Unrated	0.00%		

คำอธิบาย

Maximum Drawdown เปรอ์เซ็นต์ผลขาดทุนสูงสุดของกองทุนรวมในระยะเวลา 5 ปีย้อนหลัง (หรือตั้งแต่จัดตั้งกองทุนนี้ที่ยังไม่ครบ 5 ปี) โดยวัดจากระดับ NAV ต่อหน่วยที่จุดสูงสุดไปจนถึงจุดต่ำสุดในช่วงที่ NAV ต่อหน่วยปรับตัวลดลง ค่า Maximum Drawdown เป็นข้อมูลที่จะช่วยให้ทราบถึงความเสี่ยงที่อาจจะขาดทุนจากการลงทุนในกองทุนรวม

Recovering Period ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาตั้งแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินลงทุนเริ่มต้นใช้เวลานานเท่าใด

FX Hedging เปรอ์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

อัตราส่วนทุนเวียนการลงทุน ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตกองทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลานึง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อหลักทรัพย์กับผลรวมของมูลค่าการขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 1 ปีหารด้วยมูลค่า NAV ของกองทุนรวมเฉลี่ยในรอบระยะเวลาเดียวกัน กองทุนรวมที่มีค่า portfolio turnover สูง บ่งชี้ถึงการซื้อขายหลักทรัพย์บ่อยครั้งของผู้จัดการกองทุนและทำให้มีต้นทุนการซื้อขายหลักทรัพย์ที่สูง จึงต้องพิจารณาเปรียบเทียบกับผลการดำเนินงานของกองทุนรวมเพื่อประเมินความคุ้มค่าของการซื้อขายหลักทรัพย์ดังกล่าว

Sharpe Ratio อัตราส่วนระหว่างผลตอบแทนส่วนเพิ่มของกองทุนรวมเปรียบเทียบกับความเสี่ยงจากการลงทุน โดยคำนวณจากผลต่างระหว่างอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมกับอัตราผลตอบแทนที่ปราศจากความเสี่ยง (risk-free rate) เปรียบเทียบกับค่าเบี่ยงเบนมาตรฐาน (standard deviation) ของกองทุนรวม ค่า Sharpe Ratio สะท้อนถึงอัตราผลตอบแทนที่กองทุนรวมควรได้รับเพิ่มขึ้นเพื่อชดเชยกับความเสี่ยงที่กองทุนรวมรับมา โดยกองทุนรวมที่มีค่า Sharpe Ratio สูงกว่าจะเป็นกองทุนที่มีประสิทธิภาพในการบริหารจัดการลงทุนที่ดีกว่า เนื่องจากได้รับผลตอบแทนส่วนเพิ่มที่สูงกว่าภายใต้ระดับความเสี่ยงเดียวกัน

Alpha ผลตอบแทนส่วนเกินของกองทุนรวมเมื่อเปรียบเทียบกับดัชนีชี้วัด (benchmark) โดยค่า Alpha ที่สูง หมายถึง กองทุนสามารถสร้างผลตอบแทนได้สูงกว่าดัชนีชี้วัด ซึ่งเป็นผลจากประสิทธิภาพของผู้จัดการกองทุนในการคัดเลือกหรือหาจังหวะเข้าลงทุนในหลักทรัพย์ได้อย่างเหมาะสม

Beta ระดับและทิศทางการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุน โดยเปรียบเทียบกับอัตราการเปลี่ยนแปลงของตลาด Beta น้อยกว่า 1 แสดงว่า หลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนน้อยกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด Beta มากกว่า 1 แสดงว่า หลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนมากกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด

Tracking Error อัตราผลตอบแทนของกองทุนมีประสิทธิภาพในการเลียนแบบดัชนีชี้วัด โดยหาก tracking error ต่ำ หมายถึงกองทุนรวมมีประสิทธิภาพในการสร้างผลตอบแทนให้ใกล้เคียงกับดัชนีชี้วัด กองทุนรวมที่มีค่า tracking error สูง จะมีอัตราผลตอบแทนโดยเฉลี่ยห่างจากดัชนีชี้วัดมากขึ้น

Yield to Maturity อัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในตราสารหนี้โดยถือจนครบกำหนดอายุ ซึ่งคำนวณจากดอกเบี้ยที่จะได้รับในอนาคตตลอดอายุตราสารและเงินต้นที่จะได้รับคืน นำมาคิดลดเป็นมูลค่าปัจจุบัน โดยใช้วัดอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมตราสารหนี้ คำนวณจากค่าเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักของ Yield to Maturity ของตราสารหนี้แต่ละตัวที่กองทุนมีการลงทุน และเนื่องจาก Yield to Maturity มีหน่วยมาตรฐานเป็นเปอร์เซ็นต์ต่อปี จึงสามารถนำไปใช้เปรียบเทียบอัตราผลตอบแทนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีนโยบายถือครองตราสารหนี้จนครบกำหนดอายุและมีลักษณะการลงทุนที่ใกล้เคียงกันได้

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ดาโอ จำกัด

โทรศัพท์: 0-2351-1800 กด 2

www.daolinvestment.co.th

ที่อยู่: 87/2 อาคารซีอาร์ซีทาวเวอร์ ชั้น 52

ออลซีเอ็นซีเพลส ถนนวิภาวดี แขวงลุมพินี

เขตปทุมวัน กรุงเทพมหานคร 10330

รายการทรัพย์สินที่กองทุนจะลงทุน

ตราสารที่ลงทุน ¹	อันดับความน่าเชื่อถือ ของตราสาร/ผู้ออก ตราสาร	เสนองาย		
		ประมาณการ ผลตอบแทน ของตราสาร (ต่อปี)	สัดส่วน การลงทุน โดยประมาณ ¹	ประมาณผลตอบแทน ที่กองทุน จะได้รับ (ต่อปี)
	National Rating			
ตั๋วแลกเงิน บริษัทหลักทรัพย์ กรุงไทย เอ็กซ์ สปริง จำกัด	AA-(tha)/Stable (Fitch)	1.54%	25.00%	0.39%
ตั๋วแลกเงิน บริษัท แสนสิริ จำกัด (มหาชน)	BBB+/Stable (TRIS)	1.73%	25.00%	0.43%
ตั๋วแลกเงินของ บริษัท ทีพีโอ โพลีน จำกัด (มหาชน)	BBB+/Positive (TRIS)	1.73%	25.00%	0.43%
ตั๋วแลกเงินของบริษัทหลักทรัพย์ เพื่อดูธุรกิจ หลักทรัพย์ จำกัด (มหาชน)	BBB/Stable (TRIS)	2.79%	25.00%	0.70%
รวม			100.00%	1.95%
ประมาณการค่าใช้จ่ายกองทุน				0.35%
ประมาณการผลตอบแทนที่ผู้ถือหน่วยลงทุนจะได้รับ (ต่อปี)				1.60%

หมายเหตุ

(1) บริษัทจัดการจะใช้ดุลพินิจในการเปลี่ยนแปลงทรัพย์สินที่ลงทุนหรือสัดส่วนการลงทุนได้ต่อเมื่อเป็นการดำเนินการภายใต้สถานการณ์ที่จำเป็นและสมควรเพื่อรักษาผลประโยชน์ของผู้ลงทุนเป็นสำคัญ โดยไม่ทำให้ความเสียหายของทรัพย์สินที่ลงทุนเปลี่ยนแปลงไปอย่างมีนัยสำคัญ ทั้งนี้ ตราสารที่คาดว่าจะลงทุนอาจมีการเปลี่ยนแปลงเป็นตราสารอื่นหรือเพิ่มเติมตราสารที่ระบุไว้ข้างต้น เช่น ASK / CPF / CPFTH / CPALL / EA / EB / FPT / GUNKUL / JMART / JMT / KGI / KCAR / KTC / KKP / LH / LHBANK / LPN / MPSC / MTC / QH / ROJNA / SAWAD / SCB / SENA / SGP / TFG / THANI / TIDLOR / TISCO / TSE / YUANTA / WHA และ/หรืออาจพิจารณาลงทุนในตราสารอื่นที่อยู่ภายใต้การดูแลของ บลจ. ดาโอ หนึ่ง หากไม่สามารถลงทุนให้เป็นไปตามที่กำหนดไว้เนื่องจากสภาวะตลาดมีการเปลี่ยนแปลงไปอย่างมีนัยสำคัญ ผู้ถือหน่วยลงทุนอาจไม่ได้รับผลตอบแทนตามอัตราที่ประมาณการ

(2) แหล่งที่มาของข้อมูลจากอัตราผลตอบแทนที่เสนองายโดยผู้ออกตราสาร หรือจากผู้ขาย ณ วันที่ 16 มกราคม 2566

(3) ค่าใช้จ่ายของกองทุนนี้อาจมีการเปลี่ยนแปลง แต่จะไม่เกินจากที่ระบุในโครงการ ทั้งนี้ ประมาณการค่าใช้จ่ายกองทุนที่เรียกเก็บจริงที่ประมาณไว้ตอนเสนองายเท่ากับ 0.35% ต่อปี โดยในกรณีที่กองทุนได้รับอัตราผลตอบแทนสูงกว่าอัตราผลตอบแทนที่ได้เปิดเผยไว้ตอนเสนองายหน่วยลงทุน บริษัทจัดการจะเรียกเก็บค่าใช้จ่ายกองทุนเพิ่ม ทั้งนี้ ไม่เกินเพดานที่ระบุไว้ในโครงการ