

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ดาโอ จำกัด

กองทุนเปิด ดาโอ เอฟเอ็กซ์ อัลฟา ห้ามขายผู้ลงทุนรายย่อย

ชนิดไม่จ่ายเงินปันผล

DAOL FX ALPHA FUND NOT FOR RETAIL INVESTORS (DAOL-FXALPHA-UI)

DAOL-FXALPHA-UI-A

ประเภทกองทุนรวม/ กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมผสม
- กองทุนรวมที่เน้นลงทุนแบบมีความเสี่ยงต่างประเทศ
- กองทุนรวมฟีดเดอร์ (Feeder Fund)
- กลุ่มกองทุนรวม: Miscellaneous

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- ลงทุนในหน่วยลงทุนของ MontLake Oriel UCITS PLATFORM ICAV – P/E FX Strategy Fund (กองทุนหลัก) Class USD ในสกุลเงินดอลลาร์สหรัฐ (USD) เพียงกองทุนเดียว โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน
- กองทุนหลักบริหารจัดการโดย Wystone Management Company (IE) Limited และบริหารการลงทุนโดย P/E Global LLC
- กองทุนหลักมีวัตถุประสงค์ประสงค์ในการสร้างผลตอบแทนจากอัตราแลกเปลี่ยนและการเปลี่ยนแปลงของเศรษฐกิจมหภาค โดยลงทุนในตราสารอนุพันธ์ทางการเงิน (Financial Derivative Instruments ("FDI's")) ได้แก่ สัญญาฟิวเจอร์ส (futures) สัญญาฟอว์เวิร์ด (forwards) และสัญญาสวอป (swaps) ตลอดจน Exchange Traded Commodities ("ETCs") และ Exchange Traded Notes ("ETNs") ที่เป็นไปตามเกณฑ์ของ UCITS และตราสารในตลาดเงิน ซึ่งรวมถึงตั๋วเงินคลังของสหรัฐฯ ด้วย
- กองทุนไทยอาจลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) เพื่อเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน (Efficient Portfolio Management) และเพื่อป้องกันความเสี่ยง (Hedging) ทั้งนี้จะมีอัตราส่วนการลงทุนเพื่อ EPM สูงสุดไม่เกินร้อยละ 100 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน
- กองทุนหลักจะลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่มีวัตถุประสงค์เพื่อลดความเสี่ยง โดยมีฐานะการลงทุนสูงสุดที่เกิดจากการลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า เมื่อคำนวณด้วยวิธี Absolute VaR ต้องไม่เกิน 20% ของ NAV อย่างไรก็ตาม กองทุนไทยและกองทุนหลักจะไม่ลงทุนในตราสารที่มีสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแบบ (Structured Note) ไม่ทำธุรกรรมขายโดยมีสัญญาซื้อคืน (Repurchase agreement) ไม่ทำธุรกรรมการขายหลักทรัพย์ที่ต้องยึดหลักทรัพย์มาเพื่อการส่งมอบ (Short sale) ไม่ลงทุนในหน่วยของกิจการเงินร่วมลงทุน (หน่วย private equity) และไม่กู้ยืมเงินเพื่อประโยชน์ในการจัดการลงทุน เว้นแต่เป็นการกู้ยืมเพื่อการบริหารสภาพคล่องของกองทุนรวมตามที่กำหนดไว้ในโครงการเท่านั้น กองทุนหลักอาจมี Leverage ผ่านการลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า มีระดับการใช้ Leverage ที่คำนวณโดยใช้สัดส่วนรวมของการลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้าอยู่ระหว่าง 150% – 500% ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุนหลัก ทั้งนี้ ระดับการใช้ Leverage อาจสูงขึ้นไปได้
- กลยุทธ์ในการบริหารจัดการลงทุน: กองทุนไทยมุ่งหวังให้ผลประกอบการเคลื่อนไหวตามกองทุนหลัก ส่วนกองทุนหลักมุ่งหวังให้ผลประกอบการสูงกว่าดัชนีชี้วัด (active management)

ระดับความเสี่ยง



ความเสี่ยงสูงมากอย่างมีนัยสำคัญ

โดยลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่มีสินทรัพย์อ้างอิงเป็นอัตราแลกเปลี่ยน โดยเฉลี่ยในรอบปีไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม

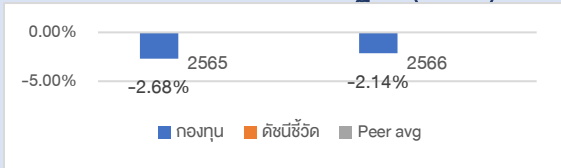
|                        |                   |
|------------------------|-------------------|
| วันจดทะเบียนกองทุนรวม  | : 21 ธันวาคม 2565 |
| วันเริ่มต้น Class      | : 21 ธันวาคม 2565 |
| นโยบายการจ่ายเงินปันผล | : ไม่จ่าย         |
| อายุกองทุน             | : ไม่กำหนด        |

ผู้จัดการกองทุนรวม

|                           |                          |
|---------------------------|--------------------------|
| นางสาวนิตยาธิ์น ชมภูพวงษ์ | ตั้งแต่ 21 ธันวาคม 2565  |
| นายนิพนธ์ พิชา จูศรีวัฒน์ | ตั้งแต่ 1 พฤศจิกายน 2565 |

**ดัชนีชี้วัด :** ไม่มี เนื่องจากกองทุนหลักลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ที่อ้างอิงในอัตราแลกเปลี่ยนเพื่อสร้างผลตอบแทนจากการเปลี่ยนแปลงของภาวะเศรษฐกิจตามภูมิภาค

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (%ต่อปี)



ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปีกumul (%ต่อปี)

|                          | YTD    | 3 เดือน | 6 เดือน | 1 ปี           |
|--------------------------|--------|---------|---------|----------------|
| กองทุน                   | 10.68% | 10.68%  | -2.02%  | 8.53%          |
| ดัชนีชี้วัด              | -      | -       | -       | -              |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน | -      | -       | -       | -              |
| ความผันผวนกองทุน         | 12.61% | 12.61%  | 15.45%  | 15.44%         |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด    | -      | -       | -       | -              |
|                          | 3 ปี   | 5 ปี    | 10 ปี   | ตั้งแต่จัดตั้ง |
| กองทุน                   | -      | -       | -       | 4.21%          |
| ดัชนีชี้วัด              | -      | -       | -       | -              |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน | -      | -       | -       | -              |
| ความผันผวนกองทุน         | -      | -       | -       | 16.36%         |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด    | -      | -       | -       | -              |

คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวมมิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต : ได้รับการรับรองจาก CAC  
จัดอันดับกองทุน Morningstar : N/A

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือบริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่องได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

**การซื้อขายหน่วยลงทุน**

|                             |  |                             |  |
|-----------------------------|--|-----------------------------|--|
| วันทำการซื้อ                | : ทุกวันทำการ (ส่งคำสั่งล่วงหน้า 1 วันทำการ) | วันทำการขายคืน              | : ทุกวันทำการ (ส่งคำสั่งล่วงหน้า 1 วันทำการ) |
| เวลาทำการ                   | : 9.00 - 15.30 น                             | เวลาทำการ                   | : 9.00 - 15.30 น                             |
| การซื้อขายครั้งแรกขั้นต่ำ   | : 1 บาท                                      | การซื้อขายคืนขั้นต่ำ        | : ไม่กำหนด                                   |
| การซื้อขายครั้งถัดไปขั้นต่ำ | : 1 บาท                                      | ยอดคงเหลือขั้นต่ำ           | : 100 หน่วย                                  |
|                             |  | ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน | : T+5  |

หมายเหตุ ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน : ภายใน 5 วันทำการนับแต่วันคำนวณราคาซื้อขายคืนหน่วยลงทุน (กองทุนจะคำนวณ NAV 2 วันทำการถัดไป) ทั้งนี้ ปัจจุบันผู้ถือหน่วยลงทุนจะได้รับเงินค่าขายคืนหน่วยลงทุนภายใน 5 วันทำการนับแต่วันทำการ โดยไม่นับรวมวันหยุดต่างประเทศ

**ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)**

| ค่าธรรมเนียม  | สูงสุดไม่เกิน | เก็บจริง |
|---------------|---------------|----------|
| การจัดการ     | 2.675%        | 1.605%   |
| รวมค่าใช้จ่าย | 6.42%         | 2.503%   |

**หมายเหตุ**

- ค่าธรรมเนียมรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว
- รวมค่าใช้จ่าย ประกอบด้วย ค่าธรรมเนียมการจัดการ ผู้ดูแลผลประโยชน์ นายทะเบียน และ ค่าใช้จ่ายอื่น โดยอัตราที่เรียกเก็บจริงของค่าใช้จ่ายอื่นเป็นข้อมูลตามรอบปีบัญชีหรือรอบ 6 เดือนล่าสุดของกองทุน
- ในกรณีที่กองทุนหลัก คืนเงินค่าธรรมเนียมการจัดการบางส่วนเพื่อเป็นค่าตอบแทนเนื่องจากการที่กองทุนนำเงินไปลงทุนในกองทุนรวมต่างประเทศ (loyalty fee หรือ rebate) บริษัทจัดการจะดำเนินการให้เงินจำนวนดังกล่าวตกเป็นทรัพย์สินของกองทุน

**ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)**

| ค่าธรรมเนียม                | สูงสุดไม่เกิน             | เก็บจริง                  |
|-----------------------------|---------------------------|---------------------------|
| การขาย                      | 2.14%                     | 1.605%                    |
| การรับซื้อคืน               | 2.14%                     | ยกเว้นการเรียกเก็บ        |
| การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า | 2.14%                     | 1.605%                    |
| การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก  | 2.14%                     | ยกเว้นการเรียกเก็บ        |
| การโอนหน่วย                 | ตามที่นายทะเบียนเรียกเก็บ | ตามที่นายทะเบียนเรียกเก็บ |

**หมายเหตุ**

- ค่าธรรมเนียมรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว
- บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ
- บริษัทจัดการอาจพิจารณาขายวัน สดหย่อน หรือเรียกเก็บค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วยลงทุน โดยอาจเรียกเก็บค่าธรรมเนียมดังกล่าวจากผู้ซื้อหน่วยลงทุนแต่ละกลุ่ม และ/หรือแต่ละรายในอัตราที่ไม่เท่ากัน โดยขึ้นกับดุลยพินิจของบริษัทจัดการ โดยบริษัทจัดการจะพิจารณาจากมูลค่าการรายการ การระดมทุน การขาย การระยะเวลาการถือครองหน่วยลงทุน เป็นต้น

**สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน**

| ชื่อหลักทรัพย์สิน | สัดส่วน % ของพอร์ต |
|-------------------|--------------------|
| UNIT TRUST        | 96.11%             |
| SAVING ACCOUNT    | 3.89%              |

**ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก**

| ชื่อหลักทรัพย์สิน    | สัดส่วน % ของพอร์ต |
|----------------------|--------------------|
| P/E FX Strategy Fund | 96.11%             |

**ข้อมูลกองทุนหลัก**

N/A

**ข้อมูลเชิงสถิติ**

|                            |           |
|----------------------------|-----------|
| Maximum Drawdown           | : -14.03% |
| Recovering Period          | : N/A     |
| FX Hedging                 | : 76.77%  |
| อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน | : 108.61% |
| Sharpe Ratio               | : 0.1552  |
| Alpha                      | : N/A     |
| Beta                       | : N/A     |
| Tracking Error             | : N/A     |
| อายุเฉลี่ยของตราสารหนี้    | : N/A     |
| Yield to Maturity          | : N/A     |

**การจัดสรรการลงทุนในต่างประเทศของกองทุนหลัก**

N/A

**การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม/ผู้ออกตราสาร 5 อันดับแรกของกองทุนหลัก**

N/A

**การจัดสรรการลงทุนตามอันดับความน่าเชื่อถือ (%)**

N/A

## การลงทุนในกองทุนอื่นเกินกว่า 20% (กองในประเทศ และหรือกองต่างประเทศ)

ชื่อกองทุน : P/E FX Strategy Fund

Weblink : <https://www.waystone.com/funds/montlake-oriel-ucits-platform-icav-sub-fund-pe-fx-strategy-fund/>

ISIN code : IE00BYQD3C34

Bloomberg code : PEFXSTU ID EQUITY



### คำอธิบาย

**Maximum Drawdown** เปรอ์เซ็นต์ผลขาดทุนสูงสุดของกองทุนรวมในระยะเวลา 5 ปีย้อนหลัง (หรือตั้งแต่จัดตั้งกองทุนกรณีที่ยังไม่ครบ 5 ปี) โดยวัดจากระดับ NAV ต่อหน่วยที่จุดสูงสุดไปจนถึงจุดต่ำสุดในช่วงที่ NAV ต่อหน่วยปรับตัวลดลง ค่า Maximum Drawdown เป็นข้อมูลที่ช่วยให้ทราบถึงความเสี่ยงที่อาจจะขาดทุนจากการลงทุนในกองทุนรวม

**Recovering Period** ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาตั้งแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินลงทุนเริ่มต้นใช้เวลานานเท่าใด

**FX Hedging** เปรอ์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

**อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน** ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตกองทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลานึง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์กับผลรวมของมูลค่าการขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 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 สูงกว่าจะเป็นกองทุนที่มีประสิทธิภาพในการบริหารจัดการการลงทุนที่ดีกว่า 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 โดยใช้วิธีอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมตราสารหนี้ 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

อลลซีซีเอสเพลส ถนนวิภาวดี แยกวงกลมพินิจ

เขตปทุมวัน กรุงเทพมหานคร 10330

กองทุนเปิด ดาโอ เอฟเอ็กซ์ อัลฟา ห้ามขายผู้ลงทุนรายย่อย

DAOL FX ALPHA FUND NOT FOR RETAIL INVESTORS (DAOL-FXALPHA-UI)

ชนิดจ่ายเงินปันผล

DAOL-FXALPHA-UI-D

ประเภทกองทุนรวม/ กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมผสม
- กองทุนรวมที่เน้นลงทุนแบบมีความเสี่ยงต่างประเทศ
- กองทุนรวมฟีดเดอร์ (Feeder Fund)
- กลุ่มกองทุนรวม: Miscellaneous

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- ลงทุนในหน่วยลงทุนของ MontLake Oriel UCITS PLATFORM ICAV – P/E FX Strategy Fund (กองทุนหลัก) Class USD ในสกุลเงินดอลลาร์สหรัฐ (USD) เพียงกองทุนเดียว โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน
- กองทุนหลักบริหารจัดการโดย Waystone Management Company (IE) Limited และบริหารการลงทุนโดย P/E Global LLC
- กองทุนหลักมีวัตถุประสงค์ในการสร้างผลตอบแทนจากอัตราแลกเปลี่ยนและการเปลี่ยนแปลงของเศรษฐกิจมหภาค โดยลงทุนในตราสารอนุพันธ์ทางการเงิน (Financial Derivative Instruments (“FDI’s”)) ได้แก่ สัญญาฟิวเจอร์ส (futures) สัญญาฟอว์เวิร์ด (forwards) และสัญญาสวอป (swaps) ตลอดจน Exchange Traded Commodities (“ETCs”) และ Exchange Traded Notes (“ETNs”) ที่เป็นไปตามเกณฑ์ของ UCITS และตราสารในตลาดเงิน ซึ่งรวมถึงตัวเงินคลังของสหรัฐฯ ด้วย
- กองทุนไทยอาจลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) เพื่อเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน (Efficient Portfolio Management) และเพื่อป้องกันความเสี่ยง (Hedging) ทั้งนี้ จะมีอัตราส่วนการลงทุนเพื่อ EPM สูงสุดไม่เกินร้อยละ 100 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน
- กองทุนหลักจะลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่มีวัตถุประสงค์เพื่อลดความเสี่ยง โดยมีฐานการลงทุนสูงสุดที่เกิดจากการลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า เมื่อคำนวณด้วยวิธี Absolute VaR ต้องไม่เกิน 20% ของ NAV อย่างไรก็ตาม กองทุนไทยและกองทุนหลักจะไม่ลงทุนในตราสารที่มีสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแบบ (Structured Note) ไม่ทำธุรกรรมขายโดยมีสัญญาซื้อคืน (Repurchase agreement) ไม่ทำธุรกรรมการขายหลักทรัพย์ที่ต้องยึดหลักทรัพย์มาเพื่อการส่งมอบ (Short sale) ไม่ลงทุนในหน่วยของกิจการเงินร่วมลงทุน (หน่วย private equity) และไม่กู้ยืมเงินเพื่อประโยชน์ในการจัดการลงทุน เว้นแต่เป็นการกู้ยืมเพื่อการบริหารสภาพคล่องของกองทุนรวมตามที่กำหนดไว้ในโครงการเท่านั้น กองทุนหลักอาจมี Leverage ผ่านการลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า มีระดับการใช้ Leverage ที่คำนวณโดยใช้สัดส่วนรวมของการลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้าอยู่ระหว่าง 150% – 500% ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุนหลัก ทั้งนี้ ระดับการใช้ Leverage อาจสูงขึ้นก็ได้
- กลยุทธ์ในการบริหารจัดการลงทุน: กองทุนไทยมุ่งหวังให้ผลประกอบการเคลื่อนไหวตามกองทุนหลัก ส่วนกองทุนหลักมุ่งหวังให้ผลประกอบการสูงกว่าดัชนีชี้วัด (active management)

ระดับความเสี่ยง

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

ความเสี่ยงสูงมากอย่างมีนัยสำคัญ

โดยลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่มีสินทรัพย์อ้างอิงเป็นอัตราแลกเปลี่ยน โดยเฉลี่ยในรอบปีไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม

|                        |   |
|------------------------|---|
| วันจดทะเบียนกองทุนรวม  | : 21 ธันวาคม 2565   |
| วันเริ่มต้น Class      | : 21 ธันวาคม 2565   |
| นโยบายการจ่ายเงินปันผล | : จ่าย (เป็นรายไตรมาสของรอบระยะเวลาบัญชีกองทุน เช่น มี.ค มี.ย. ก.ย และ ธ.ค) |
| อายุกองทุน             | : ไม่กำหนด  |

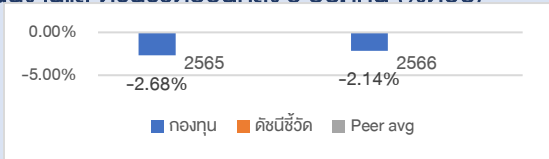
ผู้จัดการกองทุนรวม

|                              |                          |
|------------------------------|--------------------------|
| นางสาวนิสาธิตน์ ชมภูพวงษ์    | ตั้งแต่ 21 ธันวาคม 2565  |
| นายนิพนธ์ พิชชา จุงศิริวัฒน์ | ตั้งแต่ 1 พฤศจิกายน 2565 |

ดัชนีชี้วัด

: ไม่มี เนื่องจากกองทุนหลักลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่อ้างอิงในอัตราแลกเปลี่ยนเพื่อสร้างผลตอบแทนจากการเปลี่ยนแปลงของภาวะเศรษฐกิจตามภูมิภาค

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (%ต่อปี)



ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด (%ต่อปี)

|                          | YTD    | 3 เดือน | 6 เดือน | 1 ปี           |
|--------------------------|--------|---------|---------|----------------|
| กองทุน                   | 9.04%  | 9.04%   | -3.48%  | 6.90%          |
| ดัชนีชี้วัด              | -      | -       | -       | -              |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน | -      | -       | -       | -              |
| ความผันผวนกองทุน         | 13.29% | 13.29%  | 15.70%  | 15.57%         |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด    | -      | -       | -       | -              |
|                          | 3 ปี   | 5 ปี    | 10 ปี   | ตั้งแต่จัดตั้ง |
| กองทุน                   | -      | -       | -       | 3.00%          |
| ดัชนีชี้วัด              | -      | -       | -       | -              |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน | -      | -       | -       | -              |
| ความผันผวนกองทุน         | -      | -       | -       | 16.45%         |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด    | -      | -       | -       | -              |

คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวมมิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต : ได้รับการรับรองจาก CAC  
จัดอันดับกองทุน Morningstar : N/A

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือบริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่องได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

**การซื้อขายหน่วยลงทุน**

วันทำการซื้อ : ทุกวันทำการ(ส่งคำสั่งล่วงหน้า 1 วันทำการ)  
 เวลาทำการ : 9.00 - 15.30 น  
 การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ : 1 บาท  
 การซื้อครั้งถัดไปขั้นต่ำ : 1 บาท

**การขายคืนหน่วยลงทุน**

วันทำการขายคืน : ทุกวันทำการ(ส่งคำสั่งล่วงหน้า 1 วันทำการ)  
 เวลาทำการ : 9.00 - 15.30 น  
 การขายคืนขั้นต่ำ : ไม่กำหนด  
 ยอดคงเหลือขั้นต่ำ : 100 หน่วย  
 ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน : T+5

หมายเหตุ ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน : ภายใน 5 วันทำการนับแต่วันคำนวณราคาซื้อขายคืนหน่วยลงทุน (กองทุนจะคำนวณ NAV 2 วันทำการถัดไป) ทั้งนี้ ปัจจุบันผู้ถือหน่วยลงทุนจะได้รับเงินค่าขายคืนหน่วยลงทุนภายใน 5 วันทำการนับแต่วันทำรายการ โดยไม่นับรวมวันหยุดต่างประเทศ

**ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)**

| ค่าธรรมเนียม  | สูงสุดไม่เกิน | เก็บจริง |
|---------------|---------------|----------|
| การจัดการ     | 2.675%        | 1.605%   |
| รวมค่าใช้จ่าย | 6.42%         | 2.503%   |

**หมายเหตุ**

- ค่าธรรมเนียมรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว
- รวมค่าใช้จ่าย ประกอบด้วย ค่าธรรมเนียมการจัดการ ผู้ดูแลผลประโยชน์ นายทะเบียน และค่าใช้จ่ายอื่น โดยอัตราที่เรียกเก็บจริงของค่าใช้จ่ายอื่นเป็นข้อมูลตามรอบปีบัญชีหรือรอบ 6 เดือนล่าสุดของกองทุน
- ในกรณีที่กองทุนหลัก คืนเงินค่าธรรมเนียมการจัดการบางส่วนเพื่อเป็นค่าตอบแทนเนื่องจากการที่กองทุนนำเงินไปลงทุนในกองทุนรวมต่างประเทศ (loyalty fee หรือ rebate) บริษัทจัดการจะดำเนินการให้เงินจำนวนดังกล่าวตกเป็นทรัพย์สินของกองทุน

**ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)**

| ค่าธรรมเนียม                | สูงสุดไม่เกิน             | เก็บจริง                  |
|-----------------------------|---------------------------|---------------------------|
| การขาย                      | 2.14%                     | 1.605%                    |
| การรับซื้อคืน               | 2.14%                     | ยกเว้นการเรียกเก็บ        |
| การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า | 2.14%                     | 1.605%                    |
| การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก  | 2.14%                     | ยกเว้นการเรียกเก็บ        |
| การโอนหน่วย                 | ตามที่นายทะเบียนเรียกเก็บ | ตามที่นายทะเบียนเรียกเก็บ |

**หมายเหตุ**

- ค่าธรรมเนียมรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว
- บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ
- บริษัทจัดการอาจพิจารณายกเว้น ลดหย่อน หรือเรียกเก็บค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วยลงทุน โดยอาจเรียกเก็บค่าธรรมเนียมดังกล่าวจากผู้ถือหน่วยลงทุนแต่ละกลุ่ม และ/หรือแต่ละรายในอัตราที่ไม่เท่ากัน โดยขึ้นกับดุลยพินิจของบริษัทจัดการ โดยบริษัทจัดการจะพิจารณาจากมูลค่าการการขาย การระดมทุน การขาย การระดมทุน การถือครองหน่วยลงทุน เป็นต้น

**สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน**

| ประเภททรัพย์สิน | สัดส่วน % ของพอร์ต |
|-----------------|--------------------|
| UNIT TRUST      | 96.11%             |
| SAVING ACCOUNT  | 3.89%              |

**ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก**

| ชื่อหลักทรัพย์สิน    | สัดส่วน % ของพอร์ต |
|----------------------|--------------------|
| P/E FX Strategy Fund | 96.11%             |

**ข้อมูลกองทุนหลัก**

N/A

**ข้อมูลเชิงสถิติ**

|                            |           |
|----------------------------|-----------|
| Maximum Drawdown           | : -14.03% |
| Recovering Period          | : N/A     |
| FX Hedging                 | : 76.77%  |
| อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน | : 108.61% |
| Sharpe Ratio               | : 0.0805  |
| Alpha                      | : N/A     |
| Beta                       | : N/A     |
| Tracking Error             | : N/A     |
| อายุเฉลี่ยของตราสารหนี้    | : N/A     |
| Yield to Maturity          | : N/A     |

**การจัดสรรการลงทุนในต่างประเทศของกองทุนหลัก**

N/A

**การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม/ผู้ออกตราสาร 5 อันดับแรกของกองทุนหลัก**

N/A

**การจัดสรรการลงทุนตามอันดับความน่าเชื่อถือ (%)**

N/A

## การลงทุนในกองทุนอื่นเกินกว่า 20% (กองในประเทศ และหรือกองต่างประเทศ)

ชื่อกองทุน : P/E FX Strategy Fund

Weblink : <https://www.waystone.com/funds/dms-ucits-platform-icav-sub-fund-pe-fx-strategy-fund/>

ISIN code : IE00BYQD3C34

Bloomberg code : PEFXSTU ID EQUITY



### คำอธิบาย

**Maximum Drawdown** เปรอ์เซ็นต์ผลขาดทุนสูงสุดของกองทุนรวมในระยะเวลา 5 ปีย้อนหลัง (หรือตั้งแต่จัดตั้งกองทุนกรณีที่ยังไม่ครบ 5 ปี) โดยวัดจากระดับ NAV ต่อหน่วยที่จุดสูงสุดไปจนถึงจุดต่ำสุดในช่วงที่ NAV ต่อหน่วยปรับตัวลดลง ค่า Maximum Drawdown เป็นข้อมูลที่ช่วยให้ทราบถึงความเสี่ยงที่อาจจะขาดทุนจากการลงทุนในกองทุนรวม

**Recovering Period** ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาตั้งแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินลงทุนเริ่มต้นใช้เวลานานเท่าใด

**FX Hedging** เปรอ์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

**อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน** ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตกองทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลานึง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์กับผลรวมของมูลค่าการขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 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 สูงกว่าจะเป็นกองทุนที่มีประสิทธิภาพในการบริหารจัดการการลงทุนที่ดีกว่า 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 โดยใช้วิธีอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมตราสารหนี้ คำนวณจากค่าเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักของ Yield to Maturity ของตราสารหนี้แต่ละตัวที่กองทุนมีการลงทุน และเนื่องจาก Yield to Maturity มีหน่วยมาตรฐานเป็นเปอร์เซ็นต์ต่อปี จึงสามารถนำไปใช้เปรียบเทียบอัตราผลตอบแทนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีนโยบายถือครองตราสารหนี้จนครบกำหนดอายุและมีลักษณะการลงทุนที่ใกล้เคียงกันได้

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ดาโอ จำกัด

โทรศัพท์: 0-2351-1800 กด 2

[www.daolinvestment.co.th](http://www.daolinvestment.co.th)

ที่อยู่: 87/2 อาคารซีอาร์ซีทาวเวอร์ ชั้น 52

อลซีซีเนิสเพลส ถนนวิภาวดี แวงงлумพินี

เขตปทุมวัน กรุงเทพมหานคร 10330