

**กองทุนเปิด ดาโอ คอมเพล็กซ์ รีเทิร์น 6M2 ห้ามขายผู้ลงทุนรายย่อย**

**DAOL COMPLEX RETURN 6M2 FUND NOT FOR RETAIL INVESTORS (DAOL-CRETURN6M2-U)**

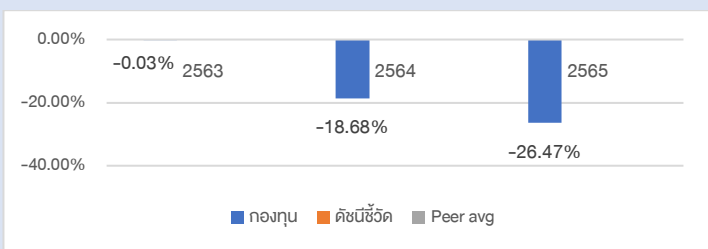
**ประเภทกองทุนรวม/ กลุ่มกองทุนรวม**

- กองทุนรวมผสม
- กองทุนรวมที่เน้นลงทุนแบบมีความเสี่ยงต่างประเทศ
- กลุ่มกองทุนรวม: Miscellaneous

**นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน**

- ลงทุนในตราสารที่มีสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแฝง (Structured Note) ตราสารแห่งทุน ตราสารกึ่งหนี้กึ่งทุน ตราสารแห่งหนี้ ตราสารทางการเงิน และ/หรือหน่วยลงทุนของกองทุนทั้งในประเทศและต่างประเทศ ตั้งแต่ร้อยละ 0 ถึงร้อยละ 100 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน โดยขึ้นอยู่กับมติของผู้จัดการกองทุนตามความเหมาะสมกับสภาพการณ์ในแต่ละขณะ
- ในช่วงระยะเวลา 6 เดือนแรกนับแต่วันจดทะเบียนกองทรัยพ์สินเป็นกองทุนรวม กองทุนจะเน้นลงทุนในสัดส่วนไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน ในตราสารที่มีสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแฝง (Structured Note) ที่เป็นหุ้นกู้อนุพันธ์ ประเภท Fixed Coupon Note (FCN) ที่มีหลักทรัพย์อ้างอิง (Underlying) เป็นหุ้นที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ต่างประเทศ โดยตราสารที่มีสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแฝง (Structured Note) ดังกล่าว จะมีเงื่อนไขการจ่ายผลตอบแทนในอัตราคงที่ (Fixed Coupon) และเมื่อครบกำหนดไถ่ถอน กองทุนจะได้รับการส่งมอบเงินสดและ/หรือทรัพย์สินอื่นใดเทียบเท่าเงินสด หรือหุ้นที่เป็นหลักทรัพย์อ้างอิง (Underlying) แล้วแต่กรณี โดยเป็นไปตามเงื่อนไขการส่งมอบหลักทรัพย์อ้างอิง ณ วันครบอายุการลงทุนในตราสาร
- กองทุนอาจลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) เพื่อเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน (Efficient Portfolio Management) และเพื่อป้องกันความเสี่ยง (Hedging)
- กลยุทธ์ในการบริหารจัดการลงทุน: มีกลยุทธ์การลงทุนครั้งเดียว (buy-and-hold) โดยจะเน้นลงทุนในตราสารที่มีสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแฝง (Structured Note) ที่เป็นหุ้นกู้อนุพันธ์ ประเภท Fixed Coupon Note (FCN) ที่มีอายุสัญญาประมาณ 6 เดือน และเมื่อครบกำหนดการไถ่ถอน หากปรากฏว่ากองทุนได้รับการส่งมอบเป็นหลักทรัพย์อ้างอิง (Underlying) ที่มีผลการดำเนินงานต่ำที่สุดในแต่ละตะกร้าหลักทรัพย์ (Basket) กองทุนจะมีไว้ซึ่งหลักทรัพย์อ้างอิงที่ได้รับมอบดังกล่าว และเปิดรับซื้อคืนหน่วยลงทุนอีกครั้ง โดยจะดำเนินการเลือกกองทุนเมื่อหน่วยลงทุนมีมูลค่าเท่ากับหรือมากกว่า 10.40 บาทต่อหน่วยตามเงื่อนไขในการเลือกกองทุน

**ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (%ต่อปี)**



**ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบบักหมุด (%ต่อปี)**

	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี
กองทุน	7.33%	-3.48%	7.33%	1.29%
ดัชนีชี้วัด	-	-	-	-
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	-	-	-	-
ความผันผวนกองทุน	21.33%	23.79%	21.33%	21.26%
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	-	-	-	-
	3 ปี	5 ปี	10 ปี	ตั้งแต่จัดตั้ง
กองทุน	-	-	-	-16.24%
ดัชนีชี้วัด	-	-	-	-
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	-	-	-	-
ความผันผวนกองทุน	-	-	-	23.95%
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	-	-	-	-

**ระดับความเสี่ยง**

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

**เสี่ยงสูงมากอย่างมีนัยสำคัญ**

ลงทุนในตราสารที่มีสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแฝง (Structured Note) โดยเฉลี่ยในรอบปีไม่น้อยกว่า 80 ของ NAV

**ข้อมูลกองทุนรวม**

- วันจดทะเบียนกองทุนรวม : 29 ธันวาคม 2563
- วันเริ่มต้น Class : กองทุนไม่มีการแบ่ง Class
- นโยบายการจ่ายเงินปันผล : ไม่จ่าย
- อายุกองทุน : ไม่กำหนดโดยมีเงื่อนไขในการเลิกกองทุนดังนี้
- 1. กรณีที่ 1 : เมื่อตราสารที่กองทุนลงทุนครบกำหนดไถ่ถอน ประมาณ 6 เดือนนับแต่วันจดทะเบียนกองทรัยพ์สินเป็นกองทุนรวม โดยกองทุนได้รับการส่งมอบเป็นเงินสดและ/หรือทรัพย์สินอื่นใดเทียบเท่าเงินสดทั้งหมดทุกสัญญาที่กองทุนลงทุน ณ วันครบกำหนดอายุประมาณ 6 เดือน
- 2. กรณีที่ 2 : เมื่อหน่วยลงทุนมีมูลค่าเท่ากับหรือมากกว่า 10.40 บาทต่อหน่วย ภายหลังจากครบกำหนดอายุการลงทุนประมาณ 6 เดือนและเข้าเงื่อนไขการไถ่ถอนโดยกองทุนได้รับการส่งมอบเป็นหลักทรัพย์อ้างอิงที่มีผลการดำเนินงานต่ำที่สุดในแต่ละตะกร้าหลักทรัพย์ (Basket) และกองทุนได้เปิดรับซื้อคืนหน่วยลงทุนภายหลังการเสนอขายครั้งแรก

**ผู้จัดการกองทุนรวม**

นางสาวนิสาธิตน์ ชมภูพงษ์ ตั้งแต่วันที่ 3 ต.ค. 65  
 นายณันพิชา จุงศิริวัฒน์ ตั้งแต่วันที่ 1 พ.ย. 65

**ดัชนีชี้วัด :** ไม่มี เนื่องจากกองทุนไม่สามารถวัดผลการดำเนินงานได้ เพราะอัตราผลตอบแทนของกองทุนจะขึ้นอยู่กับเงื่อนไขการจ่ายผลตอบแทนของตราสารที่มีสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแฝง (Structured Note) ที่เป็นหุ้นกู้อนุพันธ์ ประเภท Fixed Coupon Note (FCN)

**คำเตือน**

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวมไม่ได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต : ได้รับการรับรองจาก CAC  
 จัดอันดับกองทุน Morningstar : N/A

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือบริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่องได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

**การซื้อหน่วยลงทุน**

วันทำการซื้อ : ไม่เสนอขายหลัง IPO  
 เวลาทำการ : 9.00 - 15.30 น  
 การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ : 5,000 บาท  
 การซื้อครั้งถัดไปขั้นต่ำ : 1 บาท

**การขายคืนหน่วยลงทุน**

วันทำการขายคืน : ทุกวันทำการ (หลังครบ 6 เดือน)  
 เวลาทำการ : 9.00 - 15.30 น  
 การขายคืนขั้นต่ำ : ไม่กำหนด  
 ยอดคงเหลือขั้นต่ำ : ไม่กำหนด  
 ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน : T+5

หมายเหตุ ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน : ภายใน 5 วันทำการนับแต่วันคำนวณราคาซื้อคืนหน่วยลงทุน (กองทุนจะคำนวณ NAV 1 วันทำการถัดไป) ทั้งนี้ ปัจจุบันผู้ถือหน่วยลงทุนจะได้รับเงินค่าขายคืนหน่วยลงทุน ภายใน 5 วันทำการนับแต่วันทำการ โดยไม่นับรวมวันหยุดต่างประเทศ

**ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)**

ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	4.28%	ยกเว้นการเรียกเก็บ
รวมค่าใช้จ่าย	6.42%	0.33145%

หมายเหตุ

- ค่าธรรมเนียมรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว
  - รวมค่าใช้จ่าย ประกอบด้วยค่าธรรมเนียมการจัดการ ผู้ดูแลผลประโยชน์ นายทะเบียนและค่าใช้จ่ายอื่น โดยอัตราที่เรียกเก็บจริงของค่าใช้จ่ายอื่นเป็นข้อมูลตามรอบปีบัญชีล่าสุดของกองทุน
  - ในระยะเวลา 6 เดือนแรกนับจากวันที่จดทะเบียนทรัพย์สินเป็นกองทุนรวม บริษัทจัดการจะเรียกเก็บค่าธรรมเนียมการจัดการในอัตราไม่เกินร้อยละ 4.28 ต่อปี ของมูลค่าที่จดทะเบียนของทรัพย์สินเป็นกองทุนรวม โดยทางบัญชีจะรับรู้ถึงจำนวน และเรียกเก็บจากกองทุน ภายในระยะเวลาไม่เกิน 90 วัน นับจากวันที่จดทะเบียนกองทุนหรือภายในระยะเวลาอื่นใด ตามดุลยพินิจของบริษัทจัดการ ทั้งนี้ โดยคำนึงถึงประโยชน์ของกองทุนและผู้ถือหน่วยลงทุนเป็นสำคัญ
- ภายหลังระยะเวลา 6 เดือนแรก บริษัทจัดการจะคิดค่าธรรมเนียมการจัดการในอัตราไม่เกินร้อยละ 4.28 ต่อปี ของมูลค่าทรัพย์สินทั้งหมดหักด้วยมูลค่าหนี้สินทั้งหมด ก่อนหักค่าธรรมเนียมการจัดการ ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ ค่าธรรมเนียมนายทะเบียนหน่วยลงทุน ณ วันที่คำนวณ

**ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)**

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

หมายเหตุ

- ค่าธรรมเนียมรวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว
- บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ

**สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน**

ประเภททรัพย์สิน	สัดส่วน % ของพอร์ต
UNIT TRUST	34.26%
AUTOMOTIVE	19.31%
SAVING ACCOUNT	13.08%
INFORMATION & COMMUNICATION TECHNOLOGY	13.06%
Technology	7.99%
COMMERCE	4.9%
Internet Information	4.11%
TOURISM & LEISURE	3.29%

**ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก**

ชื่อหลักทรัพย์	สัดส่วน % ของพอร์ต
ISHARES 20+ YEAR TREASURY BOND ETF	12.80%
Bayerische Motoren Werke Aktiengesellschaft	9.70%
VOLKSWAGEN AG	9.61%
VANECK VECTORS VIETNAM ETF	9.33%
INVESCO CHINA TECHNOLOGY ETF	9.13%

**ข้อมูลเชิงสถิติ**

Maximum Drawdown	: -43.85%
Recovering Period	: N/A
FX Hedging	: 81.33%
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน	: 419.78%
Sharpe Ratio	: -0.7038
Alpha	: N/A
Beta	: N/A
Tracking Error	: N/A
อายุเฉลี่ยของตราสารหนี้	: N/A
Yield to Maturity	: N/A

**การจัดสรรการลงทุนในต่างประเทศ**

N/A

**การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม/ผู้ออกตราสาร 5 อันดับแรก**

N/A

**การจัดสรรการลงทุนตามอันดับความน่าเชื่อถือ (%)**

N/A

**คำอธิบาย**

**Maximum Drawdown** เปรอ์เซ็นต์ผลขาดทุนสูงสุดของกองทุนรวมในระยะเวลา 5 ปีย้อนหลัง (หรือตั้งแต่จัดตั้งกองทุนกรณีที่ยังไม่ครบ 5 ปี) โดยวัดจากระดับ NAV ต่อหน่วยที่จุดสูงสุดไปจนถึงจุดต่ำสุด ในช่วงที่ NAV ต่อหน่วยปรับตัวลดลง ค่า Maximum Drawdown เป็นข้อมูลที่ใช้ให้ทราบถึงความเสี่ยงที่อาจจะขาดทุนจากการลงทุนในกองทุนรวม

**Recovering Period** ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาดังแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินลงทุนเริ่มต้นใช้เวลานานเท่าใด

**FX Hedging** เปรอ์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

**อัตราส่วนเบี่ยงเบนการลงทุน** ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตกองทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลาหนึ่ง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์กับผลรวมของมูลค่าการขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 1 ปีหารด้วยมูลค่า NAV ของกองทุนรวมเฉลี่ยในรอบระยะเวลาเดียวกัน กองทุนที่มีค่า portfolio turnover สูง บ่งชี้ถึงการซื้อขายหลักทรัพย์บ่อยครั้งของผู้จัดการกองทุนและทำให้มีต้นทุนการซื้อขายหลักทรัพย์ที่สูง จึงต้องพิจารณาเปรียบเทียบกับผลการดำเนินงานของกองทุนรวมเพื่อประเมินความคุ้มค่าของการซื้อขายหลักทรัพย์ดังกล่าว

**Sharpe Ratio** อัตราส่วนระหว่างผลตอบแทนส่วนเพิ่มของกองทุนรวมเปรียบเทียบกับความเสี่ยงจากการลงทุน โดยคำนวณจากผลต่างระหว่างอัตราผลตอบแทนของกองทุน รวมกับอัตราผลตอบแทนที่ปราศจากความเสี่ยง (risk-free rate) เปรียบเทียบกับค่าเบี่ยงเบนมาตรฐาน (standard deviation) ของกองทุนรวม ค่า Sharpe Ratio สะท้อนถึงอัตราผลตอบแทนที่กองทุนรวมควรได้รับเพิ่มขึ้นเพื่อชดเชยกับความเสี่ยงที่กองทุนรวมรับมา โดยกองทุนที่มีค่า 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 กองทุนที่มีค่า tracking error สูง จะมีอัตราผลตอบแทนโดยเฉลี่ยห่างจากดัชนีชี้วัดมากขึ้น

**Yield to Maturity** อัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในตราสารหนี้โดยที่จนครบกำหนดอายุ ซึ่งคำนวณจากดอกเบี้ยที่จะได้รับในอนาคตตลอดอายุตราสารและเงินต้นที่จะได้รับคืน นำมาคิดลดเป็นมูลค่าปัจจุบัน โดยใช้ตัวอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมตราสารหนี้ คำนวณจากค่าเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักของ Yield to Maturity ของตราสารหนี้แต่ละตัวที่กองทุนมีการลงทุน และเนื่องจาก Yield to Maturity มีหน่วยมาตรฐานเป็นเปอร์เซ็นต์ต่อปีจึงสามารถนำไปใช้เปรียบเทียบอัตราผลตอบแทนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีนโยบายถือครองตราสารหนี้จนครบกำหนดอายุและมีลักษณะการลงทุนที่ใกล้เคียงกันได้

**บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ดาโอ จำกัด**

โทรศัพท์: 0-2351-1800 กด 2

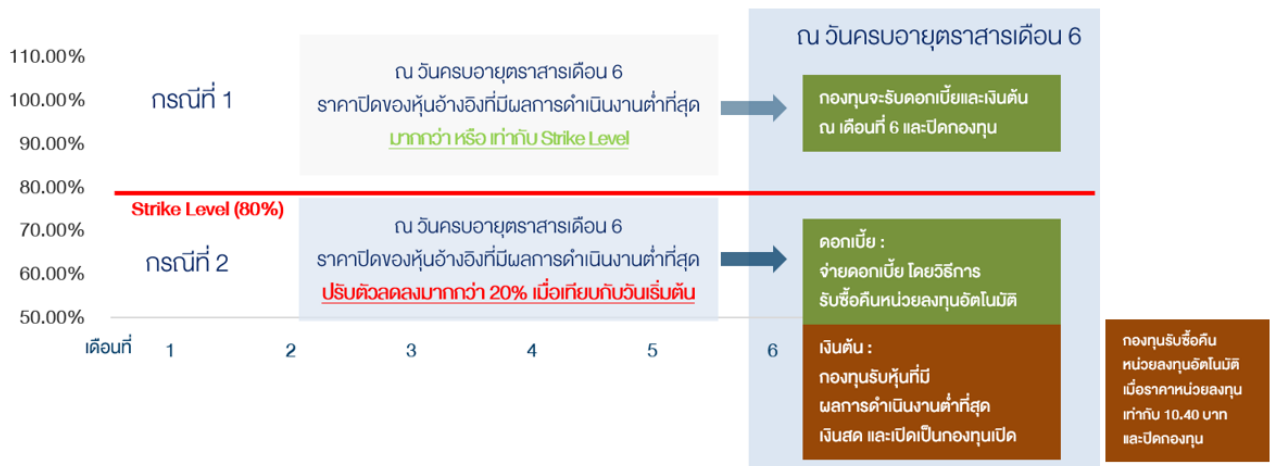
www.daolinvestment.co.th

ที่อยู่: 87/2 อาคารซีอาร์ซีทาวเวอร์ ชั้น 52

อลซีเซ็นทรัลพลาซ่า ถนนวิภาวดี แขวงลุมพินี

เขตปทุมวัน กรุงเทพมหานคร 10330

แผนภาพ (pay-off diagram) ที่แสดงลักษณะของผลตอบแทนกองทุน DAOL-CRETURN6M2-UI



ทั้งนี้ กองทุนจะลงทุนในตราสารที่มีสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Structured Note) ที่เป็นหุ้นกู้พันธบัตร ประเภท Fixed Coupon Note (FCN) มากกว่า 1 สัญญา โดยหากกองทุนได้รับเงินสดและ/หรือทรัพย์สินอื่นใดเทียบเท่าเงินสดตามกรณีที่ 1 ทั้งหมดทุกสัญญาที่กองทุนลงทุน กองทุนจะเลิกกองทุนตามเงื่อนไขในการเลิกกองทุน ข้อ 1 อย่างไรก็ตาม หากกองทุนได้รับเงินสดในบางสัญญา และได้รับหลักทรัพย์อ้างอิงในสัญญาที่เหลือตามกรณีที่ 2 กองทุนจะมีไว้ซึ่งหลักทรัพย์อ้างอิงที่ได้รับมอบจากการไถ่ถอนตราสารดังกล่าว ส่วนที่เหลือที่ได้รับเงินสดและ/หรือทรัพย์สินอื่นใดเทียบเท่าเงินสด กองทุนอาจลงทุนในตราสารทุน และ/หรือตราสารหนี้ และ/หรือตราสารกึ่งหนี้กึ่งทุน และ/หรือตราสารทางการเงิน และ/หรือหน่วยลงทุนของกองทุน และ/หรือตราสารอื่นใดตามที่สำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ต. ประกาศกำหนด โดยกองทุนจะเปิดรับซื้อคืนหน่วยลงทุน และเลิกกองทุนตามเงื่อนไขในการเลิกกองทุน ข้อ 2

ทั้งนี้ กองทุนรวมนี้เหมาะสำหรับผู้ลงทุนที่คาดหวังผลตอบแทนที่สูงขึ้น จากโอกาสการลงทุนในสภาวะตลาดที่ผันผวน โดยสามารถรับการขาดทุนเงินต้นได้หากทิศทางของหลักทรัพย์อ้างอิงไม่เป็นไปตามการคาดการณ์