

DAOL INVESTMENT
MANAGEMENT

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ดาโอ จำกัด

รายงานการติดตามดูแลการจัดการกองทุนรวม ประจำปี 2566
(Independent Oversight Entity Report 2023)

เรียน ท่านผู้ถือหุ้นหน่วยงาน

เพื่อให้เป็นไปตามประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุนที่ ทร. 49/2562 แห่ง พ.ร.บ.หลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535 คณะกรรมการบริษัทของบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ดาโอ จำกัด (“บริษัท”) ได้มอบหมายให้ฝ่ายตรวจสอบภายในของบริษัทหลักทรัพย์ ดาโอ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) เป็นผู้ติดตามดูแลการจัดการกองทุนรวมของบริษัทสำหรับปี 2566 โดยมีคณะกรรมการตรวจสอบของบริษัทช่วยพิจารณาผลการติดตาม ฝ่ายตรวจสอบภายในติดตามดูแลการจัดการกองทุนรวมในเรื่องการกระทำที่อาจก่อให้เกิดความขัดแย้งทางผลประโยชน์ การกระทำที่อาจมีลักษณะไม่เป็นธรรม และการกระทำที่อาจทำให้ผู้ถือหุ้นหน่วยงานเสียประโยชน์อันพึงได้รับ และขอบเขตของการติดตามดูแลการปฏิบัติงานครอบคลุม 6 เรื่อง ดังนี้

1. การซื้อขายผลิตภัณฑ์ในตลาดทุนและตราสารทางการเงินกับบุคคลที่เกี่ยวข้องกับการประกอบธุรกิจ และการซื้อขายผลิตภัณฑ์ในตลาดทุนและตราสารทางการเงินที่ไม่มีราคาตลาดหรือไม่มีสภาพคล่อง
2. วิธีการบริหารจัดการกองทุนรวม
3. การคัดเลือกและติดตามการให้บริการของผู้ให้บริการ
4. การส่งคำสั่งซื้อขายผลิตภัณฑ์ในตลาดทุนและตราสารทางการเงินผ่านตัวกลาง
5. ค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุน/ผู้ถือหุ้น
6. การใช้สิทธิออกเสียงในที่ประชุมผู้ถือหุ้น

ผลสรุปการติดตามดูแลการจัดการกองทุนรวม สำหรับปี 2566 พบว่า บริษัทปฏิบัติตามหลักเกณฑ์ภายในของบริษัทและประกาศ กสท. ที่เกี่ยวข้อง และไม่พบการกระทำที่อาจก่อให้เกิดความขัดแย้งทางผลประโยชน์ การกระทำที่อาจมีลักษณะไม่เป็นธรรม และการกระทำที่อาจทำให้ผู้ถือหุ้นหน่วยงานเสียประโยชน์อันพึงได้รับ โดยมีรายละเอียดดังนี้

รายงานการติดตามดูแลการจัดการกองทุนรวม ประจำปี 2566

(Independent Oversight Entity Report 2023)

เรื่อง	ผลการติดตามดูแล
1. การซื้อขายผลิตภัณฑ์ในตลาดทุนและตราสารทางการเงินกับบุคคลที่เกี่ยวข้องกับการประกอบธุรกิจ และการซื้อขายผลิตภัณฑ์ในตลาดทุนและตราสารทางการเงินที่ไม่มีราคาตลาดหรือไม่มีสภาพคล่อง	
1.1 การซื้อขายระหว่างกองทุนกับบุคคลที่เกี่ยวข้อง รวมถึงการซื้อขายระหว่าง บลจ. กับกองทุน	กระบวนการซื้อขายระหว่างกองทุนกับบุคคลที่เกี่ยวข้องรวมถึงการซื้อขายระหว่าง บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ดาโอ จำกัด กับกองทุน มีรายละเอียดการควบคุมดังนี้ <ul style="list-style-type: none"> - บริษัทจัดการมีการกำหนดบุคคลที่เกี่ยวข้องครบถ้วนตามที่ประกาศสำนักงาน ก.ล.ต. กำหนด - บริษัทจัดการมีบริษัทหลักทรัพย์ ดาโอ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) ซึ่งเป็นบริษัทในเครือเป็นหนึ่งในบริษัทนายหน้าที่ใช้บริการ โดยคิดค่าธรรมเนียมในอัตราตลาด มีการประเมินคุณภาพประจำปีโดยใช้เกณฑ์เดียวกับการประเมินบริษัทนายหน้ารายอื่น - รายการซื้อขายหลักทรัพย์ระหว่างบุคคลที่เกี่ยวข้องกันหรือระหว่างกองทุนใช้ราคาที่เหมาะสม เป็นธุรกรรมที่ดีที่สุดสำหรับลูกค้า และการทำรายการเป็นประโยชน์ต่อกองทุนในขณะนั้น - บริษัทจัดการเปิดเผยรายงานธุรกรรมกับบุคคลที่เกี่ยวข้องตามที่สำนักงาน ก.ล.ต. กำหนด ผ่านหน้าเว็บไซต์ของบริษัทจัดการ (www.daolinvestment.co.th)
1.2 การซื้อขายหลักทรัพย์ที่ไม่มีสภาพคล่องหรือไม่มีราคาตลาด	ไม่พบรายการซื้อขายหลักทรัพย์ที่ไม่มีสภาพคล่องหรือไม่มีราคาตลาด โดยบริษัทจัดการมีขั้นตอนการคัดเลือกและอนุมัติหลักทรัพย์ที่ให้ซื้อขายได้ และได้จัดทำ Universe สำหรับตราสารทุนและตราสารหนี้ไว้ โดยหลักทรัพย์ส่วนใหญ่มีการซื้อขายในตลาด เป็นกลุ่มระดับลงทุน (Investment Grade) และมีราคาตลาดชัดเจน นอกจากนี้ กองทุนซื้อขายหลักทรัพย์ที่ได้รับการอนุมัติและอยู่ใน Universe ทุกรายการ
2. วิธีการบริหารจัดการกองทุนรวม	
วัตถุประสงค์ นโยบาย และกลยุทธ์การลงทุน	บริษัทจัดการบริหารกองทุนรวมเป็นไปตามที่ได้เปิดเผยไว้ในหนังสือชี้ชวน โดยการลงทุนเป็นไปตามตามกรอบนโยบายการลงทุน และอัตราส่วนการลงทุน (limit) เป็นไปตามประกาศสำนักงาน ก.ล.ต. กำหนด
3. การคัดเลือกและติดตามการให้บริการของผู้ให้บริการ (Service Provider) (เฉพาะค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุน)	
3.1 การคัดเลือกผู้ให้บริการ	<ul style="list-style-type: none"> - บริษัทจัดการมีเกณฑ์และขั้นตอนในการคัดเลือกผู้ให้บริการเป็นลายลักษณ์อักษร - สำหรับเกณฑ์ในการคัดเลือกนายทะเบียน มีระบุไว้ใน “โครงการสนับสนุนที่เกี่ยวข้องกับการประกอบธุรกิจการจัดการกองทุน” และได้มีการจัดทำเอกสารประกอบการคัดเลือกผู้ให้บริการอย่างครบถ้วนและถูกต้อง
3.2 คุณภาพการให้บริการ	<ul style="list-style-type: none"> - บริษัทจัดการกำหนดหลักเกณฑ์การประเมินคุณภาพผู้ให้บริการเป็นลายลักษณ์อักษร - บริษัทจัดการประเมินคุณภาพผู้ให้บริการทุกรายตามหลักเกณฑ์ที่กำหนดและจัดทำเอกสารประกอบการประเมินอย่างครบถ้วน
4. การส่งคำสั่งซื้อขายผลิตภัณฑ์ในตลาดทุนและตราสารทางการเงินผ่านตัวกลาง	
4.1 การคัดเลือก broker	ฝ่ายจัดการลงทุนมีการพิจารณาเลือกนายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ตามหลักเกณฑ์ที่กำหนด

เรื่อง	ผลการติดตามดูแล
4.2 การส่งคำสั่งซื้อขาย	<ul style="list-style-type: none"> - ฝ่ายจัดการลงทุนมีการประเมินนายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ และทำการจัดสรรคำสั่งซื้อขายหลักทรัพย์ เป็นไปตามหลักเกณฑ์ที่ได้กำหนดไว้ - ฝ่ายจัดการลงทุนมีการรายงานผลปริมาณการส่ง คำสั่งซื้อขายหลักทรัพย์และค่านายหน้า เป็น รายไตรมาส โดยรายงานครบทุกไตรมาส และไม่มีการส่งคำสั่งซื้อขายหลักทรัพย์เกินกว่าปริมาณที่กำหนด
4.3 คุณภาพการให้บริการ	<ul style="list-style-type: none"> - ฝ่ายจัดการลงทุนมีการประเมินนายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ทุกไตรมาส ซึ่งได้จัดทำตามเกณฑ์การประเมินคุณภาพการให้บริการที่กำหนดไว้อย่างครบถ้วน - ฝ่ายบริหารความเสี่ยงติดตามดูแลการทำธุรกรรมเพื่อลูกค้าเกินความจำเป็น (Churning) อย่างสม่ำเสมอและมีการรายงานต่อคณะกรรมการบริหารความเสี่ยงเมื่อมีการทำธุรกรรมที่ผิดปกติเกิดขึ้น
5. ค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุน/ผู้ถือหุ้น	
5.1 การเก็บค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายจากกองทุน/ผู้ถือหุ้น	<p>การเก็บค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายกองทุนรวมเป็นไปตามที่กำหนดไว้ในโครงการ และมีการเปิดเผยค่าธรรมเนียมต่างๆ เช่น ค่าธรรมเนียมการจัดการ ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน และค่าสอบบัญชี นอกจากนี้ อัตราค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายที่บริษัทจัดการเรียกเก็บจากกองทุนมีความเหมาะสม และมีอัตราใกล้เคียงกับอุตสาหกรรม และเรียกเก็บจริงไม่เกินกว่าเพดานที่ระบุไว้ในหนังสือชี้ชวน</p>
6. การใช้สิทธิออกเสียงในที่ประชุมผู้ถือหุ้น	
6.1 นโยบายในการใช้สิทธิออกเสียง	<p>ฝ่ายจัดการลงทุนได้มีการกำหนดนโยบายในการใช้สิทธิออกเสียงไว้ใน “นโยบายและแนวทางการปฏิบัติการใช้สิทธิออกเสียงในที่ประชุมผู้ถือหุ้นโดยบริษัทจัดการในนามกองทุน”</p>
6.2 การไปใช้สิทธิออกเสียง	<p>ฝ่ายจัดการลงทุนมีการใช้สิทธิออกเสียงอย่างครบถ้วนเป็นไปตามนโยบายและแนวปฏิบัติของ บริษัทจัดการ และจัดทำเอกสารให้สามารถตรวจสอบได้ โดยการใช้สิทธิออกเสียงจะคำนึงถึงประโยชน์ของกองทุนและผู้ถือหุ้นเป็นหลัก</p>
6.3 การเปิดเผยข้อมูลการใช้สิทธิออกเสียง	<p>บริษัทจัดการเปิดเผยการใช้สิทธิการออกเสียงที่ประชุมผู้ถือหุ้น สำหรับปี 2566 ไว้ในเว็บไซต์อย่างครบถ้วน และให้เหตุผลในกรณีออกเสียงคัดค้านและงดออกเสียงเป็นไปตามนโยบายและแนวปฏิบัติของ บริษัทจัดการ</p>