

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ทาลิส จำกัด

ข้อมูล ณ วันที่ 29 ก.ย. 2566

กองทุนเปิดทาลิส หุ้นทุน เพื่อการเลี้ยงชีพ

TLEQRMF

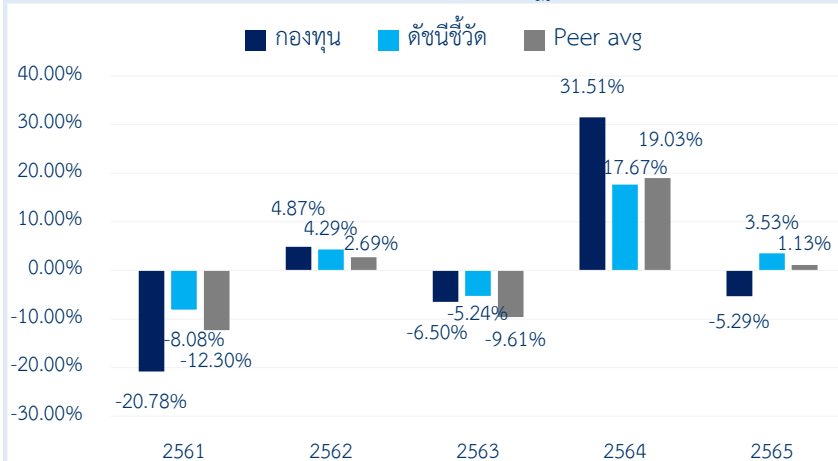
ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมตราสารทุน
- กองทุนรวมเพื่อการเลี้ยงชีพ (Retirement Mutual Fund: RMF)
- กลุ่ม Equity General

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- ลงทุนในตราสารทุน หุ้นสามัญของบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย และ/หรือตลาดหลักทรัพย์ เอ็ม เอ ไอ ที่มีปัจจัยพื้นฐานดี
- มุ่งหวังให้ผลประกอบการสูงกว่าดัชนีชี้วัด (Active Management)

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (%ต่อปี)



ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปีกลุ่ม (%ต่อปี¹)

	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี ¹
กองทุน	-9.99	4.41	-3.59	-9.89
ดัชนีชี้วัด	-9.56	-1.40	-7.04	-4.86
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	-8.22	-0.11	-4.59	-3.54
ความผันผวนกองทุน	16.34	14.57	16.10	15.59
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	11.51	10.28	11.20	11.11
	3 ปี ¹	5 ปี ¹	10 ปี ¹	ตั้งแต่จัดตั้ง ¹
กองทุน	8.30	-0.69	N/A	0.82
ดัชนีชี้วัด	8.96	-0.54	N/A	3.07
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	7.54	-1.81	N/A	N/A
ความผันผวนกองทุน	16.31	19.15	N/A	17.29
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	13.07	16.85	N/A	15.06

ระดับความเสี่ยง

ต่ำ 1 2 3 4 5 6 7 8 สูง

เสี่ยงสูง

ลงทุนในตราสารทุนเป็นหลักโดยเฉลี่ย

ในรอบปีไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน	18 พ.ย. 2559
นโยบายการจ่ายเงินปันผล	ไม่จ่าย
อายุกองทุน	ไม่กำหนด

ผู้จัดการกองทุนรวม

นาย วีระพล สิมะโรจน์ (ตั้งแต่ 18 พ.ย. 2559)

น.ส. ปวเรศร์ ตั้งอภิชาติเจริญ (ตั้งแต่ 18 พ.ย. 2559)

ดัชนีชี้วัด :

ดัชนีผลตอบแทนรวมตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET TRI) สัดส่วน 100%

คำเตือน

- การลงทุนไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีต มิได้เป็นสิ่งยืนยันผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต: ได้รับการรับรองจาก CAC

จัดอันดับกองทุน Morningstar

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

"ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือ
บริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่อง
ได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม"



www.talisam.co.th

การซื้อขายหน่วยลงทุน		ข้อมูลเชิงสถิติ	
วันทำการซื้อ : ทุกวันทำการ	วันทำการขายคืน : ทุกวันทำการ	Maximum Drawdown	-44.32%
เวลาทำการ : 8.30 น. - 15.30 น.	เวลาทำการ : 8.30 น. - 15.30 น.	Recovering Period	11 เดือน 14 วัน
การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ : 1,000 บาท	การขายคืนขั้นต่ำ : ไม่กำหนด	อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน	0.94 เท่า
การซื้อครั้งถัดไปขั้นต่ำ : 1,000 บาท	ยอดคงเหลือขั้นต่ำ : ไม่กำหนด	Sharpe Ratio	0.47
	ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน : T+3	Alpha	-0.65
		Beta	0.95
หมายเหตุ			

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)		
ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	3.2100	2.1400
รวมค่าใช้จ่าย	3.8520	2.3319

หมายเหตุ 1) ค่าธรรมเนียมหรือค่าใช้จ่ายดังกล่าวได้รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะ หรือภาษีอื่นใดแล้ว
2) สามารถดูค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวมย้อนหลัง 3 ปี ในหนังสือชี้ชวนส่วนข้อมูลกองทุนรวมได้ที่ www.talisam.co.th

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)		
ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การขาย	3.00	ยกเว้น
การรับซื้อคืน	3.00	ยกเว้น
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า	ไม่มี	ไม่มี
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก	ไม่มี	ไม่มี*
การโอนหน่วย	ไม่มี	ไม่มี

หมายเหตุ (1) ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ซื้อได้รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะ หรือภาษีอื่นใดแล้ว โดยบริษัทจัดการอาจเรียกเก็บค่าธรรมเนียมจากผู้ลงทุนโดยตรง (2) ค่าธรรมเนียมการขาย/การรับซื้อคืน/การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนอาจเรียกเก็บจากผู้ถือหน่วยลงทุนแต่ละกลุ่มหรือแต่ละรายในอัตราที่ไม่เท่ากัน โดยบริษัทจัดการจะแจ้งรายละเอียดและหลักเกณฑ์ให้ทราบต่อไป (3) ค่าธรรมเนียมการสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนไปกองทุน RMF ภายใต้การจัดการของบลจ.อื่น : 200 บาทต่อรายการโดยเรียกเก็บเป็นเงินสด

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน		ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก	
breakdown	% NAV	holding	% NAV
หุ้นสามัญ	90.56	บริษัท ซีพี ออลล์ จำกัด (มหาชน)	6.12
เงินฝากธนาคาร	9.62	บริษัท ท่าอากาศยานไทย จำกัด (มหาชน)	5.34
สินทรัพย์อื่นหรือหนี้สินอื่น	-0.18	บริษัท คอมเซเว่น จำกัด (มหาชน)	4.89
		บริษัท ทีคิวเอ็ม อัลฟา จำกัด (มหาชน)	4.60
		บริษัท ฟอर्थ คอร์ปอเรชั่น จำกัด (มหาชน)	4.53

การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม	
sector	% NAV
บริการ	39.30
เทคโนโลยี	15.47
ธุรกิจการเงิน	12.46
ทรัพยากร	10.70
อสังหาริมทรัพย์และก่อสร้าง	7.29

คำอธิบาย

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุนของกองทุนรวม (Portfolio Turnover) : เพื่อให้พิจารณาปริมาณการซื้อขายทรัพย์สินของกองทุน และสะท้อนกลยุทธ์การลงทุนของผู้จัดการกองทุน โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อขายทรัพย์สินกับผลรวมของมูลค่าการขายทรัพย์สินที่กองทุนรวมลงทุนในรอบระยะเวลาบัญชีที่ผ่านมาอย่างน้อย 1 ปีหารด้วยมูลค่าทรัพย์สินสุทธิเฉลี่ย (NAV) ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลาบัญชีเดียวกัน

Maximum drawdown : เพื่อให้พิจารณาผลขาดทุนสะสมสูงสุดที่เกิดจากการลงทุนจริงของกองทุนรวมย้อนหลังเป็นระยะเวลาอย่างน้อย 5 ปีนับแต่วันที่รายงาน (หรือตั้งแต่จัดตั้งกองทุน กรณียังไม่ครบ 5 ปี)

Recovering period : เพื่อให้ทราบถึงระยะเวลาการฟื้นตัวซึ่งเป็นระยะเวลาตั้งแต่การขาดทุนสะสมสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้

Hedging Ratio : เพื่อให้ทราบถึงสัดส่วนของการลงทุนที่มีการป้องกันความเสี่ยงอัตราแลกเปลี่ยน

Sharpe ratio : เพื่อให้พิจารณาผลตอบแทนเทียบกับความเสี่ยงของกองทุน ซึ่งใช้ในการเปรียบเทียบระหว่างกองทุนที่มีนโยบายการลงทุนเหมือนกัน โดยกองทุนที่มีค่า Sharpe ratio สูงกว่าจะเป็นกองทุนที่บริหารความเสี่ยงของพอร์ตการลงทุนดีกว่า

Alpha : เพื่อให้พิจารณาผลตอบแทนส่วนเกินของกองทุนเมื่อเปรียบเทียบกับดัชนีชี้วัด (“benchmark”) (ค่าสูงแสดงถึงผลตอบแทนสูงกว่าดัชนีชี้วัด)

Beta : เพื่อให้พิจารณาความผันผวนของกองทุนเมื่อเปรียบเทียบกับตลาด (ค่าต่ำแสดงถึงความเสี่ยงต่ำ)

Tracking Error : เพื่อให้พิจารณาความผันผวนของส่วนต่างของผลตอบแทนเฉลี่ยของกองทุนรวมและผลตอบแทนของดัชนีชี้วัด ซึ่งสะท้อนให้เห็นถึงประสิทธิภาพในการเลียนแบบดัชนีชี้วัดของกองทุนรวมว่ามีการเบี่ยงเบนออกไปจากดัชนีชี้วัด มากน้อยเพียงใด เช่น หากกองทุนรวมมีค่า TE ต่ำ แสดงว่า อัตราผลตอบแทนของกองทุนมีการเบี่ยงเบนออกไปจากดัชนีชี้วัดในอัตราที่ต่ำ ดังนั้น กองทุนรวมนี้นี้จึงมีประสิทธิภาพในการเลียนแบบดัชนีอ้างอิง ในขณะที่กองทุนรวมที่มีค่า TE สูง แสดงว่าอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมมีการเบี่ยงเบนออกจากดัชนีชี้วัดในอัตราที่สูง ดังนั้น โอกาสที่ผลตอบแทนการลงทุนจะเป็นไปตามผลตอบแทนของ benchmark ก็จะมีลดน้อยลง เป็นต้น

Yield to Maturity : เพื่อให้พิจารณาอัตราผลตอบแทนเมื่อถือจนครบกำหนดอายุ ซึ่งได้จากการคำนวณหาอัตราคิดลดที่ทำให้มูลค่าปัจจุบันของกระแสเงินสดที่ได้รับจากตราสารหนี้ เท่ากับราคาตลาดบวกกับดอกเบี้ยค้างรับ

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ทาลิส จำกัด

โทรศัพท์: 02 015 0222 www.talisam.co.th

เลขที่ 89 ชั้น 10 ห้อง 1001-1002 อาคาร AIA Capital Center

ถนนรัชดาภิเษก แขวงดินแดง เขตดินแดง กรุงเทพฯ 10400