

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ทาลิส จำกัด

ข้อมูล ณ วันที่ 31 มี.ค. 2569

## กองทุนเปิดทาลิส DIVIDEND STOCK FOCUS

TLDIVFOCUS

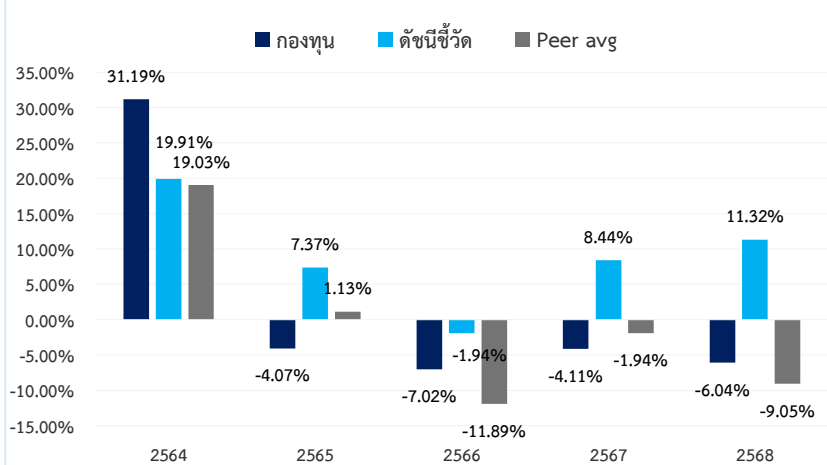
### ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมตราสารทุน
- กลุ่ม Equity General

### นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- ลงทุนในหุ้นสามัญของบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย และ/หรือ ตลาดหลักทรัพย์ เอ็ม เอ ไอ ที่มีปัจจัยพื้นฐานดี รวมถึงมีแนวโน้มที่จ่ายเงินปันผล ตามหลักเกณฑ์คัดเลือกที่บริษัทจัดการกำหนด โดยกองทุนจะมีการลงทุนที่ส่งผลให้มี net exposure ในตราสารทุนข้างต้นโดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่า 80% ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน
- มุ่งหวังให้ผลประกอบการเคลื่อนไหวสูงกว่าดัชนีชี้วัด (Active Management)

### ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (%ต่อปี)



### ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปีกumul (%ต่อปี\*)

|                          | YTD   | 3 เดือน | 6 เดือน | 1 ปี*           |
|--------------------------|-------|---------|---------|-----------------|
| กองทุน                   | 12.65 | 12.65   | 11.88   | 16.64           |
| ดัชนีชี้วัด              | 11.52 | 11.52   | 16.79   | 27.12           |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน | 12.45 | 12.45   | 11.31   | 18.75           |
| ความผันผวนกองทุน         | 17.88 | 17.88   | 14.49   | 14.54           |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด    | 15.84 | 15.84   | 13.72   | 15.78           |
|                          | 3 ปี* | 5 ปี*   | 10 ปี*  | ตั้งแต่จัดตั้ง* |
| กองทุน                   | -1.75 | 0.68    | N/A     | -0.41           |
| ดัชนีชี้วัด              | 10.86 | 8.47    | N/A     | 5.58            |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน | -3.11 | -1.42   | N/A     | N/A             |
| ความผันผวนกองทุน         | 12.72 | 13.52   | N/A     | 15.04           |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด    | 13.31 | 12.35   | N/A     | 17.02           |

### ระดับความเสี่ยง



ลงทุนในตราสารทุนเป็นหลักโดยเฉลี่ย  
ในรอบปีไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV

### ข้อมูลกองทุนรวม

|   |                       |
|---|-----------------------|
| วันจดทะเบียนกองทุน                        | 24 พ.ย. 2560          |
| นโยบายการจ่ายเงินปันผล                    | จ่าย                  |
| อายุกองทุน                                | ไม่กำหนด              |
| การป้องกันความเสี่ยง FX                   | ไม่ป้องกัน (unhedged) |
| การเรียกเก็บค่าธรรมเนียมตามผลการดำเนินงาน | ไม่มี                 |

### ผู้จัดการกองทุนรวม

นาย วีระพล สิมะโรจน์ (ตั้งแต่ 24 พ.ย. 2560)  
นาย จักรกฤษณ์ กิ่งชุม (ตั้งแต่ 25 พ.ย. 2568)

### ดัชนีชี้วัด :

ดัชนีผลตอบแทนรวม SET High Dividend 30 Index (SETHD TRI) สัดส่วน 100% เพื่อเปรียบเทียบกับผลการดำเนินงานของกองทุน  
วัตถุประสงค์ในการอ้างอิงดัชนีชี้วัด : เพื่อเปรียบเทียบกับผลการดำเนินงานของกองทุน

### คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวม มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต: ได้รับการรับรองจาก CAC

จัดอันดับกองทุน Morningstar

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



"ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือ  
บริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่อง  
ได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม"

www.talisam.co.th

| การซื้อขายหน่วยลงทุน                    | การขายคืนหน่วยลงทุน               | ข้อมูลเชิงสถิติ                       |
|---|-----------------------------------|---------------------------------------|
| วันทำการซื้อ : ทุกวันทำการ              | วันทำการขายคืน : ทุกวันทำการ      | Maximum Drawdown -34.89%              |
| เวลาทำการ : 8.30 น. - 15.30 น.          | เวลาทำการ : 8.30 น. - 15.30 น.    | Recovering Period 1 ปี 8 เดือน 23 วัน |
| การซื้อขายครั้งแรกขั้นต่ำ : 1,000 บาท   | การขายคืนขั้นต่ำ : ไม่กำหนด       | อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน 0.68 เท่า  |
| การซื้อขายครั้งถัดไปขั้นต่ำ : 1,000 บาท | ยอดคงเหลือขั้นต่ำ : ไม่กำหนด      | Sharpe Ratio -0.29                    |
|   | ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน : T+3 | Alpha -12.61                          |
|   |                                   | Beta 0.81                             |

หมายเหตุ บริษัทจัดการปิดรับคำสั่งซื้อและ/หรือคำสั่งสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้าจากกองทุนรวมอื่น ทั้งนี้สามารถสับเปลี่ยนออกไปยังกองทุนรวมอื่นของบริษัทจัดการได้ มีผลตั้งแต่วันที่ 5 มกราคม 2569 เป็นต้นไป หรือจนกว่าจะมีประกาศเปลี่ยนแปลง

**ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)** ค่าธรรมเนียมต่อไปนี้จะส่งผลกระทบต่อ

ต่อผู้ลงทุน เนื่องจากจะทำให้ผลตอบแทนจากการลงทุนลดลง ดังนั้น ผู้ลงทุนควรตรวจสอบทุกครั้งก่อนตัดสินใจลงทุน

| ค่าธรรมเนียม   | สูงสุดไม่เกิน | เก็บจริง |
|--|---------------|----------|
| การจัดการ  | 3.2100        | 2.1400   |
| ค่าตอบแทนแก่ตัวแทนขายหน่วยลงทุนของกองทุนรวม (trailer fee) : มี |               |          |
| รวมค่าใช้จ่าย  | 4.5154        | 2.4192   |

หมายเหตุ 1) ค่าธรรมเนียมหรือค่าใช้จ่ายดังกล่าวได้รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะ หรือภาษีอื่นใดแล้ว 2) ค่าใช้จ่ายรวมที่เรียกเก็บจริง เป็นข้อมูลของรอบระยะเวลาบัญชี วันที่ 1 พ.ย. 67 - 31 ต.ค. 68 3) สามารถดูค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวมย้อนหลัง 3 ปี ในหนังสือชี้ชวนส่วนข้อมูลกองทุนรวมได้ที่ [www.talisam.co.th](http://www.talisam.co.th) 4) บริษัทอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ 5) บริษัทจัดการปรับเพิ่มค่าธรรมเนียมนายทะเบียนกองทุน โดยมีผลตั้งแต่วันที่ 1 ก.พ. 69 เป็นต้นไป

**ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)** ผู้ลงทุนจะถูกเรียกเก็บค่าธรรมเนียม

ต่อไปนี้โดยตรงทุกครั้งเมื่อทำรายการซื้อขายหรือสับเปลี่ยนหน่วยลงทุน

| ค่าธรรมเนียม                | สูงสุดไม่เกิน       | เก็บจริง            |
|-----------------------------|---------------------|---------------------|
| การขาย                      | 3.00                | ยกเว้น              |
| การรับซื้อคืน               | 3.00                | ยกเว้น              |
| การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า | 3.00                | 1.00                |
| การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก  | 3.00                | ยกเว้น              |
| การโอนหน่วย*                | 100 บาท/1,000 หน่วย | 100 บาท/1,000 หน่วย |

หมายเหตุ (1) ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วยซื้อขายได้รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะ หรือภาษีอื่นใดแล้ว โดยบริษัทจัดการอาจเรียกเก็บค่าธรรมเนียมจากผู้ลงทุนโดยตรง (2) ค่าธรรมเนียมการขาย/การรับซื้อคืน/การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนอาจเรียกเก็บจากผู้ถือหน่วยลงทุนแต่ละกลุ่มในอัตราที่ไม่เท่ากัน โดยบริษัทจัดการจะแจ้งรายละเอียดและหลักเกณฑ์ให้ทราบต่อไป (3)\* ค่าธรรมเนียมการโอนหน่วย 100 บาท/1,000 หน่วยลงทุน ขั้นต่ำ 500 บาท

| สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน    | ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก                        |
|-----------------------------------|--|
| breakdown % NAV                   | holding % NAV  |
| หุ้นสามัญ 89.99                   | ธนาคารทหารไทยธนชาติ จำกัด (มหาชน) 7.53               |
| เงินฝากธนาคาร 7.69                | บริษัท ปตท. จำกัด (มหาชน) 6.93                       |
| สินทรัพย์อื่นหรือหนี้สินอื่น 2.32 | บริษัท เอสซีบี เอกซ์ จำกัด (มหาชน) 6.70              |
|                                   | บริษัท ปตท.สำรวจและผลิตปิโตรเลียม จำกัด (มหาชน) 6.66 |
|                                   | ธนาคารกสิกรไทย จำกัด (มหาชน) 6.59                    |

**การจัดสรรการลงทุนในกลุ่ม**

**อุตสาหกรรม**

| sector                     | % NAV |
|----------------------------|-------|
| ธุรกิจการเงิน              | 35.17 |
| ทรัพยากร                   | 23.43 |
| บริการ                     | 11.14 |
| อสังหาริมทรัพย์และก่อสร้าง | 10.94 |
| เทคโนโลยี                  | 5.32  |

## คำอธิบาย

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

**Recovering Period** ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาตั้งแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลานานเท่าใด

**FX Hedging** เปรอ์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

**อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน** ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลาหนึ่ง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์กับผลรวมของมูลค่าการขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 1 ปี หาดด้วยมูลค่า 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 ซึ่งเป็นผลมาจากประสิทธิภาพของผู้จัดการกองทุนในการคัดเลือกหรือหาจังหวะเข้าลงทุนในหลักทรัพย์ได้อย่างเหมาะสม

**Beta** ระดับและทิศทางของการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุน โดยเปรียบเทียบกับอัตราการเปลี่ยนแปลงของตลาด

Beta น้อยกว่า 1 แสดงว่าหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนน้อยกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด

Beta มากกว่า 1 แสดงว่าหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนมากกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด

**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