

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ทาลิส จำกัด

ข้อมูล ณ วันที่ 31 ก.ค. 2569

กองทุนเปิดทาลิส ตลาดเงิน

ชนิดสะสมมูลค่า

TLMMF-A

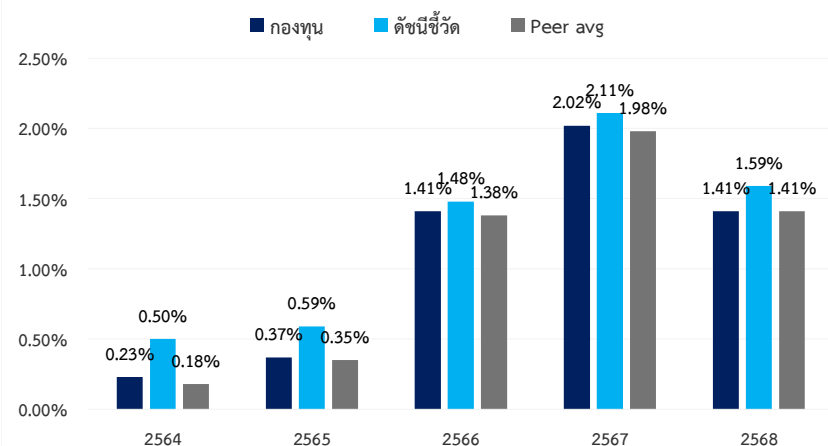
ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมตลาดเงินในประเทศ / กองทุนที่ลงทุนแบบไม่มีความเสี่ยงต่างประเทศ
- กลุ่ม Money Market - Government

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- ลงทุนในตราสารหนี้ภาครัฐหรือภาคเอกชน เงินฝากหรือตราสารเทียบเท่าเงินฝาก หน่วยลงทุนของกองทุนรวมตลาดเงิน หรือตราสารการเงินอื่นใดที่เสนอขายในประเทศ
- มุ่งหวังให้ผลประกอบการเคลื่อนไหวสูงกว่าดัชนีชี้วัด (Active Management)

ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (%ต่อปี)



ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด (%ต่อปี*)

	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี*
กองทุน	0.45	0.16	0.37	0.93
ดัชนีชี้วัด	0.56	0.21	0.50	1.14
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	0.45	0.17	0.38	0.93
ความผันผวนกองทุน	0.04	0.03	0.03	0.04
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	0.06	0.05	0.06	0.07
	3 ปี*	5 ปี*	10 ปี*	ตั้งแต่จัดตั้ง*
กองทุน	1.54	1.15	N/A	1.07
ดัชนีชี้วัด	1.67	1.31	N/A	1.26
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	1.53	1.14	N/A	N/A
ความผันผวนกองทุน	0.07	0.07	N/A	0.06
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	0.09	0.08	N/A	0.08

ระดับความเสี่ยง

ต่ำ 1 2 3 4 5 6 7 8 สูง

เสี่ยงต่ำ

ลงทุนในเงินฝาก ตราสารเทียบเท่าเงินฝาก พันธบัตรรัฐบาล หรือพันธบัตร ธปท. ซึ่งมีอายุไม่เกิน 397 วัน โดยไม่มีความเสี่ยงต่างประเทศ

ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน	9 ธ.ค. 2559
วันเริ่มต้น class	9 ธ.ค. 2559
นโยบายการจ่ายเงินปันผล	ไม่จ่าย
อายุกองทุน	ไม่กำหนด
การป้องกันความเสี่ยง FX	ไม่ป้องกัน (unhedged)
การเรียกเก็บค่าธรรมเนียมตามผลการดำเนินงาน	ไม่มี

ผู้จัดการกองทุนรวม

นาย วีระพล สิมะโรจน์ (ตั้งแต่ 9 ธ.ค. 2559)
น.ส. ปวเรศร์ ตั้งอภิชาติเจริญ (ตั้งแต่ 9 ธ.ค. 2559)

ดัชนีชี้วัด :

1) ดัชนีตราสารหนี้ภาครัฐระยะสั้น (Short-term Government Bond Index) 55% 2) ดัชนีตราสารหนี้ภาคเอกชนระยะสั้น (Commercial Paper Index) ที่มีอันดับความน่าเชื่อถือของผู้ออกตราสารอยู่ในระดับ A- ขึ้นไป 20% 3) อัตราดอกเบี้ยเงินฝากประจำ 3 เดือน วงเงินน้อยกว่า 5 ล้านบาท เฉลี่ยของ 3 ธนาคารพาณิชย์ขนาดใหญ่ ได้แก่ BBL KBANK SCB หลังหักภาษี 25% (กองทุนมีการเปลี่ยนแปลงดัชนีชี้วัดตั้งแต่วันที่ 1 พฤศจิกายน 2562 เป็นต้นไป) วัตถุประสงค์ในการอ้างอิงดัชนีชี้วัด : เพื่อเปรียบเทียบกับผลการดำเนินงานของกองทุน

คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
 - ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวม มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต
- การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต: ได้รับการรับรองจาก CAC
จัดอันดับกองทุน Morningstar

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



"ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือบริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่องได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม"

www.talisam.co.th

การซื้อขายหน่วยลงทุน	การขายคืนหน่วยลงทุน	ข้อมูลเชิงสถิติ	
วันทำการซื้อ : ทุกวันทำการ	วันทำการขายคืน : ทุกวันทำการ	Maximum Drawdown	0.00%
เวลาทำการ : 8.30 น. - 15.30 น.	เวลาทำการ : 8.30 น. - 15.30 น.	Recovering Period	3 วัน
การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ : 1,000 บาท	การขายคืนขั้นต่ำ : 1,000 บาท	อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน	0.68 เท่า
การซื้อครั้งถัดไปขั้นต่ำ : 1,000 บาท	ยอดคงเหลือขั้นต่ำ : 100 หน่วย	อายุเฉลี่ยของตราสารหนี้	1 เดือน 10 วัน
	ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน : T+1	Yield to Maturity	0.84%

หมายเหตุ มูลค่าขั้นต่ำของการสั่งซื้อ/ ขายคืน และยอดคงเหลือขั้นต่ำข้างต้น เป็นการปรับลดจากที่ กำหนดไว้ในโครงการ

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV) ค่าธรรมเนียมต่อไปนี้จะส่งผลกระทบต่อผู้ลงทุน เนื่องจากจะทำให้ผลตอบแทนจากการลงทุนลดลง ดังนั้น ผู้ลงทุนควรตรวจสอบทุกครั้งก่อนตัดสินใจลงทุน		
ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	0.5350	0.0803
ค่าตอบแทนแก่ตัวแทนขายหน่วยลงทุนของกองทุนรวม (trailer fee) : มี		
รวมค่าใช้จ่าย	0.8025	0.1905

หมายเหตุ 1) ค่าธรรมเนียมหรือค่าใช้จ่ายดังกล่าวได้รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะ หรือภาษีอื่นใดแล้ว 2) ค่าใช้จ่ายรวมที่เรียกเก็บจริง เป็นข้อมูลของรอบระยะเวลาบัญชี วันที่ 1 ธ.ค. 67 - 30 พ.ย. 68 3) สามารถดูค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวมย้อนหลัง 3 ปี ในหนังสือชี้ชวนส่วนข้อมูลกองทุนรวมได้ที่ www.talisam.co.th 4) บริษัทอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ 5) บริษัทจัดการปรับเพิ่มค่าธรรมเนียมนายทะเบียนกองทุน โดยมีผลตั้งแต่วันที่ 1 ก.พ. 69 เป็นต้นไป

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย) ผู้ลงทุนจะถูกเรียกเก็บค่าธรรมเนียมต่อไปนี้โดยตรงทุกครั้งเมื่อทำรายการซื้อขายหรือสับเปลี่ยนหน่วยลงทุน		
ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การขาย	ไม่มี	ไม่มี
การรับซื้อคืน	ไม่มี	ไม่มี
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า	ไม่มี	ไม่มี
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก	ไม่มี	ไม่มี
การโอนหน่วย*	100 บาท/1,000 หน่วย	100 บาท/1,000 หน่วย

หมายเหตุ (1) ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้สั่งซื้อได้รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะ หรือภาษีอื่นใดแล้ว โดยบริษัท จัดการอาจเรียกเก็บค่าธรรมเนียมจากผู้ลงทุนโดยตรง (2) ค่าธรรมเนียมการขาย/การรับซื้อคืน/การสับเปลี่ยนหน่วย ลงทุนอาจเรียกเก็บจากผู้ถือหน่วยลงทุนแต่ละกลุ่มในอัตราที่ไม่เท่ากัน โดยบริษัทจัดการจะแจ้งรายละเอียดและ หลักเกณฑ์ให้ทราบต่อไป (3)* ค่าธรรมเนียมการโอนหน่วย 100 บาท/1,000 หน่วยลงทุน ขั้นต่ำ 500 บาท

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน	ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก
breakdown % NAV	holding % NAV
ตราสารหนี้ภาครัฐ	91.94 พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยวุดที่ 23/91/69 11.03
เงินฝากเพื่อการลงทุน	5.52 พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยวุดที่ 24/91/69 10.11
เงินฝากธนาคาร	2.56 พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยวุดที่ 19/91/69 9.75
	พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยวุดที่ 18/91/69 9.29
	พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยวุดที่ 29/91/69 7.53

การจัดสรรการลงทุนในผู้ออกตราสาร 5 อันดับแรก	
issuer	% NAV
ธนาคารแห่งประเทศไทย	91.94

การจัดสรรการลงทุนตามอันดับความน่าเชื่อถือ (%)	
ในประเทศ	national international
GOV/AAA/AAA(tha)	97.46

คำอธิบาย

Maximum Drawdown เพอร์เซ็นต์ผลขาดทุนสูงสุดของกองทุนรวมในระยะเวลา 5 ปีย้อนหลัง (หรือตั้งแต่จัดตั้งกองทุนกรณีที่ยังไม่ครบ 5 ปี) โดยวัดจากระดับ NAV ต่อหน่วยที่จุดสูงสุดไปจนถึงจุดต่ำสุดในช่วงที่ NAV ต่อหน่วยปรับตัวลดลง ค่า Maximum Drawdown เป็นข้อมูลที่ช่วยให้ทราบถึงความเสี่ยงที่อาจจะขาดทุนจากการลงทุนในกองทุนรวม **Recovering Period** ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาดังแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลานานเท่าใด **FX Hedging** เพอร์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตกองทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลาหนึ่ง 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 สูงกว่าจะเป็นกองทุนที่มีประสิทธิภาพในการบริหารจัดการลงทุนที่ดีกว่า เนื่องจากได้รับผลตอบแทนส่วนเพิ่มที่สูงกว่าภายใต้ระดับความเสี่ยงเดียวกัน

Alpha ผลตอบแทนส่วนเกินของกองทุนรวมเมื่อเปรียบเทียบกับดัชนีชี้วัด (benchmark) โดยค่า Alpha ที่สูง หมายถึง กองทุนสามารถสร้างผลตอบแทนได้สูงกว่าดัชนีชี้วัด ซึ่งเป็นผลจากประสิทธิภาพของผู้จัดการกองทุนในการคัดเลือกหรือหาจังหวะเข้าลงทุนในหลักทรัพย์ได้อย่างเหมาะสม

Beta ระดับและทิศทางการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุน 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

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