

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ทาลิส จำกัด

ข้อมูล ณ วันที่ 31 ก.ค. 2569

## กองทุนเปิดทาลิส หุ้นยูเอส เอ็นดีคิว-เฮดจ์

ชนิดเพื่อการออม

TLUSNDQ-H-SSF

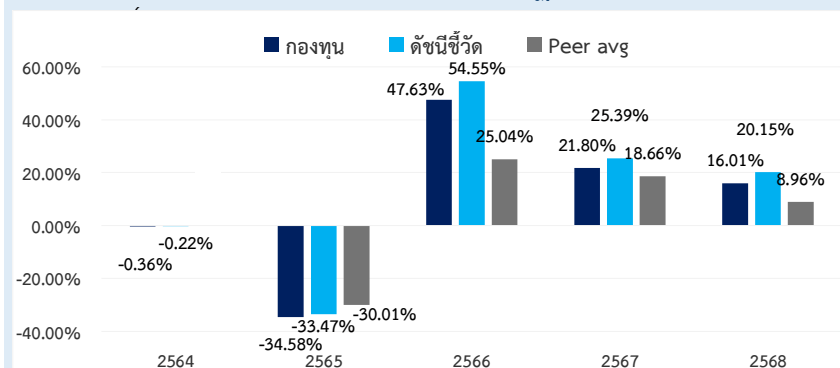
### ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมตราสารทุน / กองทุนรวมฟีดเดอร์ (Feeder Fund) / กองทุนรวมเพื่อการออม (SSF) / กองทุนรวมที่เน้นลงทุนแบบมีความเสี่ยงต่างประเทศ
- กลุ่ม US Equity

### นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- ลงทุนในกองทุน Invesco NASDAQ 100 ETF (กองทุนหลัก) โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV และป้องกันความเสี่ยงด้านอัตราแลกเปลี่ยนไม่น้อยกว่า 90% ของมูลค่าเงินลงทุนต่างประเทศ
- กองทุนหลักเป็นกองทุน ETF ภายใต้การบริหารจัดการของ Invesco Capital Management LLC ลงทุนส่วนใหญ่ในหุ้นของบริษัทขนาดใหญ่ที่มีมูลค่าตลาดสูงที่สุดจำนวน 100 บริษัทที่จดทะเบียนซื้อขายในตลาดหุ้น NASDAQ เพื่อสร้างผลตอบแทนให้ใกล้เคียงกับดัชนี NASDAQ-100
- กองทุนจะไม่ลงทุนใน Structured Note และ derivative เพื่อเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน
- กองทุนไทยมุ่งหวังให้ผลประโยชน์การเคลื่อนไหวตามกองทุนหลัก ส่วนกองทุนหลักมุ่งหวังให้ผลประโยชน์การเคลื่อนไหวตามดัชนีชี้วัด (passive management)

### ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (%ต่อปี)



หมายเหตุ: ปีที่เริ่มต้นกองทุน ผลการดำเนินงานกองทุนและดัชนีชี้วัดจะแสดงตั้งแต่วันที่จดทะเบียนกองทุน/วันเริ่มต้น class จนถึงสิ้นปีปฏิทิน และเนื่องจากมีระยะเวลาไม่ถึง 1 ปี จึงไม่มีค่า Peer avg ในระยะเวลาดังกล่าว

### ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด (%ต่อปี\*)

|                          | YTD   | 3 เดือน | 6 เดือน | 1 ปี*           |
|--------------------------|-------|---------|---------|-----------------|
| กองทุน                   | 9.00  | 2.03    | 8.90    | 17.94           |
| ดัชนีชี้วัด              | 11.08 | 3.05    | 10.64   | 21.81           |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน | 6.43  | 2.68    | 6.89    | 10.98           |
| ความผันผวนกองทุน         | 22.40 | 25.34   | 23.60   | 19.96           |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด    | 22.40 | 25.33   | 23.59   | 19.99           |
|                          | 3 ปี* | 5 ปี*   | 10 ปี*  | ตั้งแต่จัดตั้ง* |
| กองทุน                   | 17.55 | N/A     | N/A     | 8.73            |
| ดัชนีชี้วัด              | 21.48 | N/A     | N/A     | 12.19           |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน | 11.94 | N/A     | N/A     | N/A             |
| ความผันผวนกองทุน         | 21.24 | N/A     | N/A     | 24.02           |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด    | 21.23 | N/A     | N/A     | 24.05           |

### ระดับความเสี่ยง

ต่ำ 1 2 3 4 5 6 7 8 สูง

เสี่ยงสูง

ลงทุนในตราสารทุนเป็นหลักโดยเฉลี่ย  
ในรอบปีไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV

### ข้อมูลกองทุนรวม

|                                           |                               |
|-------------------------------------------|-------------------------------|
| วันจดทะเบียนกองทุน                        | 18 พ.ย. 2564                  |
| วันเริ่มต้น class                         | 18 พ.ย. 2564                  |
| นโยบายการจ่ายเงินปันผล                    | ไม่จ่าย                       |
| อายุกองทุน                                | ไม่กำหนด                      |
| การป้องกันความเสี่ยง FX                   | ป้องกันทั้งหมด (fully hedged) |
| การเรียกเก็บค่าธรรมเนียมตามผลการดำเนินงาน | ไม่มี                         |

### ผู้จัดการกองทุนรวม

นาย วีระพล สิมะโรจน์ (ตั้งแต่ 18 พ.ย. 2564)  
นาย ธนบดี รัตนชูวงศ์ (ตั้งแต่ 21 ก.ย. 2566)

### ดัชนีชี้วัด :

ผลการดำเนินงานของกองทุนหลัก คำนวณจากราคาปิดของกองทุนหลัก ณ สิ้นวัน (Market Price) สัดส่วน 100%  
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           | -36.59%             |
| เวลาทำการ : 8.30 น. - 15.30 น.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |               | เวลาทำการ : 8.30 น. - 15.30 น.     |       | Recovering Period          | 1 ปี 1 เดือน 10 วัน |
| การซื้อขายครั้งแรกขั้นต่ำ : 1,000 บาท                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |               | การขายคืนขั้นต่ำ : ไม่กำหนด        |       | FX Hedging                 | 101.94%             |
| การซื้อขายครั้งถัดไปขั้นต่ำ : 1,000 บาท                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |               | ยอดคงเหลือขั้นต่ำ : ไม่กำหนด       |       | อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน | 0.36 เท่า           |
|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |               | ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน : T+2* |       | Tracking Error             | 0.49%               |
| หมายเหตุ *ภายใน 5 วันทำการนับแต่วันคำนวณ NAV (T+1) หมายความว่า บริษัทจัดการจะชำระเงินค่าขายคืน ภายใน 6 วันทำการนับแต่วันทำการขายคืน (ปัจจุบันคืนเงินค่าขายคืน T+2) T = วันทำการซื้อขายของกองทุน บริษัทจัดการปรับรับคำสั่งซื้อและ/หรือคำสั่งสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้าจากกองทุนรวมอื่น (ยกเว้นการสับเปลี่ยนเข้าจากกองทุนรวมเพื่อการออม) ตั้งแต่วันที่ 1 ม.ค. 2568 เป็นต้นไป                                                                                                                                                                         |               |                                    |       |                            |                     |
| ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV) ค่าธรรมเนียมต่อไปนี้จะส่งผลกระทบต่อ                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |               |                                    |       |                            |                     |
| ต่อผู้ลงทุน เนื่องจากจะทำให้ผลตอบแทนจากการลงทุนลดลง ดังนั้น ผู้ลงทุนควรตรวจสอบทุกครั้งก่อนตัดสินใจลงทุน                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |               |                                    |       |                            |                     |
| ค่าธรรมเนียม                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     | สูงสุดไม่เกิน | เก็บจริง                           |       |                            |                     |
| การจัดการ                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        | 1.6050        | 0.2194                             |       |                            |                     |
| ค่าตอบแทนแก่ตัวแทนขายหน่วยลงทุนของกองทุนรวม (trailer fee) : มี                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |               |                                    |       |                            |                     |
| รวมค่าใช้จ่าย                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    | 2.8890        | 0.3968                             |       |                            |                     |
| หมายเหตุ 1) ค่าธรรมเนียมหรือค่าใช้จ่ายดังกล่าวได้รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะ หรือภาษีอื่นใดแล้ว 2) ค่าใช้จ่ายรวมที่เรียกเก็บจริง เป็นข้อมูลของรอบระยะเวลาบัญชี วันที่ 1 พ.ย. 67 - 31 ต.ค. 68 3) สามารถดูค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวมย้อนหลัง 3 ปี ในหนังสือชี้ชวนข้อมูลกองทุนรวมได้ที่ www.talisam.co.th 4) บริษัทอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ 5) บริษัทจัดการปรับเพิ่มค่าธรรมเนียมนายทะเบียนกองทุน โดยมีผลตั้งแต่วันที่ 1 ก.พ. 69 เป็นต้นไป        |               |                                    |       |                            |                     |
| ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย) ผู้ลงทุนจะถูกเรียกเก็บค่าธรรมเนียม                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |               |                                    |       |                            |                     |
| ต่อไปนี้อยู่ตรงทุกครั้งเมื่อทำการซื้อขายหรือสับเปลี่ยนหน่วยลงทุน                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |               |                                    |       |                            |                     |
| ค่าธรรมเนียม                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     | สูงสุดไม่เกิน | เก็บจริง                           |       |                            |                     |
| การขาย                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           | 1.00          | ยกเว้น                             |       |                            |                     |
| การรับซื้อคืน                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    | 1.00          | ยกเว้น                             |       |                            |                     |
| การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      | 1.00          | ยกเว้น                             |       |                            |                     |
| การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       | 1.00          | ยกเว้น*                            |       |                            |                     |
| การโอนหน่วย                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      | ไม่มี         | ไม่มี                              |       |                            |                     |
| หมายเหตุ (1) ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้สั่งซื้อได้รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะ หรือภาษีอื่นใดแล้ว โดยบริษัทจัดการอาจเรียกเก็บค่าธรรมเนียมจากผู้ลงทุนโดยตรง (2) ค่าธรรมเนียมการขาย/การรับซื้อคืน/การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนอาจเรียกเก็บจากผู้ถือหน่วยลงทุนแต่ละกลุ่มในอัตราที่ไม่เท่ากัน โดยบริษัทจัดการจะแจ้งรายละเอียดและหลักเกณฑ์ให้ทราบต่อไป (3)* ค่าธรรมเนียมการสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนไปกองทุน SSF ภายใต้การจัดการของบลจ.อื่นมีค่าธรรมเนียมสูงสุดไม่เกิน 1.00%/ขั้นต่ำ 200 บาท และเรียกเก็บเป็นเงินสด โดยเรียกเก็บจริง 200 บาทต่อรายการ |               |                                    |       |                            |                     |
| สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |               | ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก      |       |                            |                     |
| breakdown                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        | % NAV         | holding                            | % NAV |                            |                     |
| หน่วยลงทุน                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       | 99.63         | INVESCO NASDAQ 100 ETF             | 99.63 |                            |                     |
| เงินฝากธนาคาร                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    | 3.09          |                                    |       |                            |                     |
| สัญญาซื้อขายล่วงหน้า                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             | -1.20         |                                    |       |                            |                     |
| 5 อันดับแรกข้อมูลกองทุนหลัก                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |               |                                    |       |                            |                     |
| holding                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          | % NAV         |                                    |       |                            |                     |
| NVIDIA CORP                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      | 7.60          |                                    |       |                            |                     |
| APPLE INC                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        | 6.67          |                                    |       |                            |                     |
| ALPHABET INC                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     | 6.29          |                                    |       |                            |                     |
| MICRON TECHNOLOGY INC                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            | 5.64          |                                    |       |                            |                     |
| MICROSOFT CORP                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   | 4.35          |                                    |       |                            |                     |
| หมายเหตุ ข้อมูลกองทุนหลักเป็นข้อมูล ณ วันที่ 30/06/2569                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |               |                                    |       |                            |                     |

## การลงทุนในกองทุนอื่นเกินกว่า 20% (กองในประเทศและกองต่างประเทศ)

ชื่อกอง : Invesco NASDAQ 100 ETF

ISIN code : US46138G6492

Bloomberg code : QQQM

### คำอธิบาย

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

**Recovering Period** ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาตั้งแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลานานเท่าใด

**FX Hedging** เปรี่เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

**อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน** ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลานึง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์กับผลรวมของมูลค่าการขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 1 ปี หาดด้วยมูลค่า NAV ของกองทุนรวมเฉลี่ยในรอบระยะเวลาเดียวกัน กองทุนรวมที่มีค่า portfolio turnover สูง บ่งชี้ถึงการซื้อขายหลักทรัพย์บ่อยครั้งของผู้จัดการกองทุนและทำให้ต้นทุนการซื้อขายหลักทรัพย์ที่สูง 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** 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

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ทาลิส จำกัด

โทรศัพท์: 02 015 0222 [www.talisam.co.th](http://www.talisam.co.th)

เลขที่ 89 ชั้น 10 ห้อง 1001-1002 อาคาร AIA Capital Center ถนนรัชดาภิเษก แขวงดินแดง เขตดินแดง กรุงเทพฯ 10400