กองทุนเปิดทาลิส NASDAQ EQUITY PREMIUM INCOME-HEDGE

TALIS NASDAQ EQUITY PREMIUM INCOME FUND-HEDGE

(TLNDQINCOME-H)

รายงานรอบระยะเวลา 6 เดือน

รอบระยะเวลาตั้งแต่วันที่ 16 มีนาคม 2569 ถึง 31 สิงหาคม 2569

สารบัญ

รายงานรอบระยะเวลา 6 เดือน

ตั้งแต่วันที่ 16 มีนาคม 2569 ถึง 31 สิงหาคม 2569

กองทุนเปิดทาลิส NASDAQ EQUITY PREMIUM INCOME-HEDGE (TLNDQINCOME-H)

นโยบายการลงทุน	1
สาส์นจากบริษัทจัดการ	3
รายงานการวิเคราะห์ของบริษัทจัดการ	4
ผลการดำเนินงานของกองทุนรวม	5
ความเห็นของผู้ดูแลผลประโยชน์	6
งบแสดงฐานะทางการเงิน	7
งบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน	8
งบกำไรขาดทุน	9
รายละเอียดการลงทุน การกู้ยืมเงินและการก่อภาระผูกพัน	10
รายงานสรุปเงินลงทุนในตราสารแห่งหนี้ เงินฝาก หรือตราสารกึ่งหนี้กึ่งทุน	11
คำอธิบายการจัดอันดับความน่าเชื่อถือของสถาบันจัดอันดับความน่าเชื่อถือ	12
แบบแสดงค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม	14
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุนของกองทุน	15
ค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์	16
รายงานชื่อบุคคลที่เกี่ยวข้องที่กองทุนเข้าทำธุรกรรม	17
รายงานการถือหน่วยลงทุนเกินข้อจำกัดการใช้สิทธิออกเสียง	17

กองทุนเปิดทาลิส NASDAQ EQUITY PREMIUM INCOME-HEDGE

TALIS NASDAQ EQUITY PREMIUM INCOME FUND-HEDGE : TLNDQINCOME-H-X

1. กองทุนเป็นกองทุนรวมฟีดเดอร์ (Feeder Fund) ที่เน้นลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุน JPMorgan ETFs (Ireland) ICAV - Nasdaq Equity Premium Income Active UCITS ETF – USD (acc) (กองทุนหลัก) เพียงกองทุนเดียว โดยกองทุนจะลงทุนในกองทุนหลักโดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุนรวม และลงทุนในสกุลเงินดอลลาร์สหรัฐ

กองทุนหลักเป็นกองทุนประเภท Exchange Traded Fund (ETF) ที่บริหารจัดการโดย J.P. Morgan Investment Management Inc. จดทะเบียนจัดตั้งในประเทศไอร์แลนด์ และจดทะเบียนซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ ดังนี้ ตลาดหลักทรัพย์ London Stock Exchange สหราชอาณาจักร, ตลาดหลักทรัพย์ Deutsche Borse ประเทศเยอรมนี, ตลาดหลักทรัพย์ Six Swiss Exchange ประเทศสวิตเซอร์แลนด์ และตลาดหลักทรัพย์ Borsa Italiana ประเทศอิตาลี ซึ่งกองทุนจะลงทุนในตลาดหลักทรัพย์ London Stock Exchange ในสกุลเงินดอลลาร์สหรัฐฯ

กองทุนหลักใช้กลยุทธ์การลงทุนแบบเชิงรุก (Actively-managed Investment Strategy) โดยจะเน้นการลงทุนในตราสารทุนของบริษัทที่มีถิ่นที่ตั้ง หรือดำเนินกิจกรรมทางเศรษฐกิจในประเทศสหรัฐอเมริกาเป็นหลัก และขายสิทธิในการซื้อตราสารทุน (Equity Call Options) และ/หรือสิทธิในการซื้อดัชนีที่อ้างอิงกับตราสารทุน (Equity Index Call Options) เพื่อที่จะสร้างรายได้จากเงินปันผลและค่าพรีเมียม (Premium) จากการขาย Call Options

2. สำหรับการลงทุนส่วนที่เหลือในต่างประเทศ กองทุนอาจพิจารณาลงทุนในหรือมีไว้ซึ่ง ตราสารแห่งหนี้ หรือเงินฝาก หรือหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินอื่นในต่างประเทศที่ไม่ขัดต่อกฎหมาย ก.ล.ต.

สำหรับการลงทุนในประเทศ กองทุนอาจลงทุนในหลักทรัพย์ที่เสนอขายในประเทศ ได้แก่ เงินฝาก ตราสารทางการเงินและลงทุนในหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินอื่นหรือการหาดอกผลโดยวิธีอื่นที่ไม่ขัดต่อกฎหมาย ก.ล.ต. เพื่อการดำเนินการของกองทุน รอจังหวะการลงทุนในต่างประเทศ รักษาสภาพคล่องของกองทุน หรือสำหรับการอื่นใดอันมีลักษณะทำนองเดียวกัน

3. ในสภาวการณ์ปกติกองทุนอาจพิจารณาลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) เพื่อลดความเสี่ยง (Hedging) ด้านอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ โดยกองทุนจะทำสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเพื่อป้องกันความเสี่ยงด้านอัตราแลกเปลี่ยนทั้งหมด (fully hedged) ทั้งนี้ กองทุนยังอาจมีความเสี่ยงด้านอัตราแลกเปลี่ยนในส่วนที่ไม่ได้ทำการป้องกันความเสี่ยงไว้ ซึ่งอาจทำให้ผู้ลงทุนได้รับผลขาดทุนจากอัตราแลกเปลี่ยนหรือได้รับเงินคืนต่ำกว่าเงินลงทุนเริ่มแรกได้ นอกจากนี้ การทำธุรกรรมป้องกันความเสี่ยงด้านอัตราแลกเปลี่ยนดังกล่าวอาจมีต้นทุน ซึ่งทำให้ผลตอบแทนของกองทุนโดยรวมลดลงจากต้นทุนที่เพิ่มขึ้น และทั้งนี้ กองทุนจะไม่ลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเพื่อเพิ่มประสิทธิภาพในการบริหารจัดการลงทุน (Efficient portfolio management)

4. กองทุนจะไม่ลงทุนในตราสารที่มีสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแฝง (Structured Note) รวมถึงหลักทรัพย์ที่ไม่มีการซื้อขายในตลาด (unlisted securities) ตราสารหนี้ที่มีอันดับความน่าเชื่อถือต่ำกว่าที่สามารถลงทุนได้ (non – investment grade) และตราสารหนี้ที่ไม่ได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือ (unrated) อย่างไรก็ตาม กองทุนอาจมีไว้ซึ่งตราสารหนี้ที่มีอันดับความน่าเชื่อถือต่ำกว่าที่สามารถลงทุนได้ เฉพาะกรณีที่ตราสารหนี้นั้นได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือที่มีสามารถลงทุนได้ (investment grade) ขณะที่กองทุนลงทุนเท่านั้น

5. ในกรณีที่บริษัทจัดการเห็นว่า การลงทุนในกองทุนหลักนี้ไม่เหมาะสมอีกต่อไป โดยอาจสืบเนื่องจากการได้รับผลกระทบจากเหตุการณ์ต่าง ๆ หรือมีการเปลี่ยนแปลงเงื่อนไขอื่น ๆ ของกองทุนหลักนี้ เช่น การเปลี่ยนแปลงนโยบายการลงทุน ลักษณะกองทุน อัตราค่าธรรมเนียมการลงทุน หรือมีไว้ซึ่งทรัพย์สินอื่นใดที่ขัดต่อหลักเกณฑ์ที่สำนักงานคณะกรรมการก.ล.ต. กำหนดหรือผลตอบแทน/ผลการดำเนินงานของกองทุนต่างประเทศต่ำกว่าผลตอบแทน/ผลการดำเนินงานของกองทุนอื่น ๆ ที่มีนโยบายการลงทุนใกล้เคียงกัน หรือติดต่อกันเป็นระยะเวลานาน หรือขนาดของกองทุนต่างประเทศลดลง จนอาจมีผลกระทบต่อกองทุน หรือการลงทุนของกองทุนต่างประเทศไม่เป็นไปตามหนังสือชี้ชวน หรือโครงการหรือเมื่อกองทุนต่างประเทศกระทำความผิดตามความเห็นของหน่วยงานที่กำกับดูแลกองทุนต่างประเทศ หรือเมื่อมีการเปลี่ยนแปลงกฎระเบียบหรือสิ่งอื่นใดที่ส่งผลต่อการดำเนินงานของกองทุนในฐานะผู้ลงทุน หรือการเปลี่ยนแปลงอื่นใดที่อาจส่งผลกระทบหรืออาจก่อให้เกิดความเสียหายต่อกองทุน กล่าวคือในกรณีที่เกิดการเปลี่ยนแปลงซึ่งอาจมีผลต่อกองทุนหลัก และ/หรือบริษัทจัดการหรือในกรณีที่มีกองทุนอื่นที่มีนโยบายใกล้เคียงกัน และบริษัทจัดการเห็นว่าการย้ายไปลงทุนในกองทุนดังกล่าวเป็นผลดีต่อผลการดำเนินงานโดยรวมของกองทุน หรือเอื้อประโยชน์ต่อการลงทุนในต่างประเทศของกองทุน และเป็นผลประโยชน์ของผู้ถือหน่วยลงทุน บริษัทจัดการขอสงวนสิทธิที่จะพิจารณาเปลี่ยนแปลงกองทุนรวมต่างประเทศหรือกองทุนหลักเป็นกองทุนต่างประเทศอื่นได้ ตามดุลยพินิจของบริษัทจัดการซึ่งการดำเนินการดังกล่าวจะไม่ขัดกับวัตถุประสงค์และนโยบายการลงทุนของกองทุน หรือขอสงวนสิทธิที่จะยกเลิกกองทุน อีกทั้งบริษัทจัดการขอสงวนสิทธิในการพิจารณาเปลี่ยนแปลงชนิดของหน่วยลงทุน (class) รวมถึงเปลี่ยนแปลงสกุลเงินลงทุนเป็นสกุลเงินอื่นใดนอกเหนือจากสกุลเงินดอลลาร์สหรัฐ หรือเปลี่ยนแปลงการซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์อื่นใดนอกเหนือจากตลาดหลักทรัพย์ London Stock Exchange สหราชอาณาจักร ตามดุลยพินิจของบริษัทจัดการในภายหลังได้ โดยถือว่าได้รับความเห็นชอบจากผู้ถือหน่วยลงทุนแล้ว ซึ่งบริษัทจัดการจะคำนึงถึงผลประโยชน์ของผู้ถือหน่วยลงทุนนี้เป็นสำคัญ ทั้งนี้บริษัทจัดการจะแจ้งการเปลี่ยนแปลงและรายละเอียดที่เกี่ยวข้องให้ผู้ถือหน่วยลงทุนทราบล่วงหน้าก่อนดำเนินการเปลี่ยนแปลงหรือก่อนทำการลงทุนดังกล่าว

วันที่ 30 กันยายน 2569

เรียน ท่านผู้ถือหน่วยลงทุน

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ทาลิส จำกัด (บริษัทฯ) ขอนำส่งรายงานผลการดำเนินงานสำหรับรอบระยะเวลา 6 เดือน (16 มีนาคม 2569 – 31 สิงหาคม 2569) ของกองทุนเปิดทาลิส NASDAQ EQUITY PREMIUM INCOME-HEDGE มายังผู้ถือหน่วยลงทุนทุกท่าน

เศรษฐกิจสหรัฐฯ ยังมีแนวโน้มการเติบโตทางเศรษฐกิจที่ดี โดยมีหุ้นกลุ่มเทคโนโลยีและ AI เป็นแกนหลัก จากเม็ดเงินลงทุนขนาดใหญ่ในโครงสร้างพื้นฐานด้าน AI และผลกำไรที่ออกมาดีกว่าคาด แม้ว่าจะมีแรงกดดันทางเงินเฟ้อและการปรับอัตราดอกเบี้ยนโยบายเพิ่มขึ้นโดย FED ในรอบการประชุมเดือนกันยายนและความเป็นไปได้ที่อาจปรับสูงขึ้นเพิ่มเติมในปี รวมกับสถานการณ์ความไม่แน่นอนจากปัญหาความขัดแย้งระหว่างสหรัฐฯ และอิหร่านที่ยังคงมีความรุนแรงอยู่อย่างต่อเนื่องก็ตาม

กองทุนเปิดทาลิส NASDAQ EQUITY PREMIUM INCOME-HEDGE มีนโยบายการลงทุนเพื่อสร้างผลตอบแทนให้ใกล้เคียงกับผลตอบแทนของหน่วยลงทุนของกองทุน JPMorgan ETFs (Ireland) ICAV - Nasdaq Equity Premium Income Active UCITS ETF – USD (acc) (กองทุนหลัก) โดยกองทุนหลักใช้กลยุทธ์การลงทุนแบบเชิงรุก (Actively-managed Investment Strategy) โดยจะเน้นการลงทุนในตราสารทุนของบริษัทที่มีถิ่นที่ตั้งหรือดำเนินกิจกรรมทางเศรษฐกิจในประเทศสหรัฐอเมริกาเป็นหลัก และขายสิทธิในการซื้อตราสารทุน (Equity Call Options) และ/หรือสิทธิในการซื้อดัชนีที่อ้างอิงกับตราสารทุน (Equity Index Call Options) เพื่อที่จะสร้างรายได้จากเงินปันผลและค่าพรีเมียม (Premium) จากการขาย Call Options ทั้งนี้ กองทุนจะมีการป้องกันความเสี่ยงด้านอัตราแลกเปลี่ยนเต็มที่ตลอดเวลา

ณ วันที่ 28 สิงหาคม 2569 กองทุนเปิดทาลิส NASDAQ EQUITY PREMIUM INCOME-HEDGE มีมูลค่าทรัพย์สินสุทธิ 34,998,820.00 บาท และมูลค่าหน่วยลงทุน 10.8558 บาท โดยมีอัตราผลตอบแทนนับตั้งแต่จัดตั้งกองทุนเพิ่มขึ้น 8.66%

บริษัทฯ ขอขอบพระคุณท่านผู้ถือหน่วยลงทุนทุกท่านที่เชื่อมั่นและให้ความไว้วางใจ บริษัทฯ จะบริหารการลงทุนด้วยความรอบคอบระมัดระวัง ภายใต้กฎระเบียบต่างๆ และจรรยาบรรณวิชาชีพ เพื่อผลประโยชน์สูงสุดของท่านผู้ถือหน่วยลงทุนทุกท่านเป็นสำคัญ

ขอแสดงความนับถือ

คณะผู้จัดการกองทุน

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ทาลิส จำกัด

รายงานการวิเคราะห์ของบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ทาลิส จำกัด ในฐานะบริษัทจัดการ กองทุนเปิดทาลิส NASDAQ EQUITY PREMIUM INCOME-HEDGE

<u>ภาวะตลาดหุ้น</u>

ในช่วงต้นปี 2569 ตลาดหุ้นสหรัฐฯ เผชิญกับผลกระทบที่ไม่คาดคิด เมื่อสงครามระหว่างสหรัฐฯ และอิหร่านปะทุขึ้นในช่วงปลายเดือนกุมภาพันธ์ ส่งผลให้ราคาพลังงานปรับตัวสูงขึ้นอย่างรวดเร็วจากความกังวลต่อการหยุดชะงักของการขนส่งผ่านช่องแคบ Hormuz และฉุดให้ตลาดหุ้นปรับตัวลงอย่างรุนแรงในช่วงต้นเดือนมีนาคม โดยลบล้างผลตอบแทนทั้งหมดตั้งแต่ต้นปีอย่างรวดเร็ว ความกังวลหลักที่ตามมาคือแรงกดดันเงินเฟ้อที่กลับมาจากราคาพลังงาน ซึ่งบังคับให้ FED ต้องระมัดระวังมากขึ้นในการดำเนินนโยบายการเงิน และส่งสัญญาณชะลอแผนการลดอัตราดอกเบี้ยที่ตลาดเคยคาดหวังออกไป อย่างไรก็ตาม ตลาดเริ่มทยอยฟื้นตัวในช่วงปลายไตรมาส เมื่ออิหร่านเริ่มส่งสัญญาณเปิดการเจรจาสงบศึก และนักลงทุนเริ่มกลับมาโฟกัสที่ปัจจัยพื้นฐานของเศรษฐกิจที่ยังคงแข็งแกร่ง โดยผลประกอบการบริษัทจดทะเบียนยังคงเติบโตได้ดี และ Profit Margin ของบริษัทในตลาดแตะระดับสูงสุดเป็นประวัติการณ์ สะท้อนถึงความสามารถในการรักษาความสามารถในการทำกำไรได้แม้ในสภาวะที่ต้นทุนพลังงานสูงขึ้น

ในไตรมาสที่ 2 ปี 2569 ตลาดหุ้นสหรัฐฯ ทยอยฟื้นตัวได้อย่างต่อเนื่องและสามารถทำจุดสูงสุดเป็นประวัติการณ์ครั้งใหม่ได้ในช่วงกลางเดือนเมษายน หลังสัญญาณการเจรจาสงบศึกระหว่างสหรัฐฯ และอิหร่านคืบหน้าขึ้น ส่งผลให้ราคาพลังงานผ่อนคลายลงจากจุดสูงสุด และลดแรงกดดันเงินเฟ้อที่เคยเป็นปัจจัยกดดันตลาดมาตลอดช่วงต้นปี ขณะที่ผลประกอบการบริษัทจดทะเบียนในไตรมาส 1 ที่ออกมาแข็งแกร่งกว่าที่ตลาดคาดการณ์ไว้ โดยเฉพาะกลุ่มเทคโนโลยีที่ยังคงรักษา Profit Margin ในระดับสูงและเดินหน้าลงทุนในโครงสร้างพื้นฐาน AI อย่างต่อเนื่อง จนถึงเหตุการณ์ประกาศเปิดช่องแคบ Hormuz ในช่วงกลางเดือนมิถุนายน ที่ยิ่งช่วยหนุน Sentiment ของนักลงทุนให้ปรับตัวดีขึ้น อย่างไรก็ตาม ความท้าทายยังคงมีอยู่จากความผันผวนของหุ้นใหญ่ในช่วงปลายไตรมาส และเงินเฟ้อที่ยังทรงตัวในระดับสูงกว่าเป้าหมายของ FED รวมกับตัวเลขแรงงานที่ดีขึ้น ทำให้ธนาคารกลางสหรัฐฯ เริ่มส่งสัญญาณในการเพิ่มอัตราดอกเบี้ยนโยบาย ซึ่งยังเป็นปัจจัยที่อาจสร้างความผันผวนให้กับตลาดได้ในระยะข้างหน้า

ในช่วงต้นไตรมาสที่ 3 ปี 2569 ตลาดหุ้นสหรัฐฯ เข้าสู่ภาวะผันผวนอีกครั้งในช่วงเดือนกรกฎาคม เนื่องจาก FED ส่งสัญญาณที่ชัดเจนขึ้นเกี่ยวกับความเป็นไปได้ในการขึ้นอัตราดอกเบี้ย จนถึงการประชุมในเดือนกันยายน ที่ FED มีมติเอกฉันท์ปรับขึ้นอัตราดอกเบี้ยนโยบาย 0.25% สู่ระดับ 3.75–4.00% ซึ่งถือเป็นการขึ้นดอกเบี้ยครั้งแรกในรอบ 3 ปี หลังตัวเลขเงินเฟ้อที่ประกาศออกมายังคงสูงกว่าเป้าหมายระยะยาวที่ 2% อย่างต่อเนื่อง ประกอบกับตลาดแรงงานที่ยังคงแข็งแกร่งเกินคาด และยังคงส่งสัญญาณถึงการปรับขึ้นเพิ่มเติมภายในปีนี้

ตลาดหุ้นสหรัฐฯ ยังมีแนวโน้มเติบโตได้ดี ด้วยเศรษฐกิจสหรัฐฯ ยังมีเสถียรภาพ แม้จะมีความผันผวนเข้ามาบ้าง แต่แนวโน้มเศรษฐกิจโดยรวมและอัตราการทำกำไรของบริษัทในตลาดหลักทรัพย์ที่ยังเติบโตได้ดีน่าจะช่วยผลักดันให้ตลาดหุ้นสหรัฐฯ เติบโตได้อย่างต่อเนื่อง ในระยะยาว บลจ.ทาลิส ยังเชื่อว่าตลาดหุ้นสหรัฐฯ ยังมีโอกาสเติบโตได้ดี เนื่องจากบริษัทขนาดใหญ่ในดัชนีเป็นบริษัทที่มีคุณภาพดี รวมทั้งมีฐานการตลาดที่ใหญ่และครอบคลุมอยู่ทั่วโลก

ผลการดำเนินงานของกองทุนเปิดทาลิส NASDAQ EQUITY PREMIUM INCOME-HEDGE

ตารางแสดงผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด

ผลการดำเนินงานย้อนหลัง[1]								
กองทุน	% ตามช่วงเวลา			% ต่อปี				
	Year to date	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี	3 ปี	5 ปี	10 ปี	ตั้งแต่จัดตั้ง (16 มี.ค. 69)
TLNDQINCOME-H	8.66	1.29	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	8.66
Benchmark[2]	10.72	2.15	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	10.72
ความผันผวนของผลการดำเนินงาน	17.27	18.41	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	17.27
ความผันผวนของ Benchmark[2]	17.31	18.36	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	17.31

หมายเหตุ: [1]เป็นข้อมูล ณ วันที่ 28 สิงหาคม 2569 คุณสามารถดูข้อมูลที่เป็นปัจจุบันได้ที่ www.talisam.co.th

[2]ผลการดำเนินงานของกองทุนรวมหลัก ปรับด้วยต้นทุนการป้องกันความเสี่ยงอัตราแลกเปลี่ยนเพื่อคำนวณผลตอบแทนเป็นสกุลเงินบาท ณ วันที่คำนวณผลตอบแทน สัดส่วน 95.00% และปรับด้วยอัตราแลกเปลี่ยนเพื่อคำนวณผลตอบแทนเป็นสกุลเงินบาท ณ วันที่คำนวณผลตอบแทน สัดส่วน 5.00%

ผลการดำเนินงานแบบย้อนหลังตามปีปฏิทิน

ยังไม่มีข้อมูล

ผลการดำเนินงานในอดีต / ผลการเปรียบเทียบผลการดำเนินงานที่เกี่ยวข้องกับผลิตภัณฑ์ในตลาดทุน มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

เอกสารการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวมฉบับนี้ได้จัดทำขึ้นตามมาตรฐานการวัดและนำเสนอผลการดำเนินงานของกองทุนรวมของสมาคมบริษัทจัดการลงทุน

A member of MUFG
a global financial group

รายงานความเห็นผู้ดูแลผลประโยชน์

เสนอ ผู้ถือหน่วยลงทุน
กองทุนเปิดทาลิส NASDAQ EQUITY PREMIUM INCOME-HEDGE

ตามที่ ธนาคารกรุงศรีอยุธยา จำกัด (มหาชน) ("ธนาคารฯ") ในฐานะผู้ดูแลผลประโยชน์ กองทุนเปิดทาลิส NASDAQ EQUITY PREMIUM INCOME-HEDGE ("กองทุน") ซึ่งมีบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนทาลิส จำกัด เป็นผู้จัดตั้งและจัดการกองทุน ได้ปฏิบัติหน้าที่ดูแลผลประโยชน์ของกองทุนดังกล่าวสำหรับรอบระยะเวลาหกเดือนของกองทุน ตั้งแต่วันที่ 16 มีนาคม 2569 ถึงวันที่ 31 สิงหาคม 2569

ธนาคารฯ เห็นว่าบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนทาลิส จำกัด ได้ปฏิบัติหน้าที่ในการจัดการโดยถูกต้องตามที่ควรตามวัตถุประสงค์ที่ได้กำหนดไว้ในโครงการจัดการที่ได้รับอนุมัติจากสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์และภายใต้พระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535

ผู้ดูแลผลประโยชน์
ธนาคารกรุงศรีอยุธยา จำกัด (มหาชน)

(นางสาวดารารัตน์ ตั้งอุดมเลิศ)
ผู้อำนวยการ
ฝ่ายพัฒนาผลิตภัณฑ์และควบคุมดูแลผลประโยชน์

กลุ่มควบคุมดูแลผลประโยชน์
วันที่ 2 กันยายน 2569

Bank of Ayudhya Public Company Limited
1222 Rama III Road, Bang Phongphang
Yan Nawa, Bangkok 10120 Thailand
Reg. No. 0107536001079
T +66 (0) 2296 2000
www.krungsri.com

ธนาคารกรุงศรีอยุธยา จำกัด (มหาชน)
1222 ถนนพระรามที่ 3 แขวงบางโพงพาง
เขตยานนาวา กรุงเทพมหานคร 10120
ทะเบียนเลขที่ 0107536001079
โทรศัพท์ +66 (0) 2296 2000
www.krungsri.com

งบแสดงฐานะการเงิน*

ณ วันที่ 31 สิงหาคม 2569

	บาท
สินทรัพย์	
เงินลงทุนแสดงด้วยมูลค่ายุติธรรม (ราคาทุน 31,789,145.60 บาท)	35,016,673.76
เงินฝากธนาคาร	543,122.40
ลูกหนี้	
จากเงินปันผลและดอกเบี้ย	276.49
ค่าใช้จ่ายรอการตัดบัญชี	38,734.00
รวมสินทรัพย์	35,598,806.65
หนี้สิน	
เจ้าหนี้	
จากการรับซื้อคืนหน่วยลงทุน	500,934.98
จากสัญญาอนุพันธ์	51,247.40
ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย	
ค่าธรรมเนียมการจัดการค้างจ่าย	24,157.23
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ค้างจ่าย	979.36
ค่าธรรมเนียมทะเบียนค้างจ่าย	4,896.77
ค่าธรรมเนียมวิชาชีพค้างจ่าย	13,520.00
ค่าใช้จ่ายค้างจ่ายอื่น	816.09
ภาษีเงินได้ค้างจ่าย	41.47
หนี้สินอื่น	876.25
รวมหนี้สิน	597,469.55
สินทรัพย์สุทธิ	35,001,337.10
สินทรัพย์สุทธิ:	
ทุนที่ได้รับจากผู้ถือหน่วยลงทุน	32,246,818.16
กำไร(ขาดทุน)สะสม	
บัญชีปรับสมดุล	142,203.87
กำไร (ขาดทุน) สะสมจากการดำเนินงาน	2,612,315.07
สินทรัพย์สุทธิ	35,001,337.10
สินทรัพย์สุทธิต่อหน่วย	10.8542
จำนวนหน่วยลงทุนที่จำหน่ายแล้วทั้งหมด (หน่วย)	3,224,681.8439

หมายเหตุ : * งบการเงินนี้ยังไม่ได้ผ่านการสอบทานหรือรับรองจากผู้สอบบัญชี

งบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน*

ณ วันที่ 31 สิงหาคม 2569

การแสดงรายละเอียดเงินลงทุนใช้การจัดกลุ่มตามประเภทของเงินลงทุนและตามประเภทของอุตสาหกรรม

ชื่อหลักทรัพย์	จำนวนหน่วย	มูลค่ายุติธรรม (บาท)	ร้อยละของมูลค่าเงินลงทุน
หน่วยลงทุนในต่างประเทศ			
JPM NQ EQ PREM ACT UCITS ETF	31,805	35,016,673.76	100.00
รวมหน่วยลงทุนในต่างประเทศ		**35,016,673.76**	**100.00**
รวมเงินลงทุน (ราคาทุน 31,789,145.60 บาท)		**35,016,673.76**	**100.00**

หมายเหตุ : * งบการเงินนี้ยังไม่ได้ผ่านการสอบทานหรือรับรองจากผู้สอบบัญชี

งบกำไรขาดทุน*

สำหรับระยะเวลา 6 เดือน ตั้งแต่วันที่ 16 มีนาคม 2569 (วันจดทะเบียนจัดตั้งกองทุน) ถึงวันที่ 31 สิงหาคม 2569

	บาท
รายได้	
รายได้ดอกเบี้ย	890.33
รวมรายได้	890.33
ค่าใช้จ่าย	
ค่าธรรมเนียมการจัดการ	112,228.75
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์	4,549.78
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน	22,749.12
ค่าธรรมเนียมในการจัดตั้งกองทุน	36,166.00
ค่าธรรมเนียมวิชาชีพ	13,520.00
ค่านายหน้า	72,910.18
ค่าใช้จ่ายอื่น	3,791.44
รวมค่าใช้จ่าย	265,915.27
รายได้สุทธิ	(265,024.94)
รายการกำไร (ขาดทุน) สุทธิจากเงินลงทุน	
รายการกำไร (ขาดทุน) สุทธิที่เกิดขึ้นจากเงินลงทุน	768,674.47
รายการกำไร (ขาดทุน) สุทธิที่ยังไม่เกิดขึ้นจากเงินลงทุน	3,227,528.16
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิที่เกิดขึ้นจากสัญญาอนุพันธ์	(950,875.10)
รายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิที่ยังไม่เกิดขึ้นจากสัญญาอนุพันธ์	(51,247.40)
รายการกำไร (ขาดทุน) สุทธิจากอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ	(116,606.57)
รวมรายการกำไร (ขาดทุน) สุทธิจากเงินลงทุนที่เกิดขึ้นและที่ยังไม่เกิดขึ้น	2,877,473.56
การเพิ่มขึ้น (ลดลง) ในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงาน	2,612,448.62
หัก ภาษีเงินได้	(133.55)
การเพิ่มขึ้น (ลดลง) ในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงานหลังหักภาษีเงินได้	2,612,315.07

หมายเหตุ : * งบการเงินนี้ยังไม่ได้ผ่านการสอบทานหรือรับรองจากผู้สอบบัญชี

รายละเอียดการลงทุน การกู้ยืมเงินและการก่อภาระผูกพัน

ข้อมูล ณ วันที่ 31 สิงหาคม 2569

รายละเอียดการลงทุน	อันดับความน่าเชื่อถือของ		มูลค่ายุติธรรม	% NAV
	ตราสาร	ผู้ออก/ค้ำประกัน		
หลักทรัพย์หรือทรัพย์สินในประเทศ			**492,151.49**	**1.41**
เงินฝากธนาคาร				
ธนาคาร				
ธนาคารกรุงศรีอยุธยา จำกัด (มหาชน)	AAA(tha)		543,398.89	1.55
สัญญาซื้อขายล่วงหน้า				
ธนาคารกรุงศรีอยุธยา จำกัด (มหาชน)				
FX-TX.644359			504.00	0.00
ธนาคารกสิกรไทย จำกัด (มหาชน)				
FX-TX.643827			14,084.00	0.04
FX-TX.650811			(39,515.40)	(0.11)
บริษัท เอสซีบี เอกซ์ จำกัด (มหาชน)				
FX-TX.648494			(26,320.00)	(0.08)
หลักทรัพย์หรือทรัพย์สินต่างประเทศ			**35,016,673.76**	**100.04**
หน่วยลงทุน				
JPM NQ EQ PREM ACT UCITS ETF			35,016,673.76	100.04
สินทรัพย์อื่นหรือหนี้สินอื่น			**(507,488.15)**	**(1.45)**
มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ			**35,001,337.10**	**100.00**

รายงานสรุปเงินลงทุนในตราสารแห่งหนี้ เงินฝาก หรือตราสารกึ่งหนี้กึ่งทุน

ข้อมูล ณ วันที่ 31 สิงหาคม 2569

กลุ่มของตราสาร	มูลค่าตามราคาตลาด	%NAV
(ก) ตราสารภาครัฐ ได้แก่ ตั๋วแลกเงิน พันธบัตรรัฐบาล พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย พันธบัตร หรือ ตราสารแห่งหนี้ที่กองทุนเพื่อการฟื้นฟูและพัฒนา	-	-
(ข) ตราสารที่ธนาคารที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้น ธนาคารพาณิชย์ หรือบริษัทเงินทุนเป็นผู้ออก ผู้รับรอง ผู้รับอาวัล ผู้สลักหลัง หรือผู้ค้ำประกัน	543,398.89	1.55
(ค) ตราสารที่มีบริษัทที่ได้รับ rating ในระดับ investment grade เป็นผู้ออก ผู้รับรอง ผู้รับอาวัล ผู้สลักหลัง หรือผู้ค้ำประกัน	-	-
(ง) ตราสารที่มีอันดับความน่าเชื่อถืออยู่ในอันดับต่ำกว่าอันดับที่สามารถลงทุนได้ (investment grade) หรือตราสารที่ไม่ได้จัดอันดับความน่าเชื่อถือ	-	-

รายละเอียดตัวตราสารและอันดับความน่าเชื่อถือของตราสารแห่งหนี้ เงินฝาก หรือตราสารกึ่งหนี้กึ่งทุนที่กองทุนลงทุนหรือมีไว้เป็นรายตัว

ประเภท	ผู้ออก	วันครบกำหนด	อันดับความน่าเชื่อถือ		มูลค่าที่ตราไว้	มูลค่ายุติธรรม
			ตราสาร	ผู้ออก/ค้ำประกัน		
เงินฝากธนาคาร	ธนาคารกรุงศรีอยุธยา จำกัด (มหาชน)			AAA(tha)	-	543,398.89

สัดส่วนเงินลงทุนขั้นสูงต่อมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุนที่บริษัทจัดการตั้งไว้ในแผนการลงทุนสำหรับกลุ่มตราสารตาม (ง) เท่ากับ 15% NAV

คำอธิบายการจัดอันดับความน่าเชื่อถือของสถาบันจัดอันดับความน่าเชื่อถือ

บริษัท ฟิทช์ เรทติ้งส์ (ประเทศไทย) จำกัด

อันดับความน่าเชื่อถือระยะยาวสำหรับประเทศไทย

AAA(tha) แสดงถึงอันดับเครดิตขั้นสูงสุดของอันดับเครดิตภายในประเทศสำหรับประเทศไทย โดยอันดับเครดิตนี้จะให้กับผู้ออกตราสารหนี้หรือตัวตราสารหนี้ ที่คาดว่าจะมีความเสี่ยงของการผิดนัดชำระหนี้ต่ำที่สุดเมื่อเปรียบเทียบกับผู้ออกตราสารหนี้หรือตัวตราสารหนี้อื่นๆ ในประเทศไทย

AA(tha) อันดับเครดิตภายในประเทศ 'AA(tha)' จะให้กับผู้ออกตราสารหนี้หรือตัวตราสารหนี้ ที่คาดว่าจะมีความเสี่ยงของการผิดนัดชำระหนี้ที่ต่ำมากเมื่อเปรียบเทียบกับผู้ออกตราสารหนี้หรือตัวตราสารหนี้อื่นๆ ในประเทศไทย โดยความเสี่ยงของการผิดนัดชำระหนี้สำหรับอันดับเครดิตภายในประเทศที่ระดับ 'AA(tha)' จะแตกต่างจากความเสี่ยงของการผิดนัดชำระหนี้ของผู้ออกตราสารหนี้หรือตัวตราสารหนี้ที่ได้รับอันดับเครดิตภายในประเทศในลำดับสูงสุดเพียงเล็กน้อย

A(tha) อันดับเครดิตภายในประเทศ 'A(tha)' จะให้กับผู้ออกตราสารหนี้หรือตัวตราสารหนี้ ที่คาดว่าจะมีความเสี่ยงของการผิดนัดชำระหนี้ที่ต่ำเมื่อเปรียบเทียบกับผู้ออกตราสารหนี้หรือตัวตราสารหนี้อื่นๆ ในประเทศไทย อย่างไรก็ตาม การเปลี่ยนแปลงของสถานการณ์หรือสภาพทางเศรษฐกิจ อาจมีผลกระทบต่อความสามารถในการชำระหนี้ได้ตรงตามกำหนดของตราสารทางการเงินเหล่านี้ มากกว่าตราสารอื่นที่ได้รับการจัดอันดับเครดิตที่สูงกว่า

BBB(tha) อันดับเครดิตภายในประเทศ 'BBB(tha)' จะให้กับผู้ออกตราสารหนี้หรือตัวตราสารหนี้ ที่คาดว่าจะมีความเสี่ยงของการผิดนัดชำระหนี้ปานกลางเมื่อเปรียบเทียบกับผู้ออกตราสารหนี้หรือตัวตราสารหนี้อื่นๆ ในประเทศไทย อย่างไรก็ตาม การเปลี่ยนแปลงของสถานการณ์หรือสภาพทางเศรษฐกิจ จะมีผลกระทบต่อความสามารถในการชำระหนี้ได้ตรงตามกำหนดเวลาของตราสารทางการเงินเหล่านี้ มากกว่าตราสารหนี้อื่นที่ได้รับการจัดอันดับเครดิตที่สูงกว่า

อันดับความน่าเชื่อถือระยะสั้นสำหรับประเทศไทย

F1(tha) แสดงถึงระดับความสามารถสูงสุดในการชำระหนี้ได้ตรงตามกำหนดเวลาที่ระบุไว้ในข้อผูกพันทางการเงิน เมื่อเปรียบเทียบกับผู้ออกตราสารหนี้หรือตัวตราสารหนี้อื่นๆ ในประเทศไทย ภายใต้ระบบการจัดอันดับเครดิตภายในประเทศซึ่งกำหนดโดยฟิทช์ อันดับเครดิตในระดับนี้จะให้กับผู้ออกตราสารหนี้หรือตัวตราสารหนี้ ที่มีความเสี่ยงของการผิดนัดชำระหนี้ต่ำที่สุดเมื่อเปรียบเทียบกับผู้ออกตราสารหนี้หรือตัวตราสารหนี้อื่นๆ ในประเทศไทย ในกรณีที่สภาพคล่องอยู่ในระดับที่แข็งแกร่งเป็นพิเศษจะมีสัญลักษณ์ "+" แสดงไว้เพิ่มเติมจากอันดับเครดิตที่ให้ไว้

F2(tha) แสดงถึงระดับความสามารถในการชำระหนี้ได้ตรงตามกำหนดเวลาที่ระบุไว้ในข้อผูกพันทางการเงินในระดับที่ดี เมื่อเปรียบเทียบกับผู้ออกตราสารหนี้หรือตัวตราสารหนี้อื่นๆ ในประเทศไทย อย่างไรก็ตาม ระดับของความน่าเชื่อถือดังกล่าวยังไม่อาจเทียบเท่ากับกรณีที่ได้รับการจัดอันดับเครดิตที่สูงกว่า

F3(tha) แสดงถึงระดับความสามารถในการชำระหนี้ได้ตรงตามกำหนดเวลาที่ระบุไว้ในข้อผูกพันทางการเงินในระดับปานกลาง เมื่อเปรียบเทียบกับผู้ออกตราสารหนี้หรือตัวตราสารหนี้อื่นๆ ในประเทศไทย อย่างไรก็ตาม ความสามารถในการชำระหนี้ดังกล่าวมีความอ่อนไหวที่สูงกว่าต่อการเปลี่ยนแปลงในทางลบในระยะสั้น เมื่อเทียบกับอันดับเครดิตที่สูงกว่า

<u>หมายเหตุประกอบการจัดอันดับเครดิตภายในประเทศ:</u>

คำเสริมท้าย 'tha' จะถูกระบุไว้ต่อจากอันดับเครดิตเพื่อบอกถึงอันดับเครดิตภายในประเทศสำหรับประเทศไทย เครื่องหมาย "+" หรือ "-" อาจจะถูกระบุไว้เพิ่มเติมต่อจากอันดับเครดิตภายในประเทศ เพื่อแสดงถึงสถานะเปรียบเทียบภายในอันดับเครดิตขั้นหลัก ทั้งนี้ เครื่องหมาย "+" หรือ "-" ดังกล่าวจะไม่ใช้สำหรับอันดับเครดิตภายในประเทศระยะยาว และอันดับความ

แข็งแกร่งทางการเงินภายในประเทศของบริษัทประกันภัย 'AAA(tha)' หรืออันดับที่ต่ำกว่า 'CCC(tha)' และจะไม่ใช้สำหรับอันดับเครดิตภายในประเทศระยะสั้นยกเว้นระดับ 'F1(tha)'

บริษัท ทริสเรทติ้ง จำกัด

อันดับความน่าเชื่อถือระยะยาวสำหรับประเทศไทย

AAA อันดับเครดิตองค์กรหรือตราสารหนี้มีความเสี่ยงต่ำที่สุด ผู้ออกตราสารหนี้มีความสามารถในการชำระดอกเบี้ยและคืนเงินต้นในเกณฑ์สูงสุด และได้รับผลกระทบน้อยมากจากการเปลี่ยนแปลงทางธุรกิจ เศรษฐกิจ และสิ่งแวดล้อมอื่นๆ

AA องค์กรหรือตราสารหนี้มีความเสี่ยงต่ำมาก ผู้ออกตราสารหนี้มีความสามารถในการชำระดอกเบี้ยและคืนเงินต้นในเกณฑ์สูงมาก แต่อาจได้รับผลกระทบจากการเปลี่ยนแปลงทางธุรกิจ เศรษฐกิจ และสิ่งแวดล้อมอื่นๆ มากกว่าอันดับเครดิตที่อยู่ในระดับ AAA

A องค์กรหรือตราสารหนี้มีความเสี่ยงในระดับต่ำ ผู้ออกตราสารหนี้มีความสามารถในการชำระดอกเบี้ยและคืนเงินต้นในเกณฑ์สูง แต่อาจได้รับผลกระทบจากการเปลี่ยนแปลงทางธุรกิจ เศรษฐกิจ และสิ่งแวดล้อมอื่นๆ มากกว่าอันดับเครดิตที่อยู่ในระดับสูงกว่า

BBB องค์กรหรือตราสารหนี้มีความเสี่ยงในระดับปานกลาง ผู้ออกตราสารหนี้มีความสามารถในการชำระดอกเบี้ยและคืนเงินต้นในเกณฑ์ที่เพียงพอ แต่มีความอ่อนไหวต่อการเปลี่ยนแปลงทางธุรกิจ เศรษฐกิจ และสิ่งแวดล้อมอื่นๆ มากกว่า และอาจมีความสามารถในการชำระหนี้อ่อนแอลงเมื่อเทียบกับอันดับเครดิตที่อยู่ในระดับสูงกว่า

อันดับเครดิตจาก AA ถึง C อาจมีเครื่องหมายบวก (+) หรือลบ (-) ต่อท้ายเพื่อจำแนกความแตกต่างของคุณภาพของอันดับเครดิตภายในระดับเดียวกัน

อันดับความน่าเชื่อถือระยะสั้นสำหรับประเทศไทย

T1 ผู้ออกตราสารหนี้มีสถานะทั้งทางด้านการตลาดและการเงินที่แข็งแกร่งในระดับดีมาก มีสภาพคล่องที่ดีมาก และนักลงทุนจะได้รับความคุ้มครองจากการผิดนัดชำระหนี้ที่ดีกว่าอันดับเครดิตในระดับอื่น ผู้ออกตราสารที่ได้รับอันดับเครดิตในระดับดังกล่าวซึ่งมีเครื่องหมาย “+” ด้วยจะได้รับความคุ้มครองด้านการผิดนัดชำระหนี้ที่สูงยิ่งขึ้น

T2 ผู้ออกตราสารหนี้มีสถานะทั้งทางด้านการตลาดและการเงินที่แข็งแกร่งในระดับดี และมีความสามารถในการชำระหนี้ระยะสั้นในระดับที่น่าพอใจ

T3 ผู้ออกตราสารหนี้มีความสามารถในการชำระหนี้ระยะสั้นในระดับที่ยอมรับได้

T4 ผู้ออกตราสารหนี้มีความสามารถในการชำระหนี้ระยะสั้นที่ค่อนข้างอ่อนแอ

การจัดอันดับเงินฝากธนาคารระยะสั้นของธนาคารพาณิชย์ โดย Moody’s

Moody’s ใช้สัญลักษณ์แสดงความสามารถในการชำระคืนเงินฝากของธนาคารพาณิชย์ ดังนี้

P-1 ธนาคารพาณิชย์ที่ได้รับการจัดอันดับเครดิตที่ P-1 สำหรับเงินฝากนั้น มีสถานะคุณภาพด้านเครดิตที่ดีมาก ตลอดจนมีความสามารถที่แข็งแกร่งมากในการชำระภาระเงินฝากระยะสั้นในระยะเวลาที่เหมาะสม

P-2 ธนาคารพาณิชย์ที่ได้รับการจัดอันดับเครดิตที่ P-2 สำหรับเงินฝากนั้น มีสถานะคุณภาพด้านเครดิตที่ดี และมีความสามารถที่แข็งแกร่งในการชำระภาระเงินฝากระยะสั้นในเวลาที่เหมาะสม

P-3 ธนาคารพาณิชย์ที่ได้รับการจัดอันดับเครดิตที่ P-3 สำหรับเงินฝากนั้นจะมีสถานะคุณภาพด้านเครดิตในระดับที่ยอมรับได้ และมีความสามารถที่เพียงพอต่อการชำระภาระเงินฝากระยะสั้นภายในเวลาที่เหมาะสม

NP ธนาคารพาณิชย์ที่ได้รับการจัดอันดับ “Not Prime” สำหรับเงินฝากนั้น มีคุณภาพเครดิตต่ำหรือน่ากังวลและมีความไม่แน่นอนในความสามารถในการชำระภาระเงินฝากระยะสั้นภายในเวลาที่เหมาะสม

แบบแสดงค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม

สำหรับระยะเวลา 6 เดือน ตั้งแต่วันที่ 16 มีนาคม 2026 (วันจดทะเบียนจัดตั้งกองทุน) ถึง 31 สิงหาคม 2569

ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม * **(Fund's Direct Expenses)**	**จำนวนเงิน หน่วย : พันบาท**	**ร้อยละของ มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ**
ค่าธรรมเนียมการจัดการ (Management Fee)	112.23	0.37
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ (Trustee Fee)	4.55	0.01
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียนหน่วย (Registrar Fee)	22.75	0.07
ค่าใช้จ่ายอื่นๆ (Other Expenses)	53.48	0.17
รวมค่าใช้จ่ายทั้งหมด (Total Fund's Direct Expenses)**	**193.01**	**0.62**

* ค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายที่หักจากกองทุนรวมได้รวมภาษีมูลค่าเพิ่มแล้ว

** ไม่รวมค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์และค่าธรรมเนียมต่างๆ ที่เกิดขึ้นจากการซื้อขายหลักทรัพย์และภาษีเงินได้จากการลงทุนในตราสารหนี้

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุนของกองทุน (Portfolio Turnover Ratio : “PTR”)

สำหรับระยะเวลา 6 เดือน ตั้งแต่วันที่ 16 มีนาคม 2026 (วันจดทะเบียนจัดตั้งกองทุน) ถึง 31 สิงหาคม 2569

$$PTR = \frac{\text{MIN(มูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อทรัพย์สินกับผลรวมของมูลค่าการขายทรัพย์สิน)}}{\text{AVG.NAV(มูลค่าทรัพย์สินสุทธิเฉลี่ยของกองทุนรวมในรอบระยะเวลาบัญชีเดียวกัน)}}$$

$$PTR = \frac{14,754,459.84}{30,577,527.63}$$

$$PTR = 0.48$$

หมายเหตุ : ข้อมูล PTR เป็นข้อมูลเพิ่มเติมจาก trading costs ที่จะทำให้ผู้ลงทุนทราบถึงมูลค่าการซื้อขายทรัพย์สินและสะท้อนกลยุทธ์การลงทุนของกองทุน ดังนั้น ทรัพย์สินที่นำมาคำนวณรวมใน PTR จึงควรเป็นทรัพย์สินประเภทที่สามารถมีการซื้อขายเปลี่ยนมือเพื่อการลงทุน เช่น ตราสารทุน ตราสารหนี้ เป็นต้น ยกเว้นทรัพย์สินประเภทเงินฝาก OTC derivatives หรือ derivatives เพื่อการลงทุน ซึ่งโดยลักษณะแล้วไม่ได้มีการซื้อขายเปลี่ยนมือ

ค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์

สำหรับระยะเวลา 6 เดือน ตั้งแต่วันที่ 16 มีนาคม 2569 (วันจดทะเบียนจัดตั้งกองทุน) ถึง 31 สิงหาคม 2569

ลำดับ	ชื่อบริษัทนายหน้า	ค่านายหน้า(บาท)	อัตราส่วนค่านายหน้าแต่ละรายต่อค่านายหน้าทั้งหมด
1	บริษัทหลักทรัพย์ ซีจีเอส อินเตอร์เนชั่นแนล (ประเทศไทย) จำกัด	36,517.72	50.09%
2	บริษัทหลักทรัพย์ ยูโอบี เคย์เฮียน (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)	35,339.59	48.47%
3	บริษัทหลักทรัพย์ เมย์แบงก์ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)	1,052.87	1.44%
รวม		**72,910.18**	**100.00%**

รายงานชื่อบุคคลที่เกี่ยวข้องที่กองทุนเข้าทำธุรกรรม

กองทุนเปิดทาลิส NASDAQ EQUITY PREMIUM INCOME-HEDGE ไม่มีรายการทำธุรกรรมกับบุคคลที่เกี่ยวข้อง ข้อมูลระหว่างวันที่ 16 มีนาคม 2569 (วันจดทะเบียนจัดตั้งกองทุน) ถึง 31 สิงหาคม 2569

รายงานการถือหน่วยลงทุนเกินข้อจำกัดการใช้สิทธิออกเสียง

กองทุนเปิดทาลิส NASDAQ EQUITY PREMIUM INCOME-HEDGE ไม่มีการถือหน่วยลงทุนเกิน 1 ใน 3 โดยบุคคลใดบุคคลหนึ่ง ข้อมูล ณ วันที่ 31 สิงหาคม 2569

ผู้ผู้ลงทุนสามารถตรวจสอบรายละเอียดการทำธุรกรรมกับบุคคลที่เกี่ยวข้องกับกองทุนรวมและรายงานการถือหน่วยลงทุนเกินข้อจำกัดการใช้สิทธิออกเสียงได้ที่บริษัทจัดการโดยตรง หรือที่ website ของบริษัทจัดการที่ http://www.talisam.co.th และสำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ต. http://www.sec.or.th



สอบถามรายละเอียดเพิ่มเติมและขอรับหนังสือชี้ชวนได้ที่

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ทาลิส จำกัด

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

โทรศัพท์ 0 2015 0222 www.talisam.co.th