



กองทุนเปิดทาลิส ตลาดเงิน

TALIS MONEY MARKET FUND (TLMMF)

รายงานรอบระยะเวลา 6 เดือน

รอบระยะเวลาตั้งแต่วันที่ 1 ธันวาคม 2563 ถึง 31 พฤษภาคม 2564

รายงานรอบระยะเวลา 6 เดือน

ตั้งแต่วันที่ 1 ธันวาคม 2563 ถึง 31 พฤษภาคม 2564

กองทุนเปิดทาลิส ตลาดเงิน (TLMMF)

นโยบายการลงทุน	1
สารสนเทศจากบริษัทจัดการ	2
รายงานการวิเคราะห์ของบริษัทจัดการ	3
ผลการดำเนินงานของกองทุนรวม	5
ความเห็นของผู้ดูแลผลประโยชน์	6
งบแสดงฐานะทางการเงิน	7
งบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน	8
งบกำไรขาดทุน	9
รายละเอียดการลงทุน การกู้ยืมเงินและการก่อภาระผูกพัน	10
รายงานสรุปเงินลงทุนในตราสารแห่งนี้ เงินฝาก หรือตราสารกึ่งหนี้กึ่งทุน	11
คำอธิบายการจัดอันดับความน่าเชื่อถือของสถาบันจัดอันดับความน่าเชื่อถือ	12
แบบแสดงค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม	14
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุนกองทุนรวม	15
รายงานชื่อบุคคลที่เกี่ยวข้องที่กองทุนเข้าทำธุรกรรม	16
รายงานการถือหน่วยลงทุนเกินข้อจำกัดการใช้สิทธิออกเสียง	16

กองทุนเปิดทาลิส ตลาดเงิน (TLMMF)

TALIS MONEY MARKET FUND : TLMMF

กองทุนมีนโยบายลงทุนในตราสารหนี้ภาครัฐหรือภาคเอกชน เงินฝากหรือตราสารเทียบเท่าเงินฝาก หน่วยลงทุน ของกองทุนรวมตลาดเงิน หรือตราสารการเงินอื่นใดที่เสนอขายในประเทศ ตามที่สำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ต. กำหนด หรือให้ความเห็นชอบให้ลงทุนได้

กองทุนอาจลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้าโดยมีวัตถุประสงค์เฉพาะเพื่อลดความเสี่ยง (Hedging) และกองทุน อาจทำธุรกรรมการให้ยืมหลักทรัพย์โดยหลักทรัพย์ที่ให้ยืมเป็นตราสารหนี้ หรือธุรกรรมการซื้อโดยมีสัญญาขาย คืน (Reverse Repo) โดยเป็นไปตามหลักเกณฑ์ที่สำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ต. กำหนด

กองทุนเปิดทาลิส ตลาดเงิน จะลงทุนในทรัพย์สินหรือถือครองทรัพย์สินที่มีสภาพคล่องสูง ในขณะใด ๆ รวมกัน ไม่น้อยกว่าร้อยละ 10 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน และกองทุนจะดำรงอายุถัวเฉลี่ยแบบถ่วงน้ำหนัก ของตราสารทั้งหมดของกองทุน (portfolio duration) ณ ขณะใดขณะหนึ่งไม่เกิน 92 วัน รวมถึงตราสารหนี้ที่ กองทุนได้ลงทุนไว้จะต้องมีกำหนดวันชำระหนี้ไม่เกินกว่า 397 วันนับแต่วันที่กองทุนได้ลงทุน และตราสารหนี้ ดังกล่าวต้องไม่เป็นหุ้นกู้ด้อยสิทธิ หรือตราสารหนี้อื่นที่มีลักษณะด้อยสิทธิในทำนองเดียวกับหุ้นกู้ด้อยสิทธิ นอกจากนี้ ตราสารหนี้ที่ไม่รวมตราสารภาครัฐไทย หรือเงินฝากหรือตราสารเทียบเท่าเงินฝากที่ไม่รวมกรณีที่ผู้ออกหรือคู่สัญญาเป็นธนาคารออมสิน หรือธุรกรรมการซื้อโดยมีสัญญาขายคืน (reverse repo) หรือธุรกรรม การให้ยืมหลักทรัพย์ หรือ สัญญาซื้อขายล่วงหน้า ที่กองทุนเข้าลงทุน จะต้อง มี credit rating อย่างใดอย่างหนึ่ง แล้วแต่กรณี ดังนี้

- (1) อยู่ใน 2 อันดับแรกที่ได้มาจากการจัด credit rating ระยะสั้น
- (2) อยู่ใน 3 อันดับแรกที่ได้มาจากการจัด credit rating ระยะยาว
- (3) เทียบเคียงได้กับ 2 อันดับแรกของการจัด credit rating ระยะสั้นตามที่สถาบันจัดอันดับความน่าเชื่อถือได้เปรียบเทียบไว้

อนึ่ง กองทุนจะไม่ลงทุนในตราสารที่มีลักษณะของสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแฝง (Structured Note) และตราสาร หนี้ภาคเอกชนที่มีอันดับความน่าเชื่อถือต่ำกว่าที่สามารถลงทุนได้ และตราสารหนี้ที่ไม่ได้รับการจัดอันดับความ น่าเชื่อถือ (Unrated Securities)

กองทุนมีนโยบายลงทุนในตราสารทุน หุ้นสามัญของบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย และ/หรือ ตลาดหลักทรัพย์ เอ็ม เอ ไอ โดยเป็นไปในลักษณะที่ส่งผลให้กองทุนมี net exposure ในตราสารทุน โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน

ในส่วนที่เหลือ กองทุนอาจลงทุนในตราสารแห่งนี้ ตราสารกึ่งหนี้กึ่งทุน เงินฝาก หน่วยลงทุนของกองทุน เช่น หน่วยลงทุนของกองทุนรวม กองทุนรวมอสังหาริมทรัพย์ หน่วยทรัสต์เพื่อการลงทุนในอสังหาริมทรัพย์ (REITs) กองทุนรวมโครงสร้างพื้นฐาน และ/หรือกองทุนรวมอีทีเอฟ (ETF) เป็นต้น รวมถึงกองทุนอาจทำธุรกรรมการ ให้ยืมหลักทรัพย์ หรือธุรกรรมการซื้อโดยมีสัญญาขายคืน (Reverse Repo) หรือธุรกรรมการขายโดยมีสัญญาซื้อ คืน และกองทุนอาจลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้าโดยมีวัตถุประสงค์เฉพาะเพื่อลดความเสี่ยง (Hedging) รวมทั้งอาจลงทุนในหลักทรัพย์ หรือทรัพย์สินอื่น หรือการหาผลตอบแทนโดยวิธีอื่นอย่างใดอย่างหนึ่ง หรือหลายอย่าง ได้ตามที่สำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ต. กำหนดหรือให้ความเห็นชอบนอกจากนี้ กองทุนอาจลงทุนในตราสาร หนี้ที่มีอันดับความน่าเชื่อถือต่ำกว่าที่สามารถลงทุนได้ และตราสารหนี้ที่ไม่ได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือ (Unrated Securities) และตราสารทุนของบริษัทที่ไม่ได้จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ (Unlisted Securities) โดยเป็นไปตามหลักเกณฑ์ที่สำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ต. กำหนด

ทั้งนี้ กองทุนจะไม่ลงทุนในตราสารที่มีลักษณะของสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแฝง (Structured Note)

วันที่ 25 มิถุนายน 2564

เรียน ท่านผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุน

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ทาลิส จำกัด (บริษัทฯ) ขอนำส่งรายงานผลการดำเนินงานสำหรับรอบระยะเวลา 6 เดือน (1 ธันวาคม 2563 – 31 พฤษภาคม 2564) ของกองทุนเปิดทาลิส ตลาดเงิน มายังผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุนทุกท่าน

เศรษฐกิจไทยในไตรมาสแรกของปี 2564 ลดลง 2.6% ปรับตัวดีขึ้นจากการลดลง 4.2% ในไตรมาสที่สี่ของปี 2563 โดยมีปัจจัยสนับสนุนสำคัญจากการกลับมาขยายตัวของการส่งออกสินค้าและการลงทุนภาคเอกชน รวมทั้งการขยายตัวต่อเนื่องของการใช้จ่ายรัฐบาลและการขยายตัวเร่งขึ้นของการลงทุนภาครัฐ ในขณะที่การระบาดของ COVID-19 ส่งผลให้การบริโภคภาคเอกชนปรับตัวลดลงและการส่งออกบริการลดลงมากอย่างต่อเนื่อง ทางด้านนโยบายการเงินของไทยในครั้งแรกของปี 2564 มีมติคงอัตราดอกเบี้ยนโยบายไว้ที่ 0.50% ต่อปี เพื่อสนับสนุนการฟื้นตัวของเศรษฐกิจที่ยังมีความไม่แน่นอนสูงอันเนื่องมาจากการระบาดของไวรัสระลอกใหม่ และรักษาขีดความสามารถในการดำเนินนโยบายการเงินที่มีจำกัดเพื่อใช้ในช่วงเวลาที่เหมาะสมและเกิดประสิทธิผลสูงสุด โดยเห็นว่าการดำเนินมาตรการกระตุ้นเศรษฐกิจของภาครัฐและการส่งออก ที่ฟื้นตัวดีขึ้นตามการขยายตัวทางเศรษฐกิจของประเทศคู่ค้าจะช่วยสนับสนุนการฟื้นตัวของเศรษฐกิจไทย

กองทุนเปิดทาลิส ตลาดเงิน เน้นลงทุนในตราสารหนี้ระยะสั้น อัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในแต่ละวันมีความสม่ำเสมอ มีความผันผวนต่ำ ณ วันที่ 31 พฤษภาคม 2564 มีมูลค่าทรัพย์สินสุทธิ 267,961,810.05 บาท มูลค่าหน่วยลงทุน 10.4587 บาท อัตราผลตอบแทนในรอบ 6 เดือน 0.2054% ต่อปี และอัตราผลตอบแทนนับตั้งแต่จัดตั้งกองทุน 1.0237% ต่อปี

บริษัทฯ ขอขอบพระคุณท่านผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุนทุกท่านที่เชื่อมั่นและให้ความไว้วางใจ บริษัทฯ จะบริหารการลงทุนด้วยความรอบคอบและระมัดระวัง ภายใต้กฎระเบียบต่าง ๆ และจรรยาบรรณวิชาชีพ เพื่อผลประโยชน์สูงสุดของท่านผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุนทุกท่านเป็นสำคัญ

ขอแสดงความนับถือ

คณะผู้จัดการกองทุน

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ทาลิส จำกัด

รายงานการวิเคราะห์ของบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ทาลิส จำกัด ในฐานะบริษัทจัดการ กองทุนเปิดทาลิส ตลาดเงิน

ภาวะเศรษฐกิจ

เศรษฐกิจไทยในไตรมาสแรกของปี 2564 ลดลง 2.6% ดีขึ้นเมื่อเทียบกับการลดลง 4.2% ในไตรมาสก่อนหน้า (%YoY) และเมื่อปรับผลของฤดูกาลออกแล้ว เศรษฐกิจไทยในไตรมาสแรกของปี 2564 ขยายตัวจากไตรมาสที่สี่ของปีก่อนหน้า 0.2% (QoQ_SA) ด้านการใช้จ่าย มีแรงสนับสนุนสำคัญจากการกลับมาขยายตัวของการส่งออกสินค้า และการลงทุนภาคเอกชน รวมทั้งการขยายตัวต่อเนื่องของการใช้จ่ายรัฐบาลและการขยายตัวเร่งขึ้นของการลงทุนภาครัฐ ในขณะที่การบริโภคภาคเอกชนปรับตัวลดลงและการส่งออกบริการลดลงต่อเนื่อง ด้านการผลิต สาขาการผลิตสินค้าอุตสาหกรรมและสาขาการก่อสร้างกลับมาขยายตัว ในขณะที่สาขาเกษตรกรรม สาขาข้อมูลข่าวสารและการสื่อสาร และสาขาการเงินขยายตัวต่อเนื่อง ส่วนการผลิตสาขาที่พักแรมและบริการด้านอาหาร สาขาการขนส่งและสถานที่เก็บสินค้า สาขาไฟฟ้าและก๊าซ และสาขาการขายส่งการขายปลีกและการซ่อมแซมฯ ลดลงต่อเนื่อง

สำนักงานสภาพัฒนาการเศรษฐกิจและสังคมแห่งชาติ คาดว่าแนวโน้มเศรษฐกิจไทยปี 2564 จะขยายตัว 1.5 – 2.5% โดยฟื้นตัวได้อย่างช้า ๆ จากการลดลง 6.1% ในปี 2563 โดยมีปัจจัยสนับสนุนจาก (1) แนวโน้มการฟื้นตัวของเศรษฐกิจและปริมาณการค้าโลก (2) แรงขับเคลื่อนจากการใช้จ่ายภาครัฐ และ (3) การปรับตัวตามฐานการขยายตัวที่ต่ำผิดปกติในปี 2563 ทั้งนี้ คาดว่ามูลค่าการส่งออกสินค้าในรูปดอลลาร์ สรอ.จะขยายตัว 10.3% ขณะที่การอุปโภคบริโภคและการลงทุนภาคเอกชนจะขยายตัว 1.6% และ 4.3% ตามลำดับ ส่วนการลงทุนภาครัฐคาดว่าจะขยายตัว 9.3% อัตราเงินเฟ้อทั่วไปเฉลี่ยอยู่ในช่วง 1.0 – 2.0% และดุลบัญชีเดินสะพัดเกินดุล 0.7% ของ GDP

ภาวะตลาดการเงินและตราสารหนี้

ในรอบระยะเวลา 6 เดือนที่ผ่านมา ธนาคารกลางของประเทศเศรษฐกิจหลักไม่มีการเปลี่ยนแปลงการดำเนินนโยบายการเงิน กล่าวคือยังคงนโยบายการเงินแบบผ่อนคลายเป็นพิเศษ และพร้อมที่จะใช้นโยบายการเงินทุกรูปแบบควบคู่ไปกับนโยบายการคลังเพื่อสนับสนุนเศรษฐกิจท่ามกลางความเสี่ยงสำคัญที่มาจากผลกระทบของ COVID-19 ที่กระทบต่อกิจกรรมทางเศรษฐกิจ การจ้างงาน และเงินเฟ้อ โดยการประชุมครั้งล่าสุดของธนาคารกลางสหรัฐ (FED) เดือนเมษายน 2564 ได้มีมติเป็นเอกฉันท์คงอัตราดอกเบี้ยนโยบาย Federal Funds Rate ไว้ที่ระดับ 0.00-0.25% และคงวงเงินซื้อสินทรัพย์ที่ 1.2 แสนล้านดอลลาร์ต่อเดือนตามเดิม แม้ว่าเศรษฐกิจมีสัญญาณดีขึ้นชัดเจน แต่การจ้างงานยังไม่กลับสู่ภาวะปกติ อัตราการมีส่วนร่วมในกำลังแรงงานยังต่ำที่ 61.5% เทียบกับช่วงก่อนหน้าวิกฤติที่ 63.3% โดยเฉพาะภาคบริการที่ได้รับผลกระทบโดยตรงจาก COVID-19 แรงงานบางส่วนไม่สามารถกลับเข้าตลาดได้ อีกทั้งชาวอเมริกันที่ได้รับวัคซีนครบ 2 โดสปัจจุบันมีเพียง 28% ของประชากร จึงยังไม่เพียงพอต่อการเกิดภูมิคุ้มกันหมู่

ทำให้คาดการณ์ว่า FED จะรอจนกว่าความเสี่ยงที่ COVID-19 จะกลับมาระบาดอีกครั้งหมดไปก่อน จึงจะพิจารณาลดการผ่อนคลายนโยบายการเงิน

ทางด้านการประชุมคณะกรรมการนโยบายการเงินของไทยในเดือนพฤษภาคม 2564 มีมติเป็นเอกฉันท์ให้คงดอกเบี้ยไว้ที่ 0.50% เพื่อสนับสนุนเศรษฐกิจและรักษาขีดความสามารถของนโยบายการเงินที่มีจำกัด คณะกรรมการประเมินว่า เศรษฐกิจมีแนวโน้มฟื้นตัวได้ช้าลงและฟื้นตัวอย่างไม่เท่าเทียมกัน เนื่องจากการระบาดของไวรัสโควิดที่ 3 กระทบการใช้จ่ายในประเทศและแนวโน้มการฟื้นตัวของภาคการท่องเที่ยว ขณะที่การส่งออกสินค้าขยายตัวดีตามการฟื้นตัวของเศรษฐกิจของประเทศคู่ค้า ด้านเสถียรภาพระบบการเงิน ฐานะการเงินของครัวเรือนประปรายมากขึ้น ธพท. จึงออกมาตรการช่วยเหลือลูกหนี้เพิ่มเติม ด้วยการลดภาระหนี้และเพิ่มรายได้เพื่อเสริมสภาพคล่องในระยะสั้น อีกทั้งผลักดันการแก้ปัญหาหนี้ครัวเรือนในระยะยาว ด้านนโยบายการเงิน คณะกรรมการให้น้ำหนักกับการสนับสนุนการฟื้นตัวของเศรษฐกิจเป็นหลัก โดยติดตามการระบาดของไวรัสโควิดที่ 3 ประสิทธิภาพและการกระจายวัคซีน การเปิดประเทศรับนักท่องเที่ยว ความเปราะบางของตลาดแรงงาน และความเพียงพอของนโยบายการคลังการเงิน

ด้านความเคลื่อนไหวของตลาดตราสารหนี้ไทยในรอบ 6 เดือน เส้นอัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลในช่วงปลายปี 2563 ปรับลดลงมามาก แม้ว่านักลงทุนต่างชาติจะเริ่มกลับมาขายสุทธิในเดือนธันวาคม โดยอัตราผลตอบแทนของพันธบัตรรัฐบาลระยะสั้นทั้งในตลาดแรกและตลาดรองปรับลดลงอย่างต่อเนื่อง สาเหตุหลักมาจากการคาดการณ์ของนักลงทุนในตลาดว่าคณะกรรมการนโยบายการเงินมีโอกาสปรับลดดอกเบี้ยนโยบายลงอีกครั้ง เนื่องจากการระบาดของ COVID-19 ที่กลับมารุนแรงขึ้นในไทยและในอีกหลายประเทศ ทำให้การฟื้นตัวของเศรษฐกิจโลกมีความไม่แน่นอน

ในช่วงเดือนกุมภาพันธ์ - มีนาคม 2564 เส้นอัตราผลตอบแทนของไทยกลับปรับขึ้นขึ้นในรูปแบบ Bear-Steepening โดยในรอบบัญชี 6 เดือนนี้ อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลช่วงอายุต่ำกว่า 3 ปีปรับลดลง 6-18 Bps จากมุมมองของนักลงทุนสถาบันว่า อัตราดอกเบี้ยนโยบายจะอยู่ในระดับต่ำ แนวโน้มธนาคารกลางหลายประเทศยังคงรักษานโยบายการเงินแบบผ่อนคลายเป็นไปอีกระยะเวลาหนึ่ง และความต้องการลดความเสี่ยงของการถือครองพันธบัตรอายุยาว ในขณะที่พันธบัตรรัฐบาลระยะยาวโดยเฉพาะรุ่นอายุ 10 ปีขึ้นไป อัตราผลตอบแทนกลับปรับขึ้น 40-68 Bps ตามทิศทางของอัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลของสหรัฐฯ และความกังวลปริมาณพันธบัตรระยะยาวที่จะเสนอขายเนื่องจากความเสี่ยงที่รัฐบาลจะมีภาระใช้จ่ายมากกว่าที่คาด ทางด้านปริมาณการซื้อขายพันธบัตรรัฐบาลของนักลงทุนต่างชาติ ณ สิ้นปี 2563 มีการถือครองพันธบัตรรัฐบาลรวม 8.57 แสนล้านบาท ลดลงจากปีก่อนหน้าประมาณ 6 หมื่นล้านบาท อย่างไรก็ตาม ยอดการถือครอง ณ สิ้นเดือนพฤษภาคม 2564 ได้มีปริมาณเพิ่มขึ้นเป็น 8.83 แสนล้านบาท

ผลการดำเนินงานของกองทุนเปิดทาลิส ตลาดเงิน

ตารางแสดงผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด

ผลการดำเนินงานย้อนหลัง ¹								
กองทุน	% ตามช่วงเวลา			% ต่อปี				
	Year to date	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี	3 ปี	5 ปี	10 ปี	ตั้งแต่จัดตั้ง (9 ธ.ค. 59)
TLMMF	0.08	0.05	0.10	0.31	0.93	N/A	N/A	1.01
Benchmark ²	0.20	0.16	0.27	0.60	1.17	N/A	N/A	1.22
ความผันผวนของผลการดำเนินงาน	0.01	0.01	0.01	0.02	0.05	N/A	N/A	0.05
ความผันผวนของ Benchmark ²	0.03	0.03	0.04	0.04	0.08	N/A	N/A	0.07

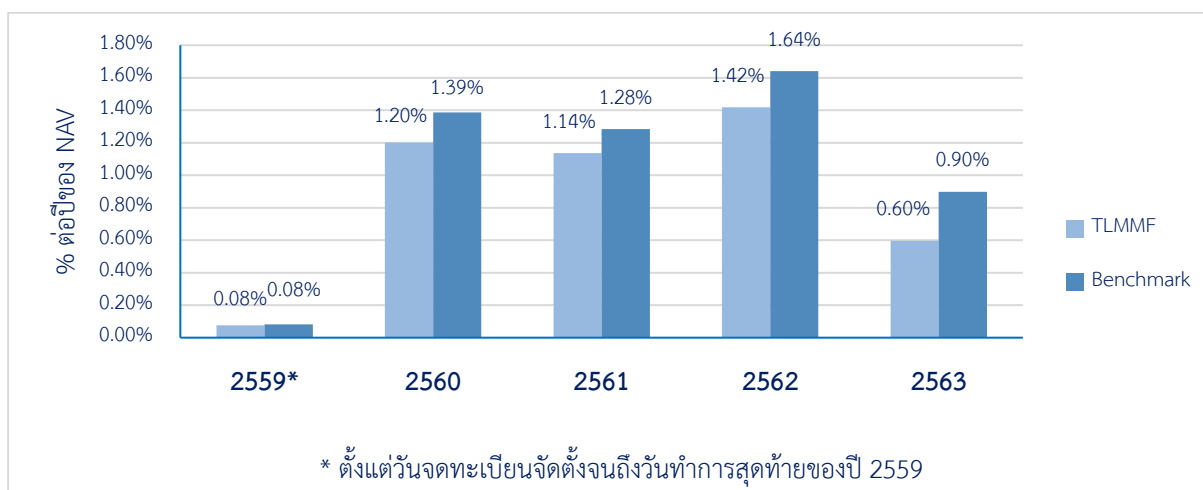
หมายเหตุ: ¹ เป็นข้อมูล ณ วันที่ 31 พฤษภาคม 2564 คุณสามารถดูข้อมูลที่เป็นปัจจุบันได้ที่ www.talisam.co.th

² 1) ดัชนีตราสารหนี้ภาครัฐระยะสั้น (Short-term Government Bond Index) ร้อยละ 55

2) ดัชนีตราสารหนี้ภาคเอกชนระยะสั้น (Commercial Paper Index) ที่มีอันดับความน่าเชื่อถือของผู้ออกตราสารอยู่ในระดับ A- ขึ้นไป ร้อยละ 20

3) อัตราดอกเบี้ยเงินฝากประจำ 3 เดือน วงเงินน้อยกว่า 5 ล้านบาท เฉลี่ยของ 3 ธนาคารพาณิชย์ขนาดใหญ่ ได้แก่ ธนาคารกรุงเทพ ธนาคารกสิกรไทย และธนาคารไทยพาณิชย์ หลังหักภาษี ร้อยละ 25

ผลการดำเนินงานแบบย้อนหลังตามปีปฏิทิน



ผลการดำเนินงานในอดีต / ผลการเปรียบเทียบผลการดำเนินงานที่เกี่ยวข้องกับผลิตภัณฑ์ในตลาดทุน มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมตลาดเงินไม่ใช่การฝากเงิน และมีความเสี่ยงจากการลงทุนซึ่งผู้ลงทุนอาจไม่ได้รับเงินลงทุนคืนเต็มจำนวน

เอกสารการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวมฉบับนี้ได้จัดทำขึ้นตามมาตรฐานการวัดและนำเสนอผลการดำเนินงานของกองทุนรวมของสมาคมบริษัทจัดการลงทุน

*คุณสามารถดูข้อมูลที่เป็นปัจจุบันได้ที่ www.talisam.co.th



ความเห็นของผู้ดูแลผลประโยชน์

วันที่ 18 มิถุนายน 2564

เรียน ผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุนกองทุนเปิดทาลิส ตลาดเงิน

ธนาคารกรุงเทพ จำกัด (มหาชน) ในฐานะผู้ดูแลผลประโยชน์ ได้ดูแลการจัดการกองทุนเปิดทาลิส ตลาดเงิน ซึ่งจัดการโดยบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ทาลิส จำกัด สำหรับระยะเวลาตั้งแต่วันที่ 1 ธันวาคม 2563 ถึงวันที่ 31 พฤษภาคม 2564 แล้ว

ธนาคารฯ เห็นว่าบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ทาลิส จำกัด ได้ปฏิบัติหน้าที่ในการจัดการกองทุนเปิดทาลิส ตลาดเงิน เหมาะสมตามสมควรแห่งวัตถุประสงค์ที่ได้กำหนดไว้ในโครงการ และภายใต้พระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535

(นาถฤดี สีโทชวลิต)

ธนาคารกรุงเทพ จำกัด (มหาชน)

ในฐานะผู้ดูแลผลประโยชน์

งบแสดงฐานะทางการเงิน*
ณ วันที่ 31 พฤษภาคม 2564

	บาท
สินทรัพย์	
เงินลงทุนตามมูลค่ายุติธรรม	266,104,567.87
(ราคาทุน วันที่ 31 พฤษภาคม 2564 เท่ากับ 266,104,463.87 บาท)	
เงินสดและเงินฝากธนาคาร	1,809,143.39
ลูกหนี้จากการลงทุน	
จากเงินปันผลและดอกเบี้ย	98,699.43
รวมสินทรัพย์	268,012,410.69
หนี้สิน	
ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย	
ค่าธรรมเนียมการจัดการค้างจ่าย	20,425.21
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ค้างจ่าย	8,033.95
ค่าธรรมเนียมทะเบียนค้างจ่าย	19,063.51
ภาษีเงินได้ค้างจ่าย	1,729.93
หนี้สินอื่น	1,348.04
รวมหนี้สิน	50,600.64
สินทรัพย์สุทธิ	267,961,810.05
สินทรัพย์สุทธิ:	
ทุนที่ได้รับจากผู้ถือหุ้นลงทุน	256,207,287.09
กำไร (ขาดทุน) สะสม	
บัญชีปรับสมดุล	(7,692,124.09)
กำไร (ขาดทุน) สะสมจากการดำเนินงาน	19,446,647.05
สินทรัพย์สุทธิ	267,961,810.05
มูลค่าสินทรัพย์สุทธิต่อหน่วย	10.4587
จำนวนหน่วยลงทุนที่จำหน่ายแล้วทั้งหมด ณ วันสิ้นงวด (หน่วย)	25,620,728.7105

หมายเหตุ : * งบการเงินนี้ยังไม่ได้ผ่านการสอบทานหรือรับรองจากผู้สอบบัญชี

งบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน*

ณ วันที่ 31 พฤษภาคม 2564

การแสดงรายละเอียดเงินลงทุนใช้การจัดกลุ่มตามประเภทของเงินลงทุน

ชื่อหลักทรัพย์	วันครบอายุ	อัตราดอกเบี้ย (%)	เงินต้น (บาท)	มูลค่ายุติธรรม (บาท)	ร้อยละของมูลค่าเงินลงทุน
พันธบัตร					
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย					
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 6/365/63	4 มิถุนายน 2564	-	20,000,000	19,999,457.60	7.66
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 10/91/64	10 มิถุนายน 2564	-	7,000,000	6,999,568.52	2.68
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 12/91/64	24 มิถุนายน 2564	-	22,200,000	22,196,214.01	8.50
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 13/91/64	1 กรกฎาคม 2564	-	10,000,000	9,997,493.80	3.83
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 14/91/64	8 กรกฎาคม 2564	-	24,000,000	23,993,311.44	9.19
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 15/90/64	15 กรกฎาคม 2564	-	21,500,000	21,492,227.54	8.23
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 17/91/64	29 กรกฎาคม 2564	-	25,000,000	24,987,691.00	9.57
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 18/91/64	5 สิงหาคม 2564	-	26,400,000	26,384,025.10	10.10
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 19/92/64	13 สิงหาคม 2564	-	600,000	599,592.28	0.23
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 20/91/64	19 สิงหาคม 2564	-	25,000,000	24,979,887.50	9.57
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 21/91/64	26 สิงหาคม 2564	-	14,000,000	13,987,805.72	5.36
รวมพันธบัตร			195,700,000	195,617,274.51	74.92
ตั๋วเงินคลัง					
ตั๋วเงินคลัง งวดที่ (DM)5/182/64	44398.00005	-	29,000,000	28,987,293.36	11.10
รวมตั๋วเงินคลัง			29,000,000	28,987,293.36	11.10
เงินฝากประจำ					
ใบรับเงินฝากประจำ 12 เดือนของธนาคารอาคารสงเคราะห์	26 พฤศจิกายน 2564	0.80	15,500,000	15,500,000.00	5.82
ใบรับเงินฝากประจำ 12 เดือนของธนาคารอาคารสงเคราะห์	7 มกราคม 2565	0.43	10,000,000	10,000,000.00	3.76
ใบรับเงินฝากประจำ 12 เดือนของธนาคารอาคารสงเคราะห์	8 กุมภาพันธ์ 2565	0.70	2,000,000	2,000,000.00	0.75
ใบรับเงินฝากประจำ 12 เดือนของธนาคารอาคารสงเคราะห์	22 เมษายน 2565	0.70	9,000,000	9,000,000.00	3.38
ใบรับเงินฝากประจำ 12 เดือนของธนาคารอาคารสงเคราะห์	22 เมษายน 2565	0.70	5,000,000	5,000,000.00	1.88
รวมเงินฝากประจำ			41,500,000	41,500,000.00	15.60
รวมเงินลงทุน (ราคาทุน 266,104,463.87 บาท)				266,104,567.87	100.00

หมายเหตุ : * งบการเงินนี้ยังไม่ได้ผ่านการสอบทานหรือรับรองจากผู้สอบบัญชี

งบกำไรขาดทุนเบ็ดเสร็จ*
สำหรับระยะเวลา 6 เดือน ตั้งแต่วันที่ 1 ธันวาคม 2563 ถึง 31 พฤษภาคม 2564

	บาท
รายได้จากการลงทุน	
รายได้ดอกเบี้ย	151,695.52
รายได้อื่น	410,825.62
รวมรายได้	562,521.14
ค่าใช้จ่าย	
ค่าธรรมเนียมการจัดการ	115,895.23
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์	45,585.48
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน	108,168.84
ค่าใช้จ่ายอื่น	200.00
รวมค่าใช้จ่าย	269,849.55
รายได้ (ขาดทุน) สุทธิ	292,671.59
 รายการกำไร (ขาดทุน) สุทธิจากเงินลงทุน	
รายการกำไร (ขาดทุน) สุทธิที่เกิดขึ้นจากเงินลงทุน	(1,172.76)
รายการกำไร (ขาดทุน) สุทธิที่ยังไม่เกิดขึ้นทั้งสิ้น	(104.34)
รวมรายการกำไร (ขาดทุน) สุทธิจากเงินลงทุนที่เกิดขึ้นและที่ยังไม่เกิดขึ้น	(1,277.10)
 การเพิ่มขึ้น (ลดลง) ในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงานก่อนภาษีเงินได้	291,394.49
หัก ภาษีเงินได้	1,822.38
การเพิ่มขึ้น (ลดลง) ในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงานหลังหักภาษีเงินได้	289,572.11

หมายเหตุ : * งบการเงินนี้ยังไม่ได้ผ่านการสอบทานหรือรับรองจากผู้สอบบัญชี

รายละเอียดการลงทุน การกู้ยืมเงินและการก่อภาระผูกพัน
ข้อมูล ณ วันที่ 31 พฤษภาคม 2564

รายละเอียดการลงทุน	อันดับความน่าเชื่อถือ		มูลค่ายุติธรรม	%NAV
	ของตราสาร	ผู้ออก/ค้ำประกัน		
หลักทรัพย์หรือทรัพย์สินในประเทศ			268,012,410.69	100.02
เงินฝากธนาคาร				
ธนาคาร				
เงินฝากธนาคารกรุงเทพ จำกัด (มหาชน)		AA+(tha)	1,812,506.37	0.68
ตราสารหนี้				
เงินฝากธนาคาร				
ธนาคาร				
ใบรับเงินฝากประจำ 12 เดือนของธนาคารอาคารสงเคราะห์		AAA(thai)	14,010,739.73	5.23
ใบรับเงินฝากประจำ 12 เดือนของธนาคารอาคารสงเคราะห์		AAA(thai)	15,563,495.35	5.81
ใบรับเงินฝากประจำ 12 เดือนของธนาคารอาคารสงเคราะห์		AAA(thai)	10,016,767.12	3.74
ใบรับเงินฝากประจำ 12 เดือนของธนาคารอาคารสงเคราะห์		AAA(thai)	2,004,334.25	0.75
ตั๋วสัญญาใช้เงิน				
รัฐบาล				
ตั๋วเงินคลัง งวดที่ (DM)5/182/64			28,987,293.36	10.82
พันธบัตร				
รัฐบาล				
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 10/91/64			6,999,568.52	2.61
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 12/91/64			22,196,214.01	8.28
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 13/91/64			9,997,493.80	3.73
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 14/91/64			23,993,311.44	8.95
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 15/90/64			21,492,227.54	8.02
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 17/91/64			24,987,691.00	9.33
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 18/91/64			26,384,025.10	9.85
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 19/92/64			599,592.28	0.22
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 20/91/64			24,979,887.50	9.32
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 21/91/64			13,987,805.72	5.22
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 6/365/63			19,999,457.60	7.46
สินทรัพย์อื่นหรือหนี้สินอื่น			(50,600.64)	(0.02)
มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ			267,961,810.05	100.00

รายงานสรุปเงินลงทุนในตราสารแห่งนี้ เงินฝาก หรือตราสารกึ่งหนี้กึ่งทุน

ข้อมูล ณ วันที่ 31 พฤษภาคม 2564

กลุ่มของตราสาร	มูลค่าตามราคาตลาด	%NAV
(ก) ตราสารภาครัฐ ได้แก่ ตัวแลกเงิน พันธบัตรรัฐบาล พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย พันธบัตร หรือ ตราสารแห่งหนึ่งที่กองทุนเพื่อการฟื้นฟูและพัฒนา	224,604,567.87	83.82
(ข) ตราสารที่ธนาคารที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้น ธนาคารพาณิชย์ หรือบริษัทเงินทุนเป็นผู้ออก ผู้รับรอง ผู้รับอวัล ผู้สลับหลัง หรือผู้ค้ำประกัน	43,407,842.82	16.20
(ค) ตราสารที่มีบริษัทที่ได้รับ rating ในระดับ investment grade เป็นผู้ออก ผู้รับรอง ผู้รับอวัล ผู้สลับหลัง หรือผู้ค้ำประกัน	-	-
(ง) ตราสารที่มีอันดับความน่าเชื่อถืออยู่ในอันดับต่ำกว่าอันดับที่สามารถลงทุนได้ (investment grade) หรือตราสารที่ไม่ได้จัดอันดับความน่าเชื่อถือ	-	-

รายละเอียดตัวตราสารและอันดับความน่าเชื่อถือของตราสารแห่งนี้ เงินฝาก หรือตราสารกึ่งหนี้กึ่งทุนที่กองทุนลงทุนหรือมีไว้เป็นรายตัว

ประเภท	ผู้ออก	วันครบกำหนด	อันดับความน่าเชื่อถือ		มูลค่าที่ตราไว้	มูลค่ายุติธรรม
			ตราสาร	ผู้ออก/ค้ำประกัน		
เงินฝากธนาคาร	ธนาคารกรุงเทพ จำกัด (มหาชน)			AA+(tha)	-	1,812,506.37
เงินฝากธนาคาร	ธนาคารอาคารสงเคราะห์	22 เมษายน 2565		AAA(thai)	-	9,006,904.11
เงินฝากธนาคาร	ธนาคารอาคารสงเคราะห์	7 มกราคม 2565		AAA(thai)	-	10,016,767.12
เงินฝากธนาคาร	ธนาคารอาคารสงเคราะห์	22 เมษายน 2565		AAA(thai)	-	5,003,835.62
เงินฝากธนาคาร	ธนาคารอาคารสงเคราะห์	8 กุมภาพันธ์ 2565		AAA(thai)	-	2,004,334.25
เงินฝากธนาคาร	ธนาคารอาคารสงเคราะห์	26 พฤศจิกายน 2564		AAA(thai)	-	15,563,495.35
ตัวสัญญาใช้เงิน	กระทรวงการคลัง	21 กรกฎาคม 2564			29,000,000.00	28,987,293.36
พันธบัตร	ธนาคารแห่งประเทศไทย	29 กรกฎาคม 2564			25,000,000.00	24,987,691.00
พันธบัตร	ธนาคารแห่งประเทศไทย	5 สิงหาคม 2564			26,400,000.00	26,384,025.10
พันธบัตร	ธนาคารแห่งประเทศไทย	13 สิงหาคม 2564			600,000.00	599,592.28
พันธบัตร	ธนาคารแห่งประเทศไทย	19 สิงหาคม 2564			25,000,000.00	24,979,887.50
พันธบัตร	ธนาคารแห่งประเทศไทย	26 สิงหาคม 2564			14,000,000.00	13,987,805.72
พันธบัตร	ธนาคารแห่งประเทศไทย	4 มิถุนายน 2564			20,000,000.00	19,999,457.60
พันธบัตร	ธนาคารแห่งประเทศไทย	24 มิถุนายน 2564			22,200,000.00	22,196,214.01
พันธบัตร	ธนาคารแห่งประเทศไทย	1 กรกฎาคม 2564			10,000,000.00	9,997,493.80
พันธบัตร	ธนาคารแห่งประเทศไทย	8 กรกฎาคม 2564			24,000,000.00	23,993,311.44
พันธบัตร	ธนาคารแห่งประเทศไทย	10 มิถุนายน 2564			7,000,000.00	6,999,568.52
พันธบัตร	ธนาคารแห่งประเทศไทย	15 กรกฎาคม 2564			21,500,000.00	21,492,227.54

สัดส่วนเงินลงทุนขั้นสูงต่อมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุนที่บริษัทจัดการตั้งไว้ในแผนการลงทุนสำหรับกลุ่มตราสาร ตาม (ง) เท่ากับ 0% NAV

คำอธิบายการจัดอันดับความน่าเชื่อถือของสถาบันจัดอันดับความน่าเชื่อถือ

บริษัท พีทซ์ เรทติ้งส์ (ประเทศไทย) จำกัด

อันดับความน่าเชื่อถือระยะยาวสำหรับประเทศไทย

- AAA(thai) แสดงถึงอันดับเครดิตขั้นสูงสุดของอันดับเครดิตภายในประเทศสำหรับประเทศไทย โดยอันดับเครดิตนี้จะให้กับผู้ออกตราสารหนี้หรือตัวตราสารหนี้ ที่คาดว่าจะมีความเสี่ยงของการผิดนัดชำระหนี้ต่ำที่สุดเมื่อเปรียบเทียบกับผู้ออกตราสารหนี้หรือตัวตราสารหนี้อื่นๆ ในประเทศไทย
- AA(thai) อันดับเครดิตภายในประเทศ 'AA(thai)' จะให้กับผู้ออกตราสารหนี้หรือตัวตราสารหนี้ ที่คาดว่าจะมีความเสี่ยงของการผิดนัดชำระหนี้ที่ต่ำมากเมื่อเปรียบเทียบกับผู้ออกตราสารหนี้หรือตัวตราสารหนี้อื่นๆ ในประเทศไทย โดยความเสี่ยงของการผิดนัดชำระหนี้สำหรับอันดับเครดิตภายในประเทศที่ระดับ 'AA(thai)' จะแตกต่างจากความเสี่ยงของการผิดนัดชำระหนี้ของผู้ออกตราสารหนี้หรือตัวตราสารหนี้ที่ได้รับอันดับเครดิตภายในประเทศในลำดับสูงสุดเพียงเล็กน้อย
- A(thai) อันดับเครดิตภายในประเทศ 'A(thai)' จะให้กับผู้ออกตราสารหนี้หรือตัวตราสารหนี้ ที่คาดว่าจะมีความเสี่ยงของการผิดนัดชำระหนี้ที่ต่ำเมื่อเปรียบเทียบกับผู้ออกตราสารหนี้หรือตัวตราสารหนี้อื่นๆ ในประเทศไทย อย่างไรก็ตาม การเปลี่ยนแปลงของสถานการณ์หรือสภาพทางเศรษฐกิจ อาจมีผลกระทบต่อความสามารถในการชำระหนี้ได้ตรงตามกำหนดของตราสารทางการเงินเหล่านี้ มากกว่าตราสารอื่นที่ได้รับการจัดอันดับเครดิตที่สูงกว่า
- BBB(thai) อันดับเครดิตภายในประเทศ 'BBB(thai)' จะให้กับผู้ออกตราสารหนี้หรือตัวตราสารหนี้ ที่คาดว่าจะมีความเสี่ยงของการผิดนัดชำระหนี้ปานกลางเมื่อเปรียบเทียบกับผู้ออกตราสารหนี้หรือตัวตราสารหนี้อื่นๆ ในประเทศไทย อย่างไรก็ตาม การเปลี่ยนแปลงของสถานการณ์หรือสภาพทางเศรษฐกิจ จะมีผลกระทบต่อความสามารถในการชำระหนี้ได้ตรงตามกำหนดเวลาของตราสารทางการเงินเหล่านี้ มากกว่าตราสารหนี้อื่นที่ได้รับการจัดอันดับเครดิตที่สูงกว่า

อันดับความน่าเชื่อถือระยะสั้นสำหรับประเทศไทย

- F1(thai) แสดงถึงระดับความสามารถสูงสุดในการชำระหนี้ได้ตรงตามกำหนดเวลาที่ระบุไว้ในข้อผูกพันทางการเงิน เมื่อเปรียบเทียบกับผู้ออกตราสารหนี้หรือตัวตราสารหนี้อื่นๆ ในประเทศไทย ภายใต้ระบบการจัดอันดับเครดิตภายในประเทศซึ่งกำหนดโดยพีทซ์ อันดับเครดิตในระดับนี้จะให้กับผู้ออกตราสารหนี้หรือตัวตราสารหนี้ ที่มีความเสี่ยงของการผิดนัดชำระหนี้ต่ำที่สุดเมื่อเปรียบเทียบกับผู้ออกตราสารหนี้หรือตัวตราสารหนี้อื่นๆ ในประเทศไทย ในกรณีที่สภาพคล่องอยู่ในระดับที่แข็งแกร่งเป็นพิเศษจะมีสัญลักษณ์ "+" แสดงไว้เพิ่มเติมจากอันดับเครดิตที่ให้ไว้
- F2(thai) แสดงถึงระดับความสามารถในการชำระหนี้ได้ตรงตามกำหนดเวลาที่ระบุไว้ในข้อผูกพันทางการเงินในระดับที่ดี เมื่อเปรียบเทียบกับผู้ออกตราสารหนี้หรือตัวตราสารหนี้อื่นๆ ในประเทศไทย อย่างไรก็ตาม ระดับของความน่าเชื่อถือดังกล่าวยังไม่อาจเทียบเท่ากับกรณีที่ได้รับการจัดอันดับเครดิตที่สูงกว่า
- F3(thai) แสดงถึงระดับความสามารถในการชำระหนี้ได้ตรงตามกำหนดเวลาที่ระบุไว้ในข้อผูกพันทางการเงินในระดับปานกลาง เมื่อเปรียบเทียบกับผู้ออกตราสารหนี้หรือตัวตราสารหนี้อื่นๆ ในประเทศไทย อย่างไรก็ตาม ความสามารถในการชำระหนี้ดังกล่าวมีความอ่อนไหวที่สูงกว่าต่อการเปลี่ยนแปลงในทางลบในระยะสั้น เมื่อเทียบกับอันดับเครดิตที่สูงกว่า

หมายเหตุประกอบการจัดอันดับเครดิตภายในประเทศ:

คำเสริมท้าย 'tha' จะถูกระบุไว้ต่อจากอันดับเครดิตเพื่อบอกถึงอันดับเครดิตภายในประเทศสำหรับประเทศไทย เครื่องหมาย "+" หรือ "-" อาจจะถูกระบุไว้เพิ่มเติมต่อจากอันดับเครดิตภายในประเทศ เพื่อแสดงถึงสถานะเปรียบเทียบภายในอันดับเครดิตชั้นหลัก ทั้งนี้ เครื่องหมาย "+" หรือ "-" ดังกล่าวจะไม่ใช้สำหรับอันดับเครดิตภายในประเทศระยะยาว และอันดับความแข็งแกร่งทางการเงินภายในประเทศของบริษัทประกันภัย '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 และอาจมีความสามารถในการชำระหนี้ที่อ่อนแอลงเมื่อเทียบกับอันดับเครดิตที่อยู่ในระดับสูงกว่า
- อันดับเครดิตจาก AA ถึง C อาจมีเครื่องหมายบวก (+) หรือลบ (-) ต่อท้ายเพื่อจำแนกความแตกต่างของคุณภาพของอันดับเครดิตภายในระดับเดียวกัน

อันดับความน่าเชื่อถือระยะสั้นสำหรับประเทศไทย

- T1 ผู้ออกตราสารหนี้มีสถานะทั้งทางด้านการตลาดและการเงินที่แข็งแกร่งในระดับดีมาก มีสภาพคล่องที่ดีมาก และนักลงทุนจะได้รับความคุ้มครองจากการผิดนัดชำระหนี้ที่ต่ำกว่าอันดับเครดิตในระดับอื่น ผู้ออกตราสารหนี้ได้รับอันดับเครดิตในระดับดังกล่าวซึ่งมีเครื่องหมาย "+" ด้วยจะได้รับความคุ้มครองด้านการผิดนัดชำระหนี้ที่สูงยิ่งขึ้น
- T2 ผู้ออกตราสารหนี้มีสถานะทั้งทางด้านการตลาดและการเงินที่แข็งแกร่งในระดับดี และมีความสามารถในการชำระหนี้ระยะสั้นในระดับที่น่าพอใจ
- T3 ผู้ออกตราสารหนี้มีความสามารถในการชำระหนี้ระยะสั้นในระดับที่ยอมรับได้
- T4 ผู้ออกตราสารหนี้มีความสามารถในการชำระหนี้ระยะสั้นที่ค่อนข้างอ่อนแอ

แบบแสดงค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม

สำหรับระยะเวลา 6 เดือน ตั้งแต่วันที่ 1 ธันวาคม 2563 ถึง 31 พฤษภาคม 2564

ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม* (Fund's Direct Expenses)	จำนวนเงิน หน่วย : พันบาท	ร้อยละของ มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ
ค่าธรรมเนียมการจัดการ (Management Fee)	115.90	0.04
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ (Trustee Fee)	45.59	0.02
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน (Registrar Fee)	108.17	0.04
ค่าใช้จ่ายอื่นๆ (Other Expenses)	0.20	0.00
รวมค่าใช้จ่ายทั้งหมด (Total Fund's Direct Expenses)**	269.86	0.10

* ค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายที่หักจากกองทุนรวมได้รวมภาษีมูลค่าเพิ่มแล้ว

** ไม่รวมค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์และค่าธรรมเนียมต่างๆ ที่เกิดขึ้นจากการซื้อขายหลักทรัพย์และภาษีเงินได้จากการลงทุนในตราสารหนี้

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุนของกองทุน (Portfolio Turnover Ratio : “PTR”)

สำหรับระยะเวลา 6 เดือน ตั้งแต่วันที่ 1 ธันวาคม 2563 ถึง 31 พฤษภาคม 2564

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

$$\text{PTR} = \frac{107,638,887.42}{289,681,482.78}$$

$$\text{PTR} = 0.37$$

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

รายงานชื่อบุคคลที่เกี่ยวข้องที่กองทุนเข้าทำธุรกรรม

กองทุนเปิดทาลิส ตลาดเงิน ไม่มีรายการทำธุรกรรมกับบุคคลที่เกี่ยวข้อง ข้อมูลระหว่างวันที่ 1 ธันวาคม 2563 ถึง 31 พฤษภาคม 2564

รายงานการถือหน่วยลงทุนเกินข้อจำกัดการใช้สิทธิออกเสียง

กองทุนเปิดทาลิส ตลาดเงิน ไม่มีการถือหน่วยลงทุนเกิน 1 ใน 3 โดยบุคคลใดบุคคลหนึ่ง ข้อมูล ณ วันที่ 31 พฤษภาคม 2564

ผู้ลงทุนสามารถตรวจสอบรายละเอียดการทำธุรกรรมกับบุคคลที่เกี่ยวข้องกับกองทุนรวมและรายงานการถือหน่วยลงทุนเกินข้อจำกัดการใช้สิทธิออกเสียง ได้ที่บริษัทจัดการโดยตรง หรือที่ website ของบริษัทจัดการที่ <http://www.talisam.co.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