

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ทาลิส จำกัด

ข้อมูล ณ วันที่ 30 ก.ย. 2568

## กองทุนเปิดทาลิส หุ้ญเอส 500-HEDGE

TLUS500-H

### ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

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

### นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- ลงทุนในกองทุนต่างประเทศเพียงกองทุนเดียว คือ iShares Core S&P 500 ETF (กองทุนหลัก) โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV และป้องกันความเสี่ยงด้านอัตราแลกเปลี่ยนไม่น้อยกว่า 90% ของมูลค่าเงินลงทุนในต่างประเทศ
- กองทุนหลักเป็นกองทุน ETF ภายใต้การบริหารจัดการของ BlackRock Fund Advisors มีวัตถุประสงค์เพื่อสร้างผลตอบแทนให้ใกล้เคียงกับผลการดำเนินงานจากการลงทุนของดัชนี S&P 500 (ดัชนีอ้างอิง) ซึ่งวัดผลการดำเนินงานของตราสารทุนของบริษัทขนาดใหญ่ (large-capitalization) ในสหรัฐฯ ตามที่กำหนดโดย S&P Dow Jones Indices LLC (Index Provider)
- กองทุนไทยมุ่งหวังให้ผลประโยชน์การเคลื่อนไหวตามกองทุนหลัก ส่วนกองทุนหลักมุ่งหวังให้ผลประโยชน์การเคลื่อนไหวตามดัชนีชี้วัด (passive management)

### ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (%ต่อปี)

ยังไม่มีข้อมูล

### ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด (%ต่อปี\*)

|                          | YTD   | 3 เดือน | 6 เดือน | 1 ปี*           |
|--------------------------|-------|---------|---------|-----------------|
| กองทุน                   | 19.61 | 7.09    | 17.16   | N/A             |
| ดัชนีชี้วัด              | 17.19 | 7.28    | 16.81   | N/A             |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน | 8.92  | 6.19    | 17.33   | N/A             |
| ความผันผวนกองทุน         | 23.12 | 8.83    | 23.69   | N/A             |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด    | 23.17 | 8.78    | 23.63   | N/A             |
|                          | 3 ปี* | 5 ปี*   | 10 ปี*  | ตั้งแต่จัดตั้ง* |
| กองทุน                   | N/A   | N/A     | N/A     | 19.61           |
| ดัชนีชี้วัด              | N/A   | N/A     | N/A     | 17.19           |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน | N/A   | N/A     | N/A     | N/A             |
| ความผันผวนกองทุน         | N/A   | N/A     | N/A     | 23.12           |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด    | N/A   | N/A     | N/A     | 23.17           |

### ระดับความเสี่ยง

ต่ำ 1 2 3 4 5 6 7 8 สูง

เสี่ยงสูง

ลงทุนในตราสารทุนเป็นหลักโดยเฉลี่ย  
ในรอบปีไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV

### ข้อมูลกองทุนรวม

|                        |               |
|------------------------|---------------|
| วันจดทะเบียนกองทุน     | 12 มี.ค. 2568 |
| นโยบายการจ่ายเงินปันผล | ไม่จ่าย       |
| อายุกองทุน             | ไม่กำหนด      |

### ผู้จัดการกองทุนรวม

นาย วีระพล สิมะโรจน์ (ตั้งแต่ 12 มี.ค. 2568)  
นาย ธนบดี รัตนชูวงศ์ (ตั้งแต่ 12 มี.ค. 2568)

### ดัชนีชี้วัด :

ผลการดำเนินงานของกองทุนรวมหลัก ปรับด้วยต้นทุนการป้องกันความเสี่ยงอัตราแลกเปลี่ยนเพื่อคำนวณผลตอบแทนเป็นสกุลเงินบาท ณ วันที่คำนวณผลตอบแทน สัดส่วน 90.00% และปรับด้วยอัตราแลกเปลี่ยนเพื่อคำนวณผลตอบแทนเป็นสกุลเงินบาท ณ วันที่คำนวณผลตอบแทน สัดส่วน 10.00%  
วัตถุประสงค์ในการอ้างอิงดัชนีชี้วัด : เพื่อเปรียบเทียบกับผลการดำเนินงานของกองทุน

### คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวม มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต: ได้รับการรับรองจาก CAC  
จัดอันดับกองทุน Morningstar

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



"ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือ  
บริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่อง  
ได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม"

www.talisam.co.th

| การซื้อขายหน่วยลงทุน                 | การขายคืนหน่วยลงทุน                |
|--------------------------------------|------------------------------------|
| วันทำการซื้อ : ทุกวันทำการ           | วันทำการขายคืน : ทุกวันทำการ       |
| เวลาทำการ : 8.30 น. - 15.30 น.       | เวลาทำการ : 8.30 น. - 15.30 น.     |
| การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ : 1,000 บาท   | การขายคืนขั้นต่ำ : ไม่กำหนด        |
| การซื้อครั้งถัดไปขั้นต่ำ : 1,000 บาท | ยอดคงเหลือขั้นต่ำ : ไม่กำหนด       |
|                                      | ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน : T+2* |

หมายเหตุ \*ภายใน 5 วันทำการนับแต่วันคำนวณ NAV (T+1) หมายความว่า บริษัทจัดการจะชำระเงินค่าขายคืนภายใน 6 วันทำการนับแต่วันทำการขายคืน (ปัจจุบันคืนเงินค่าขายคืน T+2)  
T = วันทำการซื้อขายของกองทุน

| ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV) |               |          |
|-------------------------------------------------------|---------------|----------|
| ค่าธรรมเนียม                                          | สูงสุดไม่เกิน | เก็บจริง |
| การจัดการ                                             | 1.6050        | 0.2675*  |
| รวมค่าใช้จ่าย                                         | 2.9425        | 0.35845  |

หมายเหตุ 1) ค่าธรรมเนียมหรือค่าใช้จ่ายดังกล่าวได้รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะ หรือภาษีอื่นใดแล้ว 2) สามารถดูค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวมย้อนหลัง 3 ปี ในหนังสือชี้ชวนส่วนข้อมูลกองทุนรวมได้ที่ [www.talisam.co.th](http://www.talisam.co.th) 3) บริษัทอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ 4)\* อัตราค่าธรรมเนียมการจัดการที่เรียกเก็บจริงตั้งแต่วันที่ 1 ก.ย. - 31 ต.ค. 2568 (หลังจากนั้นเรียกเก็บในอัตรา 0.535% ต่อปีของ NAV)

| ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย) |                     |                     |
|-------------------------------------------------------------|---------------------|---------------------|
| ค่าธรรมเนียม                                                | สูงสุดไม่เกิน       | เก็บจริง            |
| การขาย                                                      | 1.00                | 0.50**              |
| การรับซื้อคืน                                               | 1.00                | ยกเว้น              |
| การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า                                 | 1.00                | 0.50**              |
| การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก                                  | 1.00                | ยกเว้น              |
| การโอนหน่วย*                                                | 100 บาท/1,000 หน่วย | 100 บาท/1,000 หน่วย |

หมายเหตุ (1) ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้สั่งซื้อได้รับภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะ หรือภาษีอื่นใดแล้ว โดยบริษัทจัดการอาจเรียกเก็บค่าธรรมเนียมจากผู้ลงทุนโดยตรง (2) ค่าธรรมเนียมการขาย/การรับซื้อคืน/การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนอาจเรียกเก็บจากผู้ถือหน่วยลงทุนแต่ละกลุ่มในอัตราที่ไม่เท่ากัน โดยบริษัทจัดการจะแจ้งรายละเอียดและหลักเกณฑ์ให้ทราบต่อไป (3)\* ค่าธรรมเนียมการโอนหน่วย 100 บาท/1,000 หน่วยลงทุน ขั้นต่ำ 500 บาท (4)\*\* อัตราค่าธรรมเนียมการขายและการสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้าที่เรียกเก็บจริง ตั้งแต่วันที่ 1 ก.ย. - 31 ต.ค. 2568

| สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน |        | ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก |        |
|--------------------------------|--------|-------------------------------|--------|
| breakdown                      | % NAV  | holding                       | % NAV  |
| หน่วยลงทุน                     | 100.55 | ISHARES CORE S&P 500 ETF      | 100.55 |
| เงินฝากธนาคาร                  | 0.97   |                               |        |
| สินทรัพย์อื่นหรือหนี้สินอื่น   | -0.02  |                               |        |

| 5 อันดับแรกข้อมูลกองทุนหลัก |       |
|-----------------------------|-------|
| holding                     | % NAV |
| NVIDIA CORP                 | 7.32  |
| MICROSOFT CORP              | 7.03  |
| APPLE INC                   | 5.82  |
| AMAZON COM INC              | 3.94  |
| META PLATFORMS INC-CLASS A  | 3.05  |

| ข้อมูลเชิงสถิติ            |               |
|----------------------------|---------------|
| Maximum Drawdown           | -13.88%       |
| Recovering Period          | 1 เดือน 5 วัน |
| FX Hedging                 | 94.54%        |
| อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน | N/A           |
| Tracking Error             | N/A           |

| การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรมของกองทุนหลัก |       |
|-------------------------------------------------|-------|
| sector                                          | % NAV |
| Information Technology                          | 33.03 |
| Financials                                      | 14.00 |
| Consumer Discretionary                          | 10.35 |
| Communication                                   | 9.77  |
| Health Care                                     | 9.30  |

## การลงทุนในกองทุนอื่นเกินกว่า 20% (กองในประเทศและกองต่างประเทศ)

ชื่อกอง : iShares Core S&P 500 ETF

ISIN code : US464287200

Bloomberg code : IVV

### คำอธิบาย

**Maximum Drawdown** เปอร์เซ็นต์ผลขาดทุนสูงสุดของกองทุนรวมในระยะเวลา 5 ปีย้อนหลัง (หรือตั้งแต่จัดตั้งกองทุนกรณีที่ยังไม่ครบ 5 ปี) โดยวัดจากระดับ NAV ต่อหน่วยที่จุดสูงสุดไปจนถึงจุดต่ำสุดในช่วงที่ NAV ต่อหน่วยปรับตัวลดลง ค่า Maximum Drawdown เป็นข้อมูลที่ช่วยให้ทราบถึงความเสี่ยงที่อาจจะขาดทุนจากการลงทุนในกองทุนรวม **Recovering Period** ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาตั้งแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลานานเท่าใด **FX Hedging** เปอร์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

**อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน** ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตกองทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลานึง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์กับผลรวมของมูลค่าการขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 1 ปี ทหารด้วยมูลค่า 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](http://www.talisam.co.th)

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