

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ทาลิส จำกัด

ข้อมูล ณ วันที่ 5 ม.ค. 2569

## กองทุนเปิดทาลิส หุ้ญเอส เอ็นดีคิว-อันเฮดจ์

ชนิดช่องทางพิเศษ

TLUSNDQ-UH-X

### ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

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

### นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- ลงทุนในกองทุนต่างประเทศเพียงกองทุนเดียว คือ Invesco NASDAQ 100 ETF (กองทุนหลัก) โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV
- กองทุนหลักเป็นกองทุน ETF ภายใต้การบริหารจัดการของ Invesco Capital Management LLC ลงทุนส่วนใหญ่ในหุ้นของบริษัทขนาดใหญ่ที่มีมูลค่าตลาดสูงที่สุดจำนวน 100 บริษัทที่จดทะเบียนซื้อขายในตลาดหุ้น NASDAQ เพื่อสร้างผลตอบแทนให้ใกล้เคียงกับดัชนี NASDAQ-100
- กองทุนจะไม่ลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivative) เพื่อลดความเสี่ยง (Hedging) ด้านอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ และเพื่อเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน
- กองทุนไทยมุ่งหวังให้ผลประกอบการเคลื่อนไหวตามกองทุนหลัก ส่วนกองทุนหลักมุ่งหวังให้ผลประกอบการเคลื่อนไหวตามดัชนีชี้วัด (passive management)

### ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (%ต่อปี)

ยังไม่มีข้อมูล

### ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด (%ต่อปี\*)

|                          | YTD   | 3 เดือน | 6 เดือน | 1 ปี*           |
|--------------------------|-------|---------|---------|-----------------|
| กองทุน                   | N/A   | N/A     | N/A     | N/A             |
| ดัชนีชี้วัด              | N/A   | N/A     | N/A     | N/A             |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน | N/A   | N/A     | N/A     | N/A             |
| ความผันผวนกองทุน         | N/A   | N/A     | N/A     | N/A             |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด    | N/A   | N/A     | N/A     | N/A             |
|                          | 3 ปี* | 5 ปี*   | 10 ปี*  | ตั้งแต่จัดตั้ง* |
| กองทุน                   | N/A   | N/A     | N/A     | N/A             |
| ดัชนีชี้วัด              | N/A   | N/A     | N/A     | N/A             |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน | N/A   | N/A     | N/A     | N/A             |
| ความผันผวนกองทุน         | N/A   | N/A     | N/A     | N/A             |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด    | N/A   | N/A     | N/A     | N/A             |

### ระดับความเสี่ยง

ต่ำ 

|   |   |   |   |   |   |   |   |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|

 สูง

เสี่ยงสูง

ลงทุนในตราสารทุนเป็นหลักโดยเฉลี่ย  
ในรอบปีไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV

### ข้อมูลกองทุนรวม

|                        |              |
|------------------------|--------------|
| วันจดทะเบียนกองทุน     | 13 ก.พ. 2568 |
| วันเริ่มต้น class      | 5 ม.ค. 2569  |
| นโยบายการจ่ายเงินปันผล | ไม่จ่าย      |
| อายุกองทุน             | ไม่กำหนด     |

### ผู้จัดการกองทุนรวม

นาย วีระพล สิมะโรจน์ (ตั้งแต่ 5 ม.ค. 2569)

นาย ธนบดี รัตนชูวงศ์ (ตั้งแต่ 5 ม.ค. 2569)

### ดัชนีชี้วัด :

ผลการดำเนินงานของกองทุนรวมหลัก สัดส่วน 100%  
ปรับตัวอัตราแลกเปลี่ยนเพื่อคำนวณผลตอบแทนเป็น  
สกุลเงินบาท ณ วันที่คำนวณผลตอบแทน  
วัตถุประสงค์ในการอ้างอิงดัชนีชี้วัด : เพื่อเปรียบเทียบกับ  
ผลการดำเนินงานของกองทุน

### 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        | 0.107    |
| รวมค่าใช้จ่าย                                         | 2.8890        | 0.18725* |

หมายเหตุ 1) ค่าธรรมเนียมหรือค่าใช้จ่ายดังกล่าวได้รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะ หรือภาษีอื่นใดแล้ว 2)\* ค่าใช้จ่ายรวมที่เรียกเก็บจริง ยังไม่รวมค่าใช้จ่ายอื่น 3) สามารถดูค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวมย้อนหลัง 3 ปี ในหนังสือชี้ชวนข้อมูลกองทุนรวมได้ที่ [www.talisam.co.th](http://www.talisam.co.th) 4) บริษัทอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ

| ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย) |                     |                     |
|-------------------------------------------------------------|---------------------|---------------------|
| ค่าธรรมเนียม                                                | สูงสุดไม่เกิน       | เก็บจริง            |
| การขาย                                                      | 1.00                | 0.10                |
| การรับซื้อคืน                                               | 1.00                | 0.30                |
| การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า                                 | 1.00                | 0.10                |
| การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก                                  | 1.00                | 0.30                |
| การโอนหน่วย*                                                | 100 บาท/1,000 หน่วย | 100 บาท/1,000 หน่วย |

หมายเหตุ (1) ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้สั่งซื้อได้รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะ หรือภาษีอื่นใดแล้ว โดยบริษัทจัดการอาจเรียกเก็บค่าธรรมเนียมจากผู้ลงทุนโดยตรง (2) ค่าธรรมเนียมการขาย/การรับซื้อคืน/การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนอาจเรียกเก็บจากผู้ถือหน่วยลงทุนแต่ละกลุ่มในอัตราที่ไม่เท่ากัน โดยบริษัทจัดการจะแจ้งรายละเอียดและหลักเกณฑ์ให้ทราบต่อไป (3)\* ค่าธรรมเนียมการโอนหน่วย 100 บาท/1,000 หน่วยลงทุน ขั้นต่ำ 500 บาท

| สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน |       | ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก |       |
|--------------------------------|-------|-------------------------------|-------|
| breakdown                      | % NAV | holding                       | % NAV |
| หน่วยลงทุน                     | 99.68 | INVESCO NASDAQ 100 ETF        | 99.68 |
| สินทรัพย์อื่นหรือหนี้สินอื่น   | 0.19  |                               |       |
| เงินฝากธนาคาร                  | 0.13  |                               |       |

| 5 อันดับแรกข้อมูลกองทุนหลัก |       |
|-----------------------------|-------|
| holding                     | % NAV |
| Nvidia                      | 9.87  |
| Microsoft                   | 8.38  |
| Apple                       | 8.23  |
| Broadcom                    | 5.59  |
| Amazon                      | 5.10  |

| ข้อมูลเชิงสถิติ            |                            |
|----------------------------|----------------------------|
| Maximum Drawdown           | N/A                        |
| Recovering Period          | N/A                        |
| FX Hedging                 | กองทุนไม่ป้องกันความเสี่ยง |
| อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน | N/A                        |
| Tracking Error             | N/A                        |

| การจัดสรรการลงทุนในต่างประเทศของกองทุนหลัก |       |
|--------------------------------------------|-------|
| country                                    | % NAV |
| United States                              | 96.34 |
| Canada                                     | 1.35  |
| Other/Cash                                 | 0.75  |
| Brazil                                     | 0.63  |
| China                                      | 0.47  |

| การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรมของกองทุนหลัก |       |
|-------------------------------------------------|-------|
| sector                                          | % NAV |
| Technology                                      | 64.14 |
| Consumer Discretionary                          | 18.32 |
| Health Care                                     | 4.22  |
| Telecommunications                              | 3.72  |
| Industrials                                     | 3.67  |

## การลงทุนในกองทุนอื่นเกินกว่า 20% (กองในประเทศและกองต่างประเทศ)

ชื่อกอง : Invesco NASDAQ 100 ETF

ISIN code : US46138G6492

Bloomberg code : QQQM

### 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