

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ทาลิส จำกัด

ข้อมูล ณ วันที่ 30 เม.ย. 2569

กองทุนเปิดทาลิส หุ้นยูเอส เอ็นดีคิว เพื่อการเลี้ยงชีพ

TLUSNDQRMF

ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมตราสารทุน / กองทุนรวมฟีดเดอร์ (Feeder Fund) / กองทุนรวมเพื่อการเลี้ยงชีพ (RMF) / 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
- 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 | 11.19 | 11.05 | N/A | N/A |
| ดัชนีชี้วัด | 11.69 | 11.60 | N/A | N/A |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน | 3.56 | 4.00 | N/A | N/A |
| ความผันผวนกองทุน | 20.41 | 21.75 | N/A | N/A |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด | 20.89 | 22.25 | N/A | N/A |
| | 3 ปี* | 5 ปี* | 10 ปี* | ตั้งแต่จัดตั้ง* |
| กองทุน | N/A | N/A | N/A | 9.49 |
| ดัชนีชี้วัด | N/A | N/A | N/A | 9.58 |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน | N/A | N/A | N/A | N/A |
| ความผันผวนกองทุน | N/A | N/A | N/A | 19.66 |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด | N/A | N/A | N/A | 20.28 |

ระดับความเสี่ยง



ข้อมูลกองทุนรวม

| | |
|---|-----------------------|
| วันจดทะเบียนกองทุน | 8 ธ.ค. 2568 |
| นโยบายการจ่ายเงินปันผล | ไม่จ่าย |
| อายุกองทุน | ไม่กำหนด |
| การป้องกันความเสี่ยง FX | ไม่ป้องกัน (unhedged) |
| การเรียกเก็บค่าธรรมเนียมตามผลการดำเนินงาน | ไม่มี |

ผู้จัดการกองทุนรวม

นาย วีระพล สิมะโรจน์ (ตั้งแต่ 8 ธ.ค. 2568)
นาย ธนบดี รัตน์ชูวงศ์ (ตั้งแต่ 8 ธ.ค. 2568)

ดัชนีชี้วัด :

ผลการดำเนินงานของกองทุนรวมหลัก สัดส่วน 100% ปรับด้วยอัตราแลกเปลี่ยนเพื่อคำนวณผลตอบแทนเป็นสกุลเงินบาท ณ วันที่คำนวณผลตอบแทน
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 -7.32% |
| เวลาทำการ : 8.30 น. - 15.30 น. | เวลาทำการ : 8.30 น. - 15.30 น. | Recovering Period 17 วัน |
| การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ : 1,000 บาท | การขายคืนขั้นต่ำ : ไม่กำหนด | อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน N/A |
| การซื้อครั้งถัดไปขั้นต่ำ : 1 บาท | ยอดคงเหลือขั้นต่ำ : ไม่กำหนด | Tracking Error N/A |
| | ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน : T+2* | |

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

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV) ค่าธรรมเนียมต่อไปนี้จะส่งผลกระทบต่อ

ต่อผู้ลงทุน เนื่องจากจะทำให้ผลตอบแทนจากการลงทุนลดลง ดังนั้น ผู้ลงทุนควรตรวจสอบทุกครั้งก่อนตัดสินใจลงทุน

| ค่าธรรมเนียม | สูงสุดไม่เกิน | เก็บจริง |
|--|---------------|----------|
| การจัดการ | 1.6050 | 0.4922 |
| ค่าตอบแทนแก่ตัวแทนขายหน่วยลงทุนของกองทุนรวม (trailer fee) : มี | | |
| รวมค่าใช้จ่าย | 4.0660 | 0.6313 |

หมายเหตุ 1) ค่าธรรมเนียมหรือค่าใช้จ่ายดังกล่าวได้รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะ หรือภาษีอื่นใดแล้ว 2)* ค่าใช้จ่ายรวมที่เรียกเก็บจริง ยังไม่รวมค่าใช้จ่ายอื่น 3) สามารถดูค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวมย้อนหลัง 3 ปี ในหนังสือชี้ชวนส่วนข้อมูลกองทุนรวมได้ที่ www.talisam.co.th 4) บริษัทอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย) ผู้ลงทุนจะถูกเรียกเก็บค่าธรรมเนียม

ต่อไปนี้โดยตรงทุกครั้งเมื่อทำรายการซื้อขายหรือสับเปลี่ยนหน่วยลงทุน

| ค่าธรรมเนียม | สูงสุดไม่เกิน | เก็บจริง |
|-----------------------------|---------------|----------|
| การขาย | 1.00 | ยกเว้น |
| การรับซื้อคืน | 1.00 | ยกเว้น |
| การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า | 1.00 | ยกเว้น |
| การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก | 1.00 | ยกเว้น* |
| การโอนหน่วย | ไม่มี | ไม่มี |

หมายเหตุ (1) ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วยได้รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะ หรือภาษีอื่นใดแล้ว โดยบริษัทจัดการอาจเรียกเก็บค่าธรรมเนียมจากผู้ลงทุนโดยตรง (2) ค่าธรรมเนียมการขาย/การรับซื้อคืน/การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนอาจเรียกเก็บจากผู้ถือหน่วยลงทุนแต่ละกลุ่มในอัตราที่ไม่เท่ากัน โดยบริษัทจัดการจะแจ้งรายละเอียดและหลักเกณฑ์ให้ทราบต่อไป (3)* ค่าธรรมเนียมการสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนไปกองทุน RMF ภายใต้การจัดการของบล.อื่น : 200 บาทต่อรายการ โดยเรียกเก็บเป็นเงินสด

| สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน | % NAV | ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก | % NAV |
|--------------------------------|-------|-------------------------------|-------|
| breakdown | % NAV | holding | % NAV |
| หน่วยลงทุน | 98.82 | INVECO NASDAQ 100 ETF | 98.82 |
| เงินฝากธนาคาร | 1.03 | | |
| สินทรัพย์อื่นหรือหนี้สินอื่น | 0.15 | | |

คำอธิบาย

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

Recovering Period ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาตั้งแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลานานเท่าใด

FX Hedging เปรอ์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลาหนึ่ง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อหลักทรัพย์กับผลรวมของมูลค่าการขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 1 ปี หาดด้วยมูลค่า 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 สูงกว่าจะเป็นกองทุนที่มีประสิทธิภาพในการบริหารจัดการการลงทุนที่ดีกว่า 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

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