



กองทุนเปิดทาลิส ตลาดเงิน

TALIS MONEY MARKET FUND (TLMMF)

รายงานรอบระยะเวลา 6 เดือน

รอบระยะเวลาตั้งแต่วันที่ 1 ธันวาคม 2564 ถึง 31 พฤษภาคม 2565

รายงานรอบระยะเวลา 6 เดือน

ตั้งแต่วันที่ 1 ธันวาคม 2564 ถึง 31 พฤษภาคม 2565

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 หรือธุรกรรมการซื้อโดยมีสัญญาขายคืน (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

ในส่วนของเหลือ 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 20 มิถุนายน 2565

เรียน ท่านผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุน

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ทาลิส จำกัด (บริษัทฯ) ขอนำส่งรายงานผลการดำเนินงานสำหรับรอบระยะเวลา 6 เดือน (1 ธันวาคม 2564 – 31 พฤษภาคม 2565) ของกองทุนเปิดทาลิส ตลาดเงิน มายังผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุนทุกท่าน

เศรษฐกิจไทยในปี 2565 มีแนวโน้มปรับตัวดีขึ้นอย่างต่อเนื่อง โดยมีปัจจัยสนับสนุนสำคัญจากการฟื้นตัวของอุปสงค์ภายในประเทศและภาคการท่องเที่ยว ภายหลังจากความรุนแรงของผลกระทบจากการระบาดของโรคก่อน คลายลงซึ่งทำให้รัฐบาลไทยและประเทศต่าง ๆ สามารถผ่อนคลายมาตรการควบคุมการแพร่ระบาดของโรค รวมทั้งปัจจัยสนับสนุนจากแนวโน้มการขยายตัวต่อเนื่องของการส่งออกสินค้าตามการขยายตัวของเศรษฐกิจและปริมาณการค้าโลก ทางด้านนโยบายการเงินของไทยในครั้งแรกของปี 2565 มีมติคงอัตราดอกเบี้ยนโยบายไว้ที่ 0.50% ต่อปี และเตรียมพิจารณาสิ้นสุดนโยบายการเงินแบบผ่อนคลาย ตลอดจนช่วงเวลาที่เหมาะสมในการทยอยปรับขึ้นอัตราดอกเบี้ยนโยบายในระยะถัดไป โดย ธปท. ประเมินว่า เศรษฐกิจไทยในปี 2565 - 2566 มีแนวโน้มฟื้นตัวดีกว่าคาดจากอุปสงค์ภายในประเทศและจำนวนนักท่องเที่ยวต่างชาติที่เพิ่มขึ้น

กองทุนเปิดทาลิส ตลาดเงิน เน้นลงทุนในตราสารหนี้ระยะสั้น อัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในแต่ละวันมีความสม่ำเสมอ มีความผันผวนต่ำ ณ วันที่ 31 พฤษภาคม 2565 มีมูลค่าทรัพย์สินสุทธิ 274,467,434.91 บาท มูลค่าหน่วยลงทุน 10.4865 บาท อัตราผลตอบแทนในรอบ 6 เดือน 0.2834% ต่อปี และอัตราผลตอบแทนนับตั้งแต่จัดตั้งกองทุน 0.8875% ต่อปี

บริษัทฯ ขอขอบพระคุณท่านผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุนทุกท่านที่เชื่อมั่นและให้ความไว้วางใจ บริษัทฯ จะบริหารการลงทุนด้วยความรอบคอบและระมัดระวัง ภายใต้อุประเบียบต่าง ๆ และจรรยาบรรณวิชาชีพ เพื่อผลประโยชน์สูงสุดของท่านผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุนทุกท่านเป็นสำคัญ

ขอแสดงความนับถือ

คณะผู้จัดการกองทุน

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ทาลิส จำกัด

รายงานการวิเคราะห์ของบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ทาลิส จำกัด ในฐานะบริษัทจัดการ กองทุนเปิดทาลิส ตลาดเงิน

ภาวะเศรษฐกิจ

เศรษฐกิจไทยในไตรมาสแรกของปี 2565 ขยายตัว 2.2% เติบโตขึ้นจากการขยายตัว 1.8% ในไตรมาสที่สี่ของปี 2564 ด้านการใช้จ่าย การอุปโภคบริโภคภาคเอกชน และการส่งออกบริการขยายตัวเพิ่มขึ้น การลงทุนภาคเอกชน กลับมาขยายตัว ขณะที่การส่งออกสินค้าชะลอตัว และการลงทุนภาครัฐปรับตัวลดลง ด้านการผลิต สาขาที่พักแรม และบริการด้านอาหาร และสาขาเกษตรกรรม การป่าไม้ และการประมงกลับมาขยายตัว สาขาขนส่งและสถานที่เก็บ สินค้าขยายตัวเพิ่มขึ้น ขณะที่สาขาการผลิตสินค้าอุตสาหกรรม สาขาการขนส่ง ขยายปลีก และการซ่อมฯ และสาขา การไฟฟ้าและก๊าซฯ ชะลอตัว และสาขาการก่อสร้างลดลงต่อเนื่อง เมื่อปรับผลของฤดูกาลออกแล้ว เศรษฐกิจไทยใน ไตรมาสแรกของปี 2565 ขยายตัวจากไตรมาสที่ผ่านมา 1.1% (QoQ_SA)

สำนักงานสภาพัฒนาการเศรษฐกิจและสังคมแห่งชาติ คาดแนวโน้มเศรษฐกิจไทยปี 2565 จะขยายตัวในช่วง 2.5% - 3.5% โดยมีปัจจัยสนับสนุนสำคัญจากการปรับตัวดีขึ้นของอุปสงค์ภายในประเทศ การฟื้นตัวของภาคการ ท่องเที่ยว และการขยายตัวอย่างต่อเนื่องของการส่งออกสินค้า ทั้งนี้ คาดว่ามูลค่าการส่งออกสินค้าในรูปดอลลาร์ สรอ. จะขยายตัว 7.3% การอุปโภคบริโภคและการลงทุนภาคเอกชนขยายตัว 3.9% และ 3.5% ตามลำดับ ขณะที่การ ลงทุนภาครัฐขยายตัว 3.4% ส่วนอัตราเงินเฟ้อทั่วไปคาดว่าจะอยู่ในช่วง 4.2% - 5.2% และดุลบัญชีเดินสะพัดมี แนวโน้มขาดดุล 1.5% ของ GDP

ภาวะตลาดการเงินและตราสารหนี้

ภายหลังการประชุม FOMC ในครั้งสุดท้ายของปี 2564 ประธาน FED ได้ประกาศเร่งการลด QE เป็น 2 เท่า โดยจะลดวงเงินซื้อพันธบัตรรัฐบาลและวงเงินซื้อสินทรัพย์ที่อยู่อาศัยค่าประกันไปพร้อมกันตามสัดส่วน 2 หมื่นล้าน ดอลลาร์สหรัฐและ 1 หมื่นล้านดอลลาร์สหรัฐต่อเดือน รวม 3 หมื่นล้านดอลลาร์สหรัฐต่อเดือน เริ่มตั้งแต่กลางเดือน มกราคม 2565 ซึ่งเพิ่มขึ้นจากอัตราเดิมที่ 1.5 หมื่นล้านดอลลาร์สหรัฐต่อเดือน ทำให้ QE สำหรับในช่วงการแพร่ ระบาดของไวรัสจะสิ้นสุดเร็วขึ้นเป็นในช่วงปลายเดือนมีนาคม 2565 จากเดิมที่จะสิ้นสุดในเดือนมิถุนายน 2565 เนื่องจากประเมินว่าเงินเฟ้อมีแนวโน้มพุ่งสูงขึ้น ในขณะที่ตลาดแรงงานฟื้นตัวได้อย่างรวดเร็ว ต่อมาในการประชุม FOMC ปี 2565 เดือนมีนาคม พฤษภาคม และมิถุนายน ได้ปรับเพิ่มอัตราดอกเบี้ยนโยบาย 0.25% 0.50% และ 0.75% ตามลำดับ ทำให้อัตราดอกเบี้ยนโยบายล่าสุดอยู่ที่ 1.50-1.75% และยังคงสัญญาณขึ้นดอกเบี้ยในการประชุม ทุกครั้งในปี นี้ แฉงการณ์ระบุว่า การจ้างงานยังเพิ่มขึ้นอย่างแข็งแกร่งและอัตราว่างงานปรับลดลงต่ำ เงินเฟ้อยัง ขยายตัวสูง จากผลของความไม่สมดุลระหว่างอุปสงค์และอุปทานสืบเนื่องมาจากการระบาดของไวรัส ราคาพลังงานที่

ปรับเพิ่มขึ้นสูง และแรงกดดันด้านราคาที่เป็นวงกว้างมากขึ้น นอกจากนี้ยังพิจารณาเตรียมปรับลดขนาดงบดุลครั้งใหญ่หรือ QT โดยจะลดขนาดงบดุลไปจนถึงระดับสูงสุดที่ 9.5 หมื่นล้านดอลลาร์สหรัฐภายในระยะเวลา 3 เดือนหรือนานกว่านั้นขึ้นอยู่กับสภาพเศรษฐกิจ โดยจะเริ่มต้นในเดือนมิถุนายนนี้ ผลจากการเปลี่ยนแปลงของนโยบายการเงินดังกล่าว ทำให้อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลสหรัฐมีความผันผวนและปรับเพิ่มขึ้นตลอดทุกช่วงอายุ โดย ณ สิ้นเดือนพฤษภาคม อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลสหรัฐอายุ 2 ปีและ 10 ปี เพิ่มขึ้นจากสิ้นปี 180bps และ 133bps ตามลำดับ นอกจากนี้ ช่วงเดือนเมษายนจนถึงมิถุนายน ในบางวันมีการซื้อขายพันธบัตรที่เกิดภาวะ Inverted Yield Curve กล่าวคืออัตราผลตอบแทนพันธบัตรอายุ 2 ปีหรือ 5 ปีสูงกว่าอัตราผลตอบแทนพันธบัตรอายุ 10 ปี ทำให้นักเศรษฐศาสตร์เริ่มมีความกังวลว่าเศรษฐกิจสหรัฐอาจเผชิญกับภาวะเศรษฐกิจถดถอยได้ในอนาคตอันใกล้

ทางด้านการประชุมคณะกรรมการนโยบายการเงิน (กนง.) ล่าสุดในเดือนมิถุนายน มีมติ 4-3 ให้คงดอกเบี้ยนโยบายที่ 0.50% เนื่องจากเศรษฐกิจไทยฟื้นตัวดีกว่าคาด จากทั้งอุปสงค์ภายในประเทศและจำนวนนักท่องเที่ยวต่างชาติที่เพิ่มขึ้น อย่างไรก็ตาม ความเสี่ยงจากเงินเฟ้อเพิ่มมากขึ้น ส่งผลให้ กนง. เตรียมพิจารณาสิ้นสุดนโยบายการเงินแบบผ่อนคลายเป็นพิเศษ และเตรียมพิจารณาช่วงเวลาที่เหมาะสมในการทยอยปรับขึ้นอัตราดอกเบี้ยนโยบายในระยะถัดไป ธปท. คาดเศรษฐกิจไทยในปี 2565 และ 2566 ขยายตัวที่ 3.3% และ 4.2% ตามลำดับ จากเดิมที่คาดว่าจะขยายตัวได้ 3.2% และ 4.4% ตามลำดับ เนื่องจากการบริโภคเอกชนฟื้นตัวดีกว่าคาด โดยเฉพาะในหมวดบริการที่ได้รับผลบวกจากการกลับมาของนักท่องเที่ยวต่างชาติ ภายหลังจากเปิดประเทศ โดย ธปท.คาดการณ์จำนวนนักท่องเที่ยวในปีเพิ่มขึ้นเป็น 6 ล้านคน จาก 5.6 ล้านคน ในขณะที่ประเมินว่าความเสี่ยงจากโควิด-19 และสงครามรัสเซียยูเครนมีผลต่อเศรษฐกิจไทยในวงจำกัด และเพิ่มคาดการณ์เงินเฟ้อในปี 2565 และ 2566 มาอยู่ที่ 6.2% และ 2.5% ตามลำดับ จากเดิมที่ 4.9% และ 1.7% ตามลำดับ ทางด้านความเคลื่อนไหวของตลาดตราสารหนี้ไทยในรอบบัญชี เส้นอัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลไทยมีแนวโน้มปรับสูงขึ้นมาตลอด ตามทิศทางตลาดพันธบัตรสหรัฐและความกังวลด้านเงินเฟ้อ โดยเฉพาะอย่างยิ่งตั้งแต่เดือนมีนาคมเป็นต้นมา การซื้อขายของนักลงทุนต่างชาติเปลี่ยนมาเป็นการขายสุทธิในช่วงเดือนมีนาคม เมษายน และมิถุนายน ทำให้เส้นอัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลไทย ณ สิ้นเดือนพฤษภาคมปรับเพิ่มขึ้นจากสิ้นปี 2564 ตลอดทั้งเส้น โดยเฉพาะพันธบัตรที่มีอายุมากกว่า 2 ปีขึ้นไป อัตราผลตอบแทนได้ปรับเพิ่มขึ้น 86 ถึง 150bps

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	0.12	0.07	0.14	0.27	0.59	0.83	N/A	0.87
Benchmark ²	0.21	0.13	0.26	0.51	0.87	1.06	N/A	1.09
ความผันผวนของผลการดำเนินงาน	0.01	0.01	0.01	0.01	0.04	0.05	N/A	0.05
ความผันผวนของ Benchmark ²	0.04	0.04	0.03	0.03	0.07	0.07	N/A	0.07

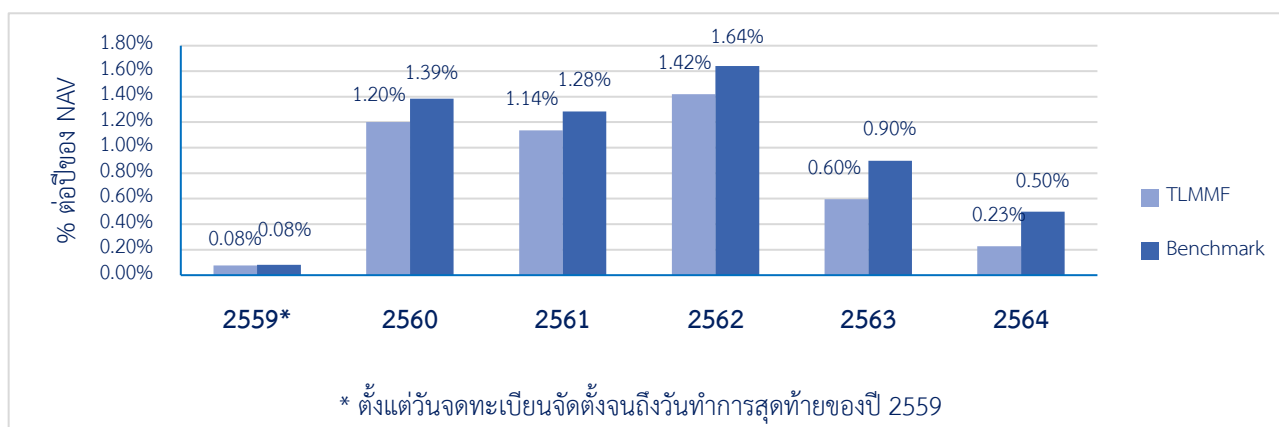
หมายเหตุ: ¹ เป็นข้อมูล ณ วันที่ 31 พฤษภาคม 2565 คุณสามารถดูข้อมูลที่เป็นปัจจุบันได้ที่ www.talisam.co.th

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 20 มิถุนายน 2565

เรียน ผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุนกองทุนเปิดทาลิส ตลาดเงิน

ธนาคารกรุงเทพ จำกัด (มหาชน) ในฐานะผู้ดูแลผลประโยชน์ ได้ดูแลการจัดการ กองทุนเปิดทาลิส ตลาดเงิน ซึ่งจัดการโดยบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ทาลิส จำกัด สำหรับระยะเวลาตั้งแต่วันที่ 1 ธันวาคม 2564 ถึงวันที่ 31 พฤษภาคม 2565 แล้ว

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



(วิเชียร ชื่นชมแสง)

ธนาคารกรุงเทพ จำกัด (มหาชน)

ในฐานะผู้ดูแลผลประโยชน์

งบแสดงฐานะทางการเงิน*
ณ วันที่ 31 พฤษภาคม 2565

	บาท
สินทรัพย์	
เงินลงทุนแสดงด้วยมูลค่ายุติธรรม (ราคาทุน 284,973,735.91 บาท)	284,972,903.95
เงินสดและเงินฝากธนาคาร	4,543,589.63
ลูกหนี้จากการลงทุน	
จากเงินปันผลและดอกเบีย	84,362.95
รวมสินทรัพย์	289,600,856.53
หนี้สิน	
เจ้าหนี้จากการลงทุน	
จากการซื้อเงินลงทุน	15,087,962.73
ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย	
ค่าธรรมเนียมการจัดการค้างจ่าย	18,517.77
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ค้างจ่าย	7,283.65
ค่าธรรมเนียมทะเบียนค้างจ่าย	17,283.29
ภาษีเงินได้ค้างจ่าย	1,187.25
หนี้สินอื่น	1,186.93
รวมหนี้สิน	15,133,421.62
สินทรัพย์สุทธิ	274,467,434.91
สินทรัพย์สุทธิ:	
ทุนที่ได้รับจากผู้ถือหุ้นลงทุน	261,732,459.06
กำไร (ขาดทุน) สะสม	
บัญชีปรับสมดุล	(7,450,225.46)
กำไร (ขาดทุน) สะสมจากการดำเนินงาน	20,185,201.31
สินทรัพย์สุทธิ	274,467,434.91
มูลค่าสินทรัพย์สุทธิต่อหน่วย	10.4865
จำนวนหน่วยลงทุนที่จำหน่ายแล้วทั้งหมด (หน่วย)	26,173,245.9059

หมายเหตุ : * งบการเงินนี้ยังไม่ได้ผ่านการสอบทานหรือรับรองจากผู้สอบบัญชี

งบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน*
ณ วันที่ 31 พฤษภาคม 2565

การแสดงรายละเอียดเงินลงทุนที่ใช้การจัดกลุ่มตามประเภทของเงินลงทุน

ชื่อหลักทรัพย์	วันครบอายุ	อัตราดอกเบี้ย (%)	เงินต้น (บาท)	มูลค่ายุติธรรม (บาท)	ร้อยละของมูลค่าเงินลงทุน
เงินฝากประจำ					
ธนาคารอาคารสงเคราะห์	21 เมษายน 2566	0.75	9,000,000	9,000,000.00	3.16
ธนาคารอาคารสงเคราะห์	21 เมษายน 2566	0.75	5,000,000	5,000,000.00	1.75
ธนาคารอาคารสงเคราะห์	6 มกราคม 2566	0.70	10,000,000	10,000,000.00	3.51
ธนาคารอาคารสงเคราะห์	25 พฤศจิกายน 2566	0.70	11,500,000	11,500,000.00	4.04
รวมเงินฝากประจำ				35,500,000.00	12.46
ธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 6/363/64	2 มิถุนายน 2565		4,000,000	3,999,951.80	1.40
ธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 19/91/65	11 สิงหาคม 2565		3,300,000	3,297,113.89	1.16
ธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 15/87/65	14 กรกฎาคม 2565		19,000,000	18,989,485.59	6.66
ธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 13/91/65	30 มิถุนายน 2565		26,000,000	25,990,215.16	9.12
ธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 10/91/65	9 มิถุนายน 2565		19,000,000	18,998,209.44	6.67
ธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 21/91/65	25 สิงหาคม 2565		10,000,000	9,991,158.50	3.51
ธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 20/91/65	18 สิงหาคม 2565		28,500,000	28,471,403.67	9.99
ธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 17/95/65	1 สิงหาคม 2565		13,500,000	13,488,728.58	4.73
ธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 12/91/65	23 มิถุนายน 2565		19,000,000	18,994,390.06	6.67
ธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 11/91/65	16 มิถุนายน 2565		25,000,000	24,995,069.50	8.77
ธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 22/91/65	1 กันยายน 2565		15,100,000	15,087,962.73	5.29
ธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 18/91/65	4 สิงหาคม 2565		10,000,000	9,991,958.30	3.51
ธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 16/91/65	21 กรกฎาคม 2565		11,200,000	11,193,023.52	3.93
ธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 14/91/65	7 กรกฎาคม 2565		33,000,000	32,984,384.40	11.57
ธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 9/91/65	2 มิถุนายน 2565		13,000,000	12,999,848.81	4.56
รวมพันธบัตร				249,472,903.95	87.54
รวมเงินลงทุน (ราคาทุน 284,973,735.91 บาท)				284,972,903.95	100.00

หมายเหตุ : * งบการเงินนี้ยังไม่ได้ผ่านการสอบทานหรือรับรองจากผู้สอบบัญชี

งบกำไรขาดทุน*
รอบระยะเวลาตั้งแต่วันที่ 1 ธันวาคม 2564 ถึงวันที่ 31 พฤษภาคม 2565

	บาท
รายได้	
รายได้ดอกเบี้ย	658,880.36
รวมรายได้	658,880.36
ค่าใช้จ่าย	
ค่าธรรมเนียมการจัดการ	112,966.47
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์	44,433.49
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน	105,435.49
ค่าใช้จ่ายอื่น	537.05
รวมค่าใช้จ่าย	263,372.50
รายได้ (ขาดทุน) สุทธิ	395,507.86
รายการกำไร (ขาดทุน) สุทธิจากเงินลงทุน	
รายการกำไร (ขาดทุน) สุทธิที่เกิดขึ้นจากเงินลงทุน	6,356.32
รายการกำไร (ขาดทุน) สุทธิที่ยังไม่เกิดขึ้นทั้งสิ้น	(951.63)
รวมรายการกำไร (ขาดทุน) สุทธิจากเงินลงทุนที่เกิดขึ้นและที่ยังไม่เกิดขึ้น	5,404.69
การเพิ่มขึ้น (ลดลง) ในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงานก่อนภาษีเงินได้	400,912.55
หัก ภาษีเงินได้	(3,806.00)
การเพิ่มขึ้น (ลดลง) ในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงานหลังหักภาษีเงินได้	397,106.55

หมายเหตุ : * งบการเงินนี้ยังไม่ได้ผ่านการสอบทานหรือรับรองจากผู้สอบบัญชี

รายละเอียดการลงทุน การกู้ยืมเงินและการก่อภาระผูกพัน

ข้อมูล ณ วันที่ 31 พฤษภาคม 2565

รายละเอียดการลงทุน	อันดับความน่าเชื่อถือ		มูลค่ายุติธรรม	%NAV
	ของตราสาร	ผู้ออก/ค้ำประกัน		
หลักทรัพย์หรือทรัพย์สินในประเทศ			289,600,856.53	105.51
เงินฝากธนาคาร				
ธนาคาร				
เงินฝากธนาคารกรุงเทพ จำกัด (มหาชน)		AA+(tha)	4,547,395.05	1.66
ตราสารหนี้				
เงินฝากธนาคาร				
ธนาคาร				
ใบรับเงินฝากประจำ 12 เดือนของธนาคารอาคารสงเคราะห์		AAA(thai)	11,541,242.45	4.20
ใบรับเงินฝากประจำ 12 เดือนของธนาคารอาคารสงเคราะห์		AAA(thai)	10,027,808.20	3.65
ใบรับเงินฝากประจำ 12 เดือนของธนาคารอาคารสงเคราะห์		AAA(thai)	9,007,397.28	3.28
ใบรับเงินฝากประจำ 12 เดือนของธนาคารอาคารสงเคราะห์		AAA(thai)	5,004,109.60	1.82
พันธบัตร				
รัฐบาล				
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 10/91/65			18,998,209.44	6.92
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 11/91/65			24,995,069.50	9.11
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 12/91/65			18,994,390.06	6.92
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 13/91/65			25,990,215.16	9.47
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 14/91/65			32,984,384.40	12.02
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 15/87/65			18,989,485.59	6.92
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 16/91/65			11,193,023.52	4.08
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 17/95/65			13,488,728.58	4.91
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 18/91/65			9,991,958.30	3.64
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 19/91/65			3,297,113.89	1.20
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 20/91/65			28,471,403.67	10.37
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 21/91/65			9,991,158.50	3.64
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 22/91/65			15,087,962.73	5.50
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 6/363/64			3,999,951.80	1.46
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 9/91/65			12,999,848.81	4.74
สินทรัพย์อื่นหรือหนี้สินอื่น			(15,133,421.62)	(5.51)
มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ			274,467,434.91	100.00

รายงานสรุปเงินลงทุนในตราสารแห่งนี้ เงินฝาก หรือตราสารกึ่งหนี้กึ่งทุน

ข้อมูล ณ วันที่ 31 พฤษภาคม 2565

กลุ่มของตราสาร	มูลค่าตามราคาตลาด	%NAV
(ก) ตราสารภาครัฐ ได้แก่ ตัวแลกเงิน พันธบัตรรัฐบาล พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย พันธบัตร หรือ ตราสารแห่งหนึ่งที่ลงทุนเพื่อการฟื้นฟูและพัฒนา	249,472,903.95	90.89
(ข) ตราสารที่ธนาคารที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้น ธนาคารพาณิชย์ หรือบริษัทเงินทุนเป็นผู้ออก ผู้รับรอง ผู้รับอวัล ผู้สลักหลัง หรือผู้ค้ำประกัน	40,127,952.58	14.62
(ค) ตราสารที่มีบริษัทที่ได้รับ rating ในระดับ investment grade เป็นผู้ออก ผู้รับรอง ผู้รับอวัล ผู้สลักหลัง หรือผู้ค้ำประกัน	-	-
(ง) ตราสารที่มีอันดับความน่าเชื่อถืออยู่ในอันดับต่ำกว่าอันดับที่สามารถลงทุนได้ (investment grade) หรือตราสารที่ไม่ได้จัดอันดับความน่าเชื่อถือ	-	-

รายละเอียดตัวตราสารและอันดับความน่าเชื่อถือของตราสารแห่งนี้ เงินฝาก หรือตราสารกึ่งหนี้กึ่งทุนที่ลงทุนลงหรือมีไว้เป็นรายตัว

ประเภท	ผู้ออก	วันครบกำหนด	อันดับความน่าเชื่อถือ		มูลค่าที่ตราไว้	มูลค่ายุติธรรม
			ตราสาร	ผู้ออก/ค้ำประกัน		
เงินฝากธนาคาร	ธนาคารกรุงเทพ จำกัด (มหาชน)			AA+(tha)	-	4,547,395.05
เงินฝากธนาคาร	ธนาคารอาคารสงเคราะห์	21 เมษายน 2566		AAA(thai)	-	9,007,397.28
เงินฝากธนาคาร	ธนาคารอาคารสงเคราะห์	25 พฤศจิกายน 2565		AAA(thai)	-	11,541,242.45
เงินฝากธนาคาร	ธนาคารอาคารสงเคราะห์	6 มกราคม 2566		AAA(thai)	-	10,027,808.20
เงินฝากธนาคาร	ธนาคารอาคารสงเคราะห์	21 เมษายน 2566		AAA(thai)	-	5,004,109.60
พันธบัตร	ธนาคารแห่งประเทศไทย	1 กันยายน 2565			15,100,000.00	15,087,962.73
พันธบัตร	ธนาคารแห่งประเทศไทย	2 มิถุนายน 2565			13,000,000.00	12,999,848.81
พันธบัตร	ธนาคารแห่งประเทศไทย	9 มิถุนายน 2565			19,000,000.00	18,998,209.44
พันธบัตร	ธนาคารแห่งประเทศไทย	16 มิถุนายน 2565			25,000,000.00	24,995,069.50
พันธบัตร	ธนาคารแห่งประเทศไทย	23 มิถุนายน 2565			19,000,000.00	18,994,390.06
พันธบัตร	ธนาคารแห่งประเทศไทย	30 มิถุนายน 2565			26,000,000.00	25,990,215.16
พันธบัตร	ธนาคารแห่งประเทศไทย	7 กรกฎาคม 2565			33,000,000.00	32,984,384.40
พันธบัตร	ธนาคารแห่งประเทศไทย	14 กรกฎาคม 2565			19,000,000.00	18,989,485.59
พันธบัตร	ธนาคารแห่งประเทศไทย	21 กรกฎาคม 2565			11,200,000.00	11,193,023.52
พันธบัตร	ธนาคารแห่งประเทศไทย	1 สิงหาคม 2565			13,500,000.00	13,488,728.58
พันธบัตร	ธนาคารแห่งประเทศไทย	4 สิงหาคม 2565			10,000,000.00	9,991,958.30
พันธบัตร	ธนาคารแห่งประเทศไทย	11 สิงหาคม 2565			3,300,000.00	3,297,113.89
พันธบัตร	ธนาคารแห่งประเทศไทย	2 มิถุนายน 2565			4,000,000.00	3,999,951.80
พันธบัตร	ธนาคารแห่งประเทศไทย	18 สิงหาคม 2565			28,500,000.00	28,471,403.67
พันธบัตร	ธนาคารแห่งประเทศไทย	25 สิงหาคม 2565			10,000,000.00	9,991,158.50

สัดส่วนเงินลงทุนขั้นสูงต่อมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุนที่บริษัทจัดการตั้งไว้ในแผนการลงทุนสำหรับกลุ่มตราสารตาม (ง) เท่ากับ 0% NAV

คำอธิบายการจัดอันดับความน่าเชื่อถือของสถาบันจัดอันดับความน่าเชื่อถือ

บริษัท ฟิทช์ 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 ภายใต้ระบบการจัดอันดับเครดิตภายในประเทศซึ่งกำหนดโดยฟิทช์ 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 2564 ถึง 31 พฤษภาคม 2565

ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม * (Fund's Direct Expenses)	จำนวนเงิน หน่วย : พันบาท	ร้อยละของ มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ
ค่าธรรมเนียมการจัดการ (Management Fee)	112.97	0.04
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ (Trustee Fee)	44.43	0.02
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียนหน่วย (Registrar Fee)	105.44	0.04
ค่าใช้จ่ายอื่นๆ (Other Expenses)	0.54	0.00
รวมค่าใช้จ่ายทั้งหมด (Total Fund's Direct Expenses)**	263.38	0.10

* ค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายที่หักจากกองทุนรวมได้รวมภาษีมูลค่าเพิ่มแล้ว

** ไม่รวมค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์และค่าธรรมเนียมต่างๆ ที่เกิดขึ้นจากการซื้อขายหลักทรัพย์และภาษีเงินได้จากการลงทุนในตราสารหนี้

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุนของกองทุน (Portfolio Turnover Ratio : “PTR”)

สำหรับระยะเวลา 6 เดือน ตั้งแต่วันที่ 1 ธันวาคม 2564 ถึง 31 พฤษภาคม 2565

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

$$\text{PTR} = \frac{70,969,459.72}{282,249,858.39}$$

$$\text{PTR} = 0.25$$

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

รายงานชื่อบุคคลที่เกี่ยวข้องที่กองทุนเข้าทำธุรกรรม

กองทุนเปิดทาลิส ตลาดเงิน ไม่มีรายการทำธุรกรรมกับบุคคลที่เกี่ยวข้อง ข้อมูลระหว่างวันที่ 1 ธันวาคม 2564 ถึง 31 พฤษภาคม 2565

รายงานการถือหน่วยลงทุนเกินข้อจำกัดการใช้สิทธิออกเสียง

กองทุนเปิดทาลิส ตลาดเงิน ไม่มีการถือหน่วยลงทุนเกิน 1 ใน 3 โดยบุคคลใดบุคคลหนึ่ง ข้อมูล ณ วันที่ 31 พฤษภาคม 2565

ผู้ลงทุนสามารถตรวจสอบรายละเอียดการทำธุรกรรมกับบุคคลที่เกี่ยวข้องกับกองทุนรวมและรายงานการถือหน่วยลงทุนเกินข้อจำกัดการใช้สิทธิออกเสียงได้ที่ บริษัทจัดการโดยตรง 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