



กองทุนเปิดทาลิส ตลาดเงิน
TALIS MONEY MARKET FUND (TLMMF)

รายงานรอบระยะเวลา 6 เดือน

รอบระยะเวลาดังตั้งแต่วันที่ 1 ธันวาคม 2565 ถึง 31 พฤษภาคม 2566

รายงานรอบระยะเวลา 6 เดือน

ตั้งแต่วันที่ 1 ธันวาคม 2565 ถึง 31 พฤษภาคม 2566

กองทุนเปิดทาลิส ตลาดเงิน (TLMMF)

นโยบายการลงทุน	1
สารสนเทศจากบริษัทจัดการ	2
รายงานการวิเคราะห์ของบริษัทจัดการ	3
ผลการดำเนินงานของกองทุนรวม	5
ความเห็นของผู้ดูแลผลประโยชน์	7
งบแสดงฐานะทางการเงิน	8
งบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน	10
งบกำไรขาดทุน	9
รายละเอียดการลงทุน การกู้ยืมเงินและการก่อภาระผูกพัน	12
รายงานสรุปเงินลงทุนในตราสารแห่งหนี้ เงินฝาก หรือตราสารกึ่งหนี้กึ่งทุน	13
คำอธิบายการจัดอันดับความน่าเชื่อถือของสถาบันจัดอันดับความน่าเชื่อถือ	14
แบบแสดงค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม	16
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุนกองทุนรวม	17
รายงานข้อมูลบุคคลที่เกี่ยวข้องที่กองทุนเข้าทำธุรกรรม	18
รายงานการถือหน่วยลงทุนเกินข้อจำกัดการใช้สิทธิออกเสียง	18

กองทุนเปิดทาลิส ตลาดเงิน (TLMMF)

TALIS MONEY MARKET FUND: TLMMF

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

กองทุนอาจลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้าโดยมีวัตถุประสงค์เฉพาะเพื่อลดความเสี่ยง (Hedging) และกองทุนอาจทำธุรกรรมการให้ยืมหลักทรัพย์โดยหลักทรัพย์ที่ห้ามเป็นตราสารหนี้ หรือธุรกรรมการซื้อโดยมีสัญญาขายคืน (Reverse Repo) โดยเป็นไปตามหลักเกณฑ์ที่สำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ต. กำหนด

กองทุนเปิดทาลิส ตลาดเงิน จะลงทุนในทรัพย์สินหรือถือครองทรัพย์สินที่มีสภาพคล่องสูง ในขณะใด ๆ รวมกันไม่น้อยกว่าร้อยละ 10 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน และกองทุนจะดำรงอายุถัวเฉลี่ยแบบถ่วงน้ำหนักของตราสารทั้งหมดของกองทุน (portfolio duration) ณ ขณะใดขณะหนึ่งไม่เกิน 92 วัน รวมถึงตราสารหนี้ที่กองทุนได้ลงทุนไว้จะต้องมีกำหนดวันชำระหนี้ไม่เกินกว่า 397 วันนับแต่วันที่กองทุนได้ลงทุน และตราสารหนี้ดังกล่าวต้องไม่เป็นหุ้นกู้ด้อยสิทธิ หรือตราสารหนี้อื่นที่มีลักษณะด้อยสิทธิในทำนองเดียวกับหุ้นกู้ด้อยสิทธิ นอกจากนี้ตราสารหนี้ที่ไม่รวมตราสารภาครัฐไทย หรือเงินฝากหรือตราสารเทียบเท่าเงินฝากที่ไม่รวมกรณีที่ถูกออกหรือค้ำสัญญาเป็นธนาคารออมสิน หรือธุรกรรมการซื้อโดยมีสัญญาขายคืน (reverse repo) หรือธุรกรรม การให้ยืมหลักทรัพย์ หรือสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่กองทุนเข้าลงทุนจะต้องมี credit rating อย่างใดอย่างหนึ่งแล้วแต่กรณี 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 กองทุนอาจลงทุนในตราสารแห่งหนึ่ง ตราสารกึ่งหนึ่งกึ่งทุน 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 29 มิถุนายน 2566

เรียน ท่านผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุน

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ทาลิส จำกัด (บริษัทฯ) ขอนำเสนอรายงานผลการดำเนินงานสำหรับรอบระยะเวลา 6 เดือน (1 ธันวาคม 2565 – 31 พฤษภาคม 2566) ของกองทุนเปิดทาลิส ตลาดเงิน มายังผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุนทุกท่าน

เศรษฐกิจไทยในปี 2566 คาดว่าจะขยายตัวในช่วง 2.7%-3.7% โดยมีปัจจัยสนับสนุนจากการฟื้นตัวของภาคการท่องเที่ยว การขยายตัวในเกณฑ์ดีของการอุปโภคบริโภคภาคเอกชน และการขยายตัวต่อเนื่องของการลงทุนทางด้านนโยบายการเงินของไทยใน 5 เดือนแรกของปี 2566 อัตราดอกเบี้ยนโยบายปรับเพิ่มขึ้นเป็น 2% ต่อปี โดย กนง. ประเมินว่าเศรษฐกิจไทยมีแนวโน้มฟื้นตัวต่อเนื่อง จากจำนวนนักท่องเที่ยวต่างชาติที่เพิ่มขึ้น รวมทั้งการฟื้นตัวของการบริโภคภาคเอกชน ตามการปรับตัวดีขึ้นของการจ้างงานและรายได้ภาคแรงงาน ขณะที่ภาคการส่งออกคาดว่าจะฟื้นตัวชัดเจนในช่วงครึ่งหลังของปี อย่างไรก็ตาม ภาวะเศรษฐกิจไทยยังมีความเสี่ยงจากความไม่แน่นอนของเศรษฐกิจโลกที่อัตราเงินเฟ้อยังอยู่ในระดับสูง และปัญหาสถาบันการเงินในประเทศเศรษฐกิจหลัก ส่วนอัตราเงินเฟ้อทั่วไปของไทยมีแนวโน้มเข้าสู่กรอบเป้าหมายได้ในช่วงกลางปี 2566 แต่อัตราเงินเฟ้อพื้นฐานยังทรงตัวในระดับสูงจากการส่งผ่านต้นทุน ทั้งนี้ การดำเนินนโยบายการเงินของไทย สอดคล้องกับประเทศในภูมิภาคและประเทศเศรษฐกิจหลัก

กองทุนเปิดทาลิส ตลาดเงิน เน้นลงทุนในตราสารหนี้ระยะสั้น อัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในแต่ละวันมีความสม่ำเสมอ มีความผันผวนต่ำ ณ วันที่ 31 พฤษภาคม 2566 มีมูลค่าทรัพย์สินสุทธิ 254,769,028.57 บาท มูลค่าหน่วยลงทุน 10.5574 บาท อัตราผลตอบแทนในรอบ 6 เดือน 0.97% ต่อปี และอัตราผลตอบแทนนับตั้งแต่จัดตั้งกองทุน 0.86% ต่อปี

บริษัทฯ ขอขอบพระคุณท่านผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุนทุกท่านที่เชื่อมั่นและให้ความไว้วางใจ บริษัทฯ จะบริหารการลงทุนด้วยความรอบคอบและระมัดระวัง ภายใต้กฎระเบียบต่าง ๆ และจรรยาบรรณวิชาชีพ เพื่อผลประโยชน์สูงสุดของท่านผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุนทุกท่านเป็นสำคัญ

ขอแสดงความนับถือ

คณะผู้จัดการกองทุน

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ทาลิส จำกัด

รายงานการวิเคราะห์ของบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ทาลิส จำกัด ในฐานะบริษัทจัดการ กองทุนเปิดทาลิส ตลาดเงิน

ภาวะเศรษฐกิจ

เศรษฐกิจไทยในไตรมาสแรกของปี 2566 ขยายตัว 2.7% เติบโตจากการขยายตัว 1.4% ในไตรมาสที่สี่ของปี 2565 ด้านการใช้จ่าย การส่งออกบริการและการอุปโภคบริโภคภาคเอกชนขยายตัวในเกณฑ์สูง การลงทุนภาครัฐและการลงทุนภาคเอกชนขยายตัวต่อเนื่อง ขณะที่การส่งออกสินค้าและการใช้จ่ายเพื่อการอุปโภคบริโภคของรัฐบาลปรับตัวลดลง ด้านการผลิต สาขาที่พักแรมและบริการด้านอาหาร สาขาขนส่งและสถานที่เก็บสินค้า สาขาการขนส่ง การขายปลีก และการซ่อมแซมฯ สาขาการก่อสร้าง และสาขาเกษตรกรรมขยายตัวเพิ่มขึ้น ส่วนสาขาการผลิตสินค้าอุตสาหกรรม และสาขาไฟฟ้าและก๊าซฯ ปรับตัวลดลง เมื่อปรับผลของฤดูกาลออกแล้ว เศรษฐกิจไทยในไตรมาสที่หนึ่งของปี 2566 ขยายตัวจากไตรมาสที่สี่ของปี 2565 ได้ 1.9% (QoQ_SA)

สำนักงานสภาพัฒนาการเศรษฐกิจและสังคมแห่งชาติ คาดแนวโน้มเศรษฐกิจไทยปี 2566 จะขยายตัวในช่วง 2.7-3.7% โดยมีปัจจัยสนับสนุนจากการฟื้นตัวของภาคการท่องเที่ยว การขยายตัวในเกณฑ์ดีของการอุปโภคบริโภคภาคเอกชน และการขยายตัวต่อเนื่องของการลงทุน โดยคาดว่าจะการอุปโภคบริโภคภาคเอกชนจะขยายตัว 3.7% ส่วนการลงทุนภาคเอกชนและภาครัฐขยายตัว 1.9% และ 2.7% ตามลำดับ ขณะที่มูลค่าการส่งออกสินค้าในรูปเงินดอลลาร์ สหรัฐ ลดลง 1.6% อัตราเงินเฟ้อทั่วไปเฉลี่ยอยู่ในช่วง 2.5%-3.5% และดุลบัญชีเดินสะพัดเกินดุล 1.4% ของ GDP

ภาวะตลาดการเงินและตราสารหนี้

การประชุม FOMC ปี 2565 ได้มีการปรับเพิ่มอัตราดอกเบี้ยนโยบายอย่างต่อเนื่อง และได้มีมติขึ้นดอกเบี้ย 75bps ต่อเนื่องกันถึง 4 ครั้ง และ 50bps ในการประชุมครั้งสุดท้ายของปี เพื่อให้เงินเฟ้อกลับเข้าสู่ระดับเป้าหมายที่ 2% และดำเนินการลดงบดุลต่อเนื่องตามแผนเดิม ต่อเนื่องมาจนถึงปี 2566 FED ยังคงปรับขึ้นอัตราดอกเบี้ยนโยบายแต่ในอัตราที่ลดลง โดยในเดือนพฤษภาคม 2566 มีมติเอกฉันท์ขึ้นดอกเบี้ย 25bps ทำให้อัตราดอกเบี้ยนโยบายอยู่ที่ 5.00%-5.25% สูงสุดนับตั้งแต่ปี 2550 ต่อมาในเดือนมิถุนายนมีมติเอกฉันท์คงอัตราดอกเบี้ยนโยบายไว้ เนื่องจากต้องใช้เวลาในการพิจารณาความเหมาะสมของการเพิ่มการตีตัวของนโยบาย จากค่ากลางของ Dot Plot ได้ปรับมุมมองอัตราดอกเบี้ยในปีเพิ่มขึ้นจาก 5.1% ในการประชุมเดือนมีนาคม ไปอยู่ที่ 5.6% แถลงการณ์ของ FED กล่าวว่าระบบธนาคารสหรัฐฯ ยังคงมีความแข็งแกร่ง และมีความยืดหยุ่น ความตึงตัวด้านสินเชื่อของภาคธุรกิจและภาคครัวเรือนมีผลกระทบต่อกิจกรรมทางเศรษฐกิจ การจ้างงาน และเงินเฟ้อ อย่างไรก็ตาม ผลกระทบยังมีความไม่แน่นอนสูง ทางด้านเศรษฐกิจ FED ประเมินเศรษฐกิจขยายตัวได้ต่อเนื่อง เงินเฟ้อยังคงอยู่ในระดับสูงกว่า

เป้าหมาย และผลกระทบของดอกเบี้ยที่สูงส่งผลต่อกิจกรรมตลาดบ้าน และการลงทุน ด้านตลาดแรงงาน อัตราการว่างงานยังอยู่ในระดับต่ำ และการจ้างงานยังคงขยายตัวดี โดยมีสัญญาณบ่งชี้ว่าอุปสงค์และอุปทานในตลาดแรงงานกำลังกลับสู่สมดุลที่ดีขึ้น อย่างไรก็ดี อุปสงค์ยังคงมากกว่าอุปทานค่อนข้างมาก โดย FED คาดการณ์ปีนี้เศรษฐกิจขยายตัวเพิ่มขึ้นจากที่ประเมินไว้ในเดือนมีนาคมที่ 0.4% มาอยู่ที่ 1% และ อัตราการว่างงานปีนี้จะลดลงจาก 4.5% ไปอยู่ที่ 4.1%

ทางด้านการประชุมคณะกรรมการนโยบายการเงินของไทยในปี 2565 มีการปรับอัตราดอกเบี้ยนโยบาย 3 ครั้ง ครั้งละ 25bps และขึ้นดอกเบี้ยต่อเนื่องอีก 3 ครั้งในปี 2566 ทำให้อัตราดอกเบี้ยนโยบาย ณ สิ้นเดือนพฤษภาคม อยู่ที่ 2.00% โดยคณะกรรมการฯ เห็นว่าภาวะการเงินโดยรวมผ่อนคลายลง จากต้นทุนการกู้ยืมของภาคเอกชนที่ปรับสูงขึ้นสอดคล้องกับอัตราดอกเบี้ยนโยบาย แต่ยังไม่เป็นอุปสรรคต่อการระดมทุนของภาคเอกชนและการฟื้นตัวของเศรษฐกิจ เศรษฐกิจไทยมีแนวโน้มขยายตัวได้ต่อเนื่องที่ 3.6% และ 3.8% ในปี 2566 และ 2567 ตามลำดับ จากจำนวนนักท่องเที่ยวต่างชาติที่เพิ่มขึ้นต่อเนื่อง ซึ่งส่งผลบวกต่อการจ้างงานและรายได้แรงงาน และเป็นแรงส่งต่อเนื่องไปยังการบริโภคภาคเอกชน ด้านการส่งออกทยอยฟื้นตัวใกล้เคียงกับที่ประเมินไว้และคาดว่าจะขยายตัวดีขึ้นในระยะต่อไป สอดคล้องกับแนวโน้มเศรษฐกิจโลกที่แม้จะชะลอตัวบ้างแต่ยังมีทิศทางขยายตัว อัตราเงินเฟ้อมีแนวโน้มทยอยปรับลดลง โดยอัตราเงินเฟ้อทั่วไปปรับลดลงกลับเข้าสู่กรอบเป้าหมายและคาดว่าจะอยู่ที่ 2.5% และ 2.4% ในปี 2566 และ 2567 ตามลำดับ จากแรงกดดันจากค่าไฟฟ้าและราคาน้ำมันที่ทยอยคลี่คลาย ขณะที่อัตราเงินเฟ้อพื้นฐานคาดว่าจะทรงตัวอยู่ที่ 2.0% ในปี 2566 และ 2567 ซึ่งอยู่ในระดับสูงเมื่อเทียบกับอดีต

ทางด้านความเคลื่อนไหวของตลาดตราสารหนี้ไทย ตลอดปี 2565 เส้นอัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลไทยปรับขึ้นมาตลอด อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลระยะสั้นปรับเพิ่มขึ้นตามทิศทางการปรับขึ้นอัตราดอกเบี้ยนโยบาย ส่วนอัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลระยะยาวปรับเพิ่มขึ้นตามทิศทางตลาดพันธบัตรสหรัฐและความกังวลด้านเงินเฟ้อ ต่อมาในปี 2566 อัตราผลตอบแทนพันธบัตรสหรัฐฯ ระยะสั้นยังคงเพิ่มขึ้นตามทิศทางอัตราดอกเบี้ยนโยบาย ในขณะที่อัตราผลตอบแทนพันธบัตรสหรัฐฯ ระยะยาวมีความผันผวนตามมุมมองของนักลงทุนถึงการคาดการณ์เศรษฐกิจในระยะยาวที่ได้รับผลกระทบจากปัจจัยต่าง ๆ ตลอดจนการตีความจากการให้สัมภาษณ์ของกรรมการ FED ซึ่งอัตราผลตอบแทนของตลาดตราสารหนี้ไทยก็มีแนวโน้มเคลื่อนไหวในทิศทางเดียวกันกับตลาดพันธบัตรสหรัฐฯ ด้านปริมาณการซื้อขายพันธบัตรรัฐบาลไทยของนักลงทุนต่างชาติ ณ สิ้นเดือนพฤษภาคม 2566 ถือครองอยู่ที่ 1.04 ล้านล้านบาท หรือลดลง 4.3 หมื่นล้านบาทจากปีก่อนหน้า

ผลการดำเนินงานของกองทุนเปิดทาลิส ตลาดเงิน ชนิดสะสมมูลค่า (TLMMF-A)

ตารางแสดงผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปึกหมุด

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-A	0.42	0.29	0.48	0.68	0.42	0.74	N/A	0.84
Benchmark ²	0.44	0.32	0.54	0.82	0.64	0.97	N/A	1.05
ความผันผวนของผล การดำเนินงาน	0.06	0.06	0.05	0.05	0.03	0.05	N/A	0.05
ความผันผวนของ Benchmark ²	0.08	0.08	0.08	0.07	0.05	0.07	N/A	0.07

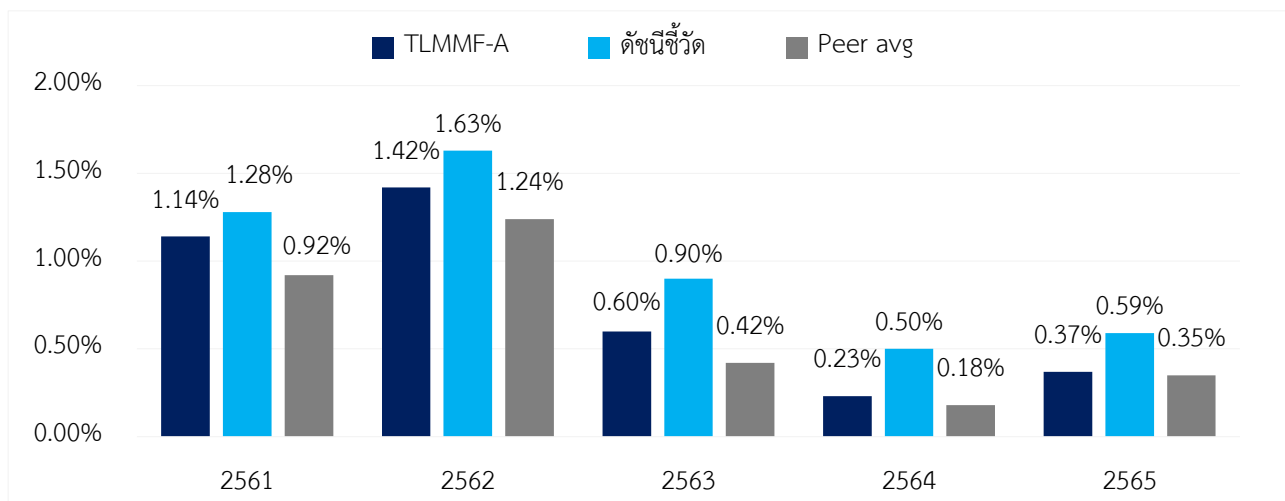
หมายเหตุ: ¹ เป็นข้อมูล ณ วันที่ 31 พฤษภาคม 2566 คุณสามารถดูข้อมูลที่เป็นปัจจุบันได้ที่ www.talisam.co.th

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

ผลการดำเนินงานของกองทุนเปิดทาลิส ตลาดเงิน

ชนิดเพื่อการออม (TLMMF-SSF)

ตารางแสดงผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปึกหมุด

ผลการดำเนินงานย้อนหลัง ¹								
กองทุน	% ตามช่วงเวลา			% ต่อปี				
	Year to date	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี	3 ปี	5 ปี	10 ปี	ตั้งแต่จัดตั้ง (1 พ.ย. 65)
TLMMF-SSF	0.39	0.28	0.45	N/A	N/A	N/A	N/A	0.50
Benchmark ²	0.44	0.32	0.54	N/A	N/A	N/A	N/A	0.61
ความผันผวนของผล การดำเนินงาน	0.05	0.05	0.05	N/A	N/A	N/A	N/A	0.05
ความผันผวนของ Benchmark ²	0.08	0.08	0.08	N/A	N/A	N/A	N/A	0.08

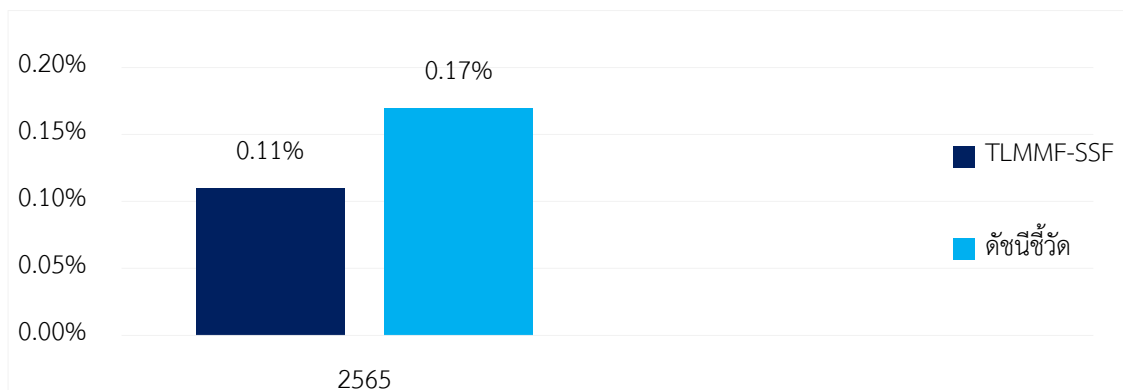
หมายเหตุ: ¹ เป็นข้อมูล ณ วันที่ 31 พฤษภาคม 2566 คุณสามารถดูข้อมูลที่เป็นปัจจุบันได้ที่ www.talisam.co.th

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



หมายเหตุ: ปีที่เริ่มต้นกองทุน ผลการดำเนินงานกองทุนและดัชนีชี้วัดจะแสดงตั้งแต่วันที่จัดทะเบียนถึงสิ้นปีปฏิทิน มีระยะเวลาไม่ถึง 1 ปี จึงไม่มีค่า Peer avg ในระยะเวลาดังกล่าว

ผลการดำเนินงานในอดีต / ผลการเปรียบเทียบผลการดำเนินงานที่เกี่ยวข้องกับผลิตภัณฑ์ในตลาดทุน มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมตลาดเงินไม่ใช่การฝากเงิน และมีความเสี่ยงจากการลงทุนซึ่งผู้ลงทุนอาจไม่ได้รับเงินลงทุนคืนเต็มจำนวน

เอกสารการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวมฉบับนี้ได้จัดทำขึ้นตามมาตรฐานการวัดและนำเสนอผลการดำเนินงานของกองทุนรวมของสมาคมบริษัทจัดการลงทุน

*คุณสามารถดูข้อมูลที่เป็นปัจจุบันได้ที่ www.talisam.co.th



ความเห็นของผู้ดูแลผลประโยชน์

วันที่ 20 มิถุนายน 2566

เรียน ผู้ถือหน่วยลงทุนกองทุนเปิดทาลิส ตลาดเงิน

ธนาคารกรุงเทพ จำกัด (มหาชน) ในฐานะผู้ดูแลผลประโยชน์ ได้ดูแลการจัดการกองทุนเปิดทาลิส ตลาดเงิน ซึ่งจัดการโดยบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ทาลิส จำกัด สำหรับระยะเวลาตั้งแต่วันที่ 1 ธันวาคม 2565 ถึงวันที่ 31 พฤษภาคม 2566 แล้ว

ธนาคารฯ เห็นว่าบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ทาลิส จำกัด ได้ปฏิบัติหน้าที่ในการจัดการกองทุนเปิดทาลิส ตลาดเงิน เหมาะสมตามสมควรแห่งวัตถุประสงค์ที่ได้กำหนดไว้ในโครงการและภายใต้พระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535

กท

(นางฤดี ลิ้มทอ)

ธนาคารกรุงเทพ จำกัด (มหาชน)

ในฐานะผู้ดูแลผลประโยชน์

งบแสดงฐานะทางการเงิน*

ณ วันที่ 31 พฤษภาคม 2566

	บาท
สินทรัพย์	
เงินลงทุนแสดงด้วยมูลค่ายุติธรรม (ราคาทุน 246,175,596.47 บาท)	246,175,930.47
เงินสดและเงินฝากธนาคาร	8,418,493.54
ลูกหนี้จากการลงทุน	
จากเงินปันผลและดอกเบี้ย	221,516.70
รวมสินทรัพย์	254,815,940.71
หนี้สิน	
ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย	
ค่าธรรมเนียมการจัดการค้างจ่าย	17,835.55
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ค้างจ่าย	7,015.27
ค่าธรรมเนียมทะเบียนค้างจ่าย	16,646.50
ภาษีเงินได้ค้างจ่าย	4,297.64
หนี้สินอื่น	1,117.18
รวมหนี้สิน	46,912.14
สินทรัพย์สุทธิ	254,769,028.57
สินทรัพย์สุทธิ:	
ทุนที่ได้รับจากผู้ถือหน่วยลงทุน	241,316,558.60
กำไร (ขาดทุน) สะสม	
บัญชีปรับสมดุล	(8,558,101.02)
กำไร (ขาดทุน) สะสมจากการดำเนินงาน	22,010,570.99
สินทรัพย์สุทธิ	254,769,028.57

สินทรัพย์สุทธิต่อหน่วยลงทุนที่คำนวณแยกตามประเภทผู้ถือหน่วยลงทุน มีดังนี้

<u>ชนิดหรือประเภทผู้ถือหน่วยลงทุน</u>	<u>ต่อหน่วย (บาท)</u>	<u>จำนวนหน่วยลงทุน (หน่วย)</u>
หน่วยลงทุนชนิดสะสมมูลค่า	10.5574	24,024,038.5603
หน่วยลงทุนชนิดเพื่อการออม	10.5546	107,617.2989
รวม		24,131,655.8592

หมายเหตุ : * งบการเงินนี้ยังไม่ได้ผ่านการสอบทานหรือรับรองจากผู้สอบบัญชี

งบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน*
ณ วันที่ 31 พฤษภาคม 2566

การแสดงรายละเอียดเงินลงทุนใช้การจัดกลุ่มตามประเภทของเงินลงทุน					
ชื่อหลักทรัพย์	วันครบอายุ	อัตราดอกเบี้ย (%)	เงินต้น (บาท)	มูลค่ายุติธรรม (บาท)	ร้อยละของมูลค่าเงินลงทุน
เงินฝากประจำ					
ธนาคารอาคารสงเคราะห์	19 เมษายน 2567	1.90	9,000,000	9,000,000.00	3.66
ธนาคารอาคารสงเคราะห์	5 มกราคม 2567	1.75	10,000,000	10,000,000.00	4.06
ธนาคารอาคารสงเคราะห์	24 พฤศจิกายน 2566	1.75	11,500,000	11,500,000.00	4.67
ธนาคารอาคารสงเคราะห์	5 มกราคม 2567	1.75	2,000,000	2,000,000.00	0.81
รวมเงินฝากประจำ				32,500,000.00	13.20
ธนาคารแห่งประเทศไทยวุดที่ 14/90/66	6 กรกฎาคม 2566		1,000,000	998,515.90	0.41
ธนาคารแห่งประเทศไทยวุดที่ 15/87/66	13 กรกฎาคม 2566		27,000,000	26,956,140.39	10.95
ธนาคารแห่งประเทศไทยวุดที่ 20/91/66	17 สิงหาคม 2566		28,200,000	28,095,684.25	11.41
ธนาคารแห่งประเทศไทยวุดที่ 19/91/66	10 สิงหาคม 2566		32,000,000	31,894,181.12	12.96
ธนาคารแห่งประเทศไทยวุดที่ 16/91/66	20 กรกฎาคม 2566		11,300,000	11,278,590.46	4.58
ธนาคารแห่งประเทศไทยวุดที่ 10/91/66	8 มิถุนายน 2566		11,800,000	11,796,742.14	4.79
ธนาคารแห่งประเทศไทยวุดที่ 18/87/66	3 สิงหาคม 2566		31,200,000	31,110,753.96	12.64
ธนาคารแห่งประเทศไทยวุดที่ 12/91/66	22 มิถุนายน 2566		23,000,000	22,981,356.66	9.34
ธนาคารแห่งประเทศไทยวุดที่ 9/91/66	1 มิถุนายน 2566		2,200,000	2,200,000.00	0.89
ธนาคารแห่งประเทศไทยวุดที่ 13/91/66	29 มิถุนายน 2566		22,500,000	22,477,067.33	9.13
ธนาคารแห่งประเทศไทยวุดที่ 11/91/66	15 มิถุนายน 2566		23,900,000	23,886,898.26	9.70
รวมพันธบัตร				213,675,930.47	86.80
รวมเงินลงทุน (ราคาทุน 246,175,596.47 บาท)				246,175,930.47	100.00

หมายเหตุ : * งบการเงินนี้ยังไม่ได้ผ่านการสอบทานหรือรับรองจากผู้สอบบัญชี

งบกำไรขาดทุน*

รอบระยะเวลาตั้งแต่วันที่ 1 ธันวาคม 2565 ถึงวันที่ 31 พฤษภาคม 2566

	บาท
รายได้	
รายได้ดอกเบี้ย	1,548,605.45
รวมรายได้	1,548,605.45
ค่าใช้จ่าย	
ค่าธรรมเนียมการจัดการ	108,412.97
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์	42,642.49
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน	101,185.60
ค่าใช้จ่ายอื่น	2,644.95
รวมค่าใช้จ่าย	254,886.01
รายได้ (ขาดทุน) สุทธิ	1,293,719.44
รายการกำไร (ขาดทุน) สุทธิจากเงินลงทุน	
รายการกำไร (ขาดทุน) สุทธิที่เกิดขึ้นจากเงินลงทุน	(1,142.30)
รายการกำไร (ขาดทุน) สุทธิที่ยังไม่เกิดขึ้นทั้งสิ้น	1,797.91
รวมรายการกำไร (ขาดทุน) สุทธิจากเงินลงทุนที่เกิดขึ้นและที่ยังไม่เกิดขึ้น	655.61
การเพิ่มขึ้น (ลดลง) ในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงานก่อนภาษีเงินได้	1,294,375.05
หัก ภาษีเงินได้	(6,832.40)
การเพิ่มขึ้น (ลดลง) ในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงานหลังหักภาษีเงินได้	1,287,542.65
การเพิ่มขึ้น(ลดลง)ในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงานแยกตามประเภทผู้ถือหน่วยลงทุน มีดังนี้	

หมายเหตุ : * งบการเงินนี้ยังไม่ได้ผ่านการสอบทานหรือรับรองจากผู้สอบบัญชี

รายละเอียดการลงทุน การกู้ยืมเงินและการก่อภาระผูกพัน

ข้อมูล ณ วันที่ 31 พฤษภาคม 2566

รายละเอียดการลงทุน	อันดับความน่าเชื่อถือ		มูลค่ายุติธรรม	%NAV
	ของตราสาร	ผู้ออก/ค้ำประกัน		
หลักทรัพย์หรือทรัพย์สินในประเทศ			254,815,940.71	100.02
เงินฝากธนาคาร				
ธนาคาร				
เงินฝากธนาคารกรุงเทพ จำกัด (มหาชน)	AA+(tha)		8,433,144.44	3.31
ตราสารหนี้				
เงินฝากธนาคาร				
ธนาคาร				
ใบรับเงินฝากประจำ 1 ปี ของธนาคารอาคารสงเคราะห์	AAA(thai)		32,706,865.80	12.84
พันธบัตร				
รัฐบาล				
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 10/91/66			11,796,742.14	4.63
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 11/91/66			23,886,898.26	9.38
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 12/91/66			22,981,356.66	9.02
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 13/91/66			22,477,067.33	8.82
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 14/90/66			998,515.90	0.39
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 15/87/66			26,956,140.39	10.58
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 16/91/66			11,278,590.46	4.43
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 18/87/66			31,110,753.96	12.21
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 19/91/66			31,894,181.12	12.52
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 20/91/66			28,095,684.25	11.03
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยงวดที่ 9/91/66			2,200,000.00	0.86
สินทรัพย์อื่นหรือหนี้สินอื่น			(46,912.14)	(0.02)
มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ			254,769,028.57	100.00

รายงานสรุปเงินลงทุนในตราสารแห่งหนี้ เงินฝาก หรือตราสารกึ่งหนี้กึ่งทุน

ข้อมูล ณ วันที่ 31 พฤษภาคม 2566

กลุ่มของตราสาร	มูลค่าตามราคา ตลาด	%NAV
(ก) ตราสารภาครัฐ ได้แก่ ตัวแลกเงิน พันธบัตรรัฐบาล พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย พันธบัตร หรือ ตราสารแห่งหนี้ที่กองทุนเพื่อการฟื้นฟูและพัฒนา	213,675,930.47	83.87
(ข) ตราสารที่ธนาคารที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้น ธนาคารพาณิชย์ หรือบริษัทเงินทุนเป็นผู้ออก ผู้รับรอง ผู้รับอวัล ผู้สลับหลัง หรือผู้ค้ำประกัน	41,140,010.24	16.15
(ค) ตราสารที่มีบริษัทที่ได้รับ rating ในระดับ investment grade เป็นผู้ออก ผู้รับรอง ผู้รับอวัล ผู้สลับหลัง หรือผู้ค้ำประกัน	-	-
(ง) ตราสารที่มีอันดับความน่าเชื่อถืออยู่ในอันดับต่ำกว่าอันดับที่สามารถลงทุนได้ (investment grade) หรือตราสารที่ไม่ได้จัดอันดับความน่าเชื่อถือ	-	-

รายละเอียดตัวตราสารและอันดับความน่าเชื่อถือของตราสารแห่งหนี้ เงินฝาก หรือตราสารกึ่งหนี้กึ่งทุนที่กองทุนลงทุนหรือมีไว้เป็นรายตัว

ประเภท	ผู้ออก	วันครบกำหนด	อันดับความน่าเชื่อถือ		มูลค่า ที่ตราไว้	มูลค่ายุติธรรม
			ตราสาร	ผู้ออก/ค้ำประกัน		
เงินฝากธนาคาร	ธนาคารกรุงเทพ จำกัด (มหาชน)			AA+(tha)	-	8,433,144.44
เงินฝากธนาคาร	ธนาคารอาคารสงเคราะห์	19 เมษายน 2567		AAA(thai)	-	9,019,208.25
เงินฝากธนาคาร	ธนาคารอาคารสงเคราะห์	24 พฤศจิกายน 2566		AAA(thai)	-	11,603,657.55
เงินฝากธนาคาร	ธนาคารอาคารสงเคราะห์	5 มกราคม 2567		AAA(thai)	-	10,070,000.00
เงินฝากธนาคาร	ธนาคารอาคารสงเคราะห์	5 มกราคม 2567		AAA(thai)	-	2,014,000.00
พันธบัตร	ธนาคารแห่งประเทศไทย	1 มิถุนายน 2566			2,200,000.00	2,200,000.00
พันธบัตร	ธนาคารแห่งประเทศไทย	8 มิถุนายน 2566			11,800,000.00	11,796,742.14
พันธบัตร	ธนาคารแห่งประเทศไทย	15 มิถุนายน 2566			23,900,000.00	23,886,898.26
พันธบัตร	ธนาคารแห่งประเทศไทย	22 มิถุนายน 2566			23,000,000.00	22,981,356.66
พันธบัตร	ธนาคารแห่งประเทศไทย	29 มิถุนายน 2566			22,500,000.00	22,477,067.33
พันธบัตร	ธนาคารแห่งประเทศไทย	13 กรกฎาคม 2566			27,000,000.00	26,956,140.39
พันธบัตร	ธนาคารแห่งประเทศไทย	20 กรกฎาคม 2566			11,300,000.00	11,278,590.46
พันธบัตร	ธนาคารแห่งประเทศไทย	3 สิงหาคม 2566			31,200,000.00	31,110,753.96
พันธบัตร	ธนาคารแห่งประเทศไทย	10 สิงหาคม 2566			32,000,000.00	31,894,181.12
พันธบัตร	ธนาคารแห่งประเทศไทย	17 สิงหาคม 2566			28,200,000.00	28,095,684.25
พันธบัตร	ธนาคารแห่งประเทศไทย	6 กรกฎาคม 2566			1,000,000.00	998,515.90

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 และนักลงทุนจะได้รับ ความคุ้มครองจากการผิดนัดชำระหนี้ที่ดีกว่าอันดับเครดิตในระดับอื่น ผู้ออกตราสารหนี้ได้รับอันดับเครดิตในระดับดังกล่าวซึ่งมีเครื่องหมาย “+” ด้วยจะได้รับความคุ้มครองด้านการผิดนัดชำระหนี้ที่สูงยิ่งขึ้น
- T2 ผู้ออกตราสารหนี้มีสถานะทั้งทางด้านการตลาดและการเงินที่แข็งแกร่งในระดับดี และมีความสามารถในการชำระหนี้ระยะสั้นในระดับที่น่าพอใจ
- T3 ผู้ออกตราสารหนี้มีความสามารถในการชำระหนี้ระยะสั้นในระดับที่ยอมรับได้
- T4 ผู้ออกตราสารหนี้มีความสามารถในการชำระหนี้ระยะสั้นที่ค่อนข้างอ่อนแอ

แบบแสดงค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม

สำหรับระยะเวลา 6 เดือน ตั้งแต่วันที่ 1 ธันวาคม 2565 ถึง 31 พฤษภาคม 2566

ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม * (Fund's Direct Expenses)	จำนวนเงิน หน่วย : พันบาท	ร้อยละของ มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ
ค่าธรรมเนียมการจัดการ (Management Fee)		
ชนิดสะสมมูลค่า : TLMMF-A	108.07	0.04
ชนิดเพื่อการออม : TLMMF-SSF	0.34	0.00
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ (Trustee Fee)	42.64	0.02
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียนหน่วย (Registrar Fee)	101.19	0.04
ค่าใช้จ่ายอื่นๆ (Other Expenses)	2.64	0.00
รวมค่าใช้จ่ายทั้งหมด (Total Fund's Direct Expenses)**	254.88	0.10

* ค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายที่หักจากกองทุนรวมได้รวมภาษีมูลค่าเพิ่มแล้ว

** ไม่รวมค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์และค่าธรรมเนียมต่างๆ ที่เกิดขึ้นจากการซื้อขายหลักทรัพย์และภาษีเงินได้จากการลงทุนในตราสารหนี้

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุนของกองทุน (Portfolio Turnover Ratio : “PTR”)

สำหรับระยะเวลา 6 เดือน ตั้งแต่วันที่ 1 ธันวาคม 2565 ถึง 31 พฤษภาคม 2566

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

$$\text{PTR} = \frac{25,572,925.71}{271,123,175.45}$$

$$\text{PTR} = 0.09$$

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

รายงานชื่อบุคคลที่เกี่ยวข้องที่กองทุนเข้าทำธุรกรรม

กองทุนเปิดทาลิส ตลาดเงิน ไม่มีรายการทำธุรกรรมกับบุคคลที่เกี่ยวข้อง ข้อมูลระหว่างวันที่ 1 ธันวาคม 2565 ถึงวันที่ 31 พฤษภาคม 2566

รายงานการถือหน่วยลงทุนเกินข้อจำกัดการใช้สิทธิออกเสียง

กองทุนเปิดทาลิส ตลาดเงิน ไม่มีการถือหน่วยลงทุนเกิน 1 ใน 3 โดยบุคคลใดบุคคลหนึ่ง ข้อมูล ณ วันที่ 31 พฤษภาคม 2566

ผู้ลงทุนสามารถตรวจสอบรายละเอียดการทำธุรกรรมกับบุคคลที่เกี่ยวข้องกับกองทุนรวมและรายงานการถือหน่วยลงทุนเกินข้อจำกัดการใช้สิทธิออกเสียงได้ที่บริษัทจัดการโดยตรง หรือที่ website ของบริษัทจัดการที่ <http://www.talisam.co.th> และสำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ด. <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