



กองทุนเปิด MEGA 20 ไทยเพื่อความยั่งยืน
MEGA 20 THAILAND ESG FUND
(MEGA20THAIESG)

รายงานรอบระยะเวลา 6 เดือน

รอบระยะเวลาดังตั้งแต่วันที่ 18 ธันวาคม 2566 ถึง 31 พฤษภาคม 2567

รายงานรอบระยะเวลา 6 เดือน

ตั้งแต่วันที่ 18 ธันวาคม 2566 ถึง 31 พฤษภาคม 2567

กองทุนเปิด MEGA 20 ไทยเพื่อความยั่งยืน (MEGA20THAIESG)

นโยบายการลงทุน	1
สารสนเทศจากบริษัทจัดการ	2
รายงานการวิเคราะห์ของบริษัทจัดการ	3
รายงานการจัดการกองทุนเพื่อความยั่งยืนตามหลักสากล	5
ผลการดำเนินงานของกองทุนรวม	7
ความเห็นของผู้ดูแลผลประโยชน์	8
งบแสดงฐานะทางการเงิน	9
งบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน	10
งบกำไรขาดทุน	12
รายละเอียดการลงทุน การกู้ยืมเงินและการก่อภาระผูกพัน	13
รายงานสรุปเงินลงทุนในตราสารแห่งหนี้ เงินฝาก หรือตราสารกึ่งหนี้กึ่งทุน	15
คำอธิบายการจัดอันดับความน่าเชื่อถือของสถาบันจัดอันดับความน่าเชื่อถือ	16
แบบแสดงค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม	18
อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุนกองทุนรวม	19
ค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์	20
การรับผลประโยชน์ตอบแทนเนื่องจากการที่กองทุนใช้บริการบุคคลอื่น (Soft Commission)	21
รายงานข้อมูลที่เกี่ยวข้องที่กองทุนเข้าทำธุรกรรม	22
รายงานการถือหน่วยลงทุนเกินข้อจำกัดการใช้สิทธิออกเสียง	22

กองทุนเปิด MEGA 20 ไทยเพื่อความยั่งยืน (MEGA20THAIESG)

MEGA 20 THAILAND ESG FUND: MEGA20THAIESG

กองทุนมีนโยบายลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งหุ้นของบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย และ/หรือตลาดหลักทรัพย์เอ็มเอ ไอ (“บริษัทจดทะเบียน”) ที่ได้รับการคัดเลือกจากตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยหรือองค์กรหรือสถาบันอื่นที่สำนักงาน ก.ล.ต. ยอมรับว่ามีความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน (Environmental, Social and Governance: ESG) โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน

เงินลงทุนส่วนที่เหลือ กองทุนอาจพิจารณาลงทุนในตราสารทุนนอกเหนือจากที่กำหนดในวรรคแรก ตราสารกึ่งหนี้กึ่งทุน ตราสารหนี้ เงินฝาก และ/หรือ หน่วยลงทุนของกองทุนรวม ตลอดจนหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินอื่น หรือการหาผลตอบแทนโดยวิธีอื่นตามที่คณะกรรมการ ก.ล.ต. หรือสำนักงาน ก.ล.ต. ประกาศกำหนดให้ลงทุนได้ อย่างไรก็ตาม การลงทุนในทรัพย์สินข้างต้นจะเป็นไปในลักษณะที่ไม่ทำให้กองทุนมี net exposure ให้การลงทุนในหุ้นที่กำหนดตามวรรคแรกโดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีน้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน

หลักเกณฑ์การพิจารณาคัดเลือกหลักทรัพย์ที่กองทุนเข้าลงทุน

กองทุนจะใช้การบริหารแบบ Rule-based Approach ซึ่งจะกำหนดเกณฑ์ในการคัดเลือกจากหลักทรัพย์เฉพาะที่ได้รับการประเมินผลการดำเนินงานด้านความยั่งยืน (ESG Rating) ในระดับ AA ขึ้นไป ณ ขณะลงทุน

กระบวนการวิเคราะห์และคัดเลือกหลักทรัพย์

ขั้นตอนที่ 1: คัดเลือกหลักทรัพย์ที่ได้รับการประเมินผลการดำเนินงานด้านความยั่งยืน (ESG Rating)

ขั้นตอนที่ 2: คัดเลือกหลักทรัพย์ที่ได้รับการประเมินผลการดำเนินงานด้านความยั่งยืน (ESG Rating) จากตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยว่ามีความโดดเด่นด้าน ESG ในระดับตั้งแต่ AA ขึ้นไปเท่านั้น (รวมถึง AA และ AAA)

ขั้นตอนที่ 3: หลักทรัพย์ที่คัดเลือกต้องมีสภาพคล่องสูง โดยพิจารณาจาก Free Float ของบริษัทนั้น ๆ และหลักทรัพย์นั้นต้องไม่มีการถือหุ้นโดยผู้ถือหุ้นรายใหญ่เพื่อประโยชน์ในการประกอบธุรกิจอย่างเป็นอิสระ โดยเป็นไปตามหลักเกณฑ์และดุลยพินิจของผู้จัดการกองทุน

ขั้นตอนที่ 4: คัดเลือกหลักทรัพย์ที่มีมูลค่าหลักทรัพย์ตามราคาตลาด (Market Capitalization) สูงสุดจำนวน 20 - 25 หลักทรัพย์ โดยจะพิจารณาลงทุนในหลักทรัพย์ที่มีมูลค่าหลักทรัพย์ตามราคาตลาด (Market Capitalization) สูงสุดลำดับ 1 – 12 หลักทรัพย์แรกในสัดส่วนการลงทุนที่ใกล้เคียงกัน รวมกันประมาณร้อยละ 70 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน ทั้งนี้ ในสถานการณ์ปกติ กองทุนจะจำกัดสัดส่วนการลงทุนในแต่ละหมวดอุตสาหกรรม (sector) ไม่เกินกว่าร้อยละ 30 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน

กองทุนจะทำการพิจารณาปรับรายชื่อหลักทรัพย์ และ/หรือ ปรับสัดส่วนการลงทุนอย่างน้อยปีละ 2 ครั้ง

ทั้งนี้ ในกรณีที่บริษัทจัดการพิจารณาแล้วเห็นว่าหลักเกณฑ์การพิจารณาคัดเลือกหลักทรัพย์ ความถี่ในการปรับสมดุลของสัดส่วนน้ำหนักการลงทุน (Rebalance) และการปรับรายชื่อหลักทรัพย์ที่กำหนดไว้ข้างต้นไม่เพียงพอ และ/หรือไม่เหมาะสมกับสถานการณ์การลงทุน ณ ขณะใดแล้ว บริษัทจัดการขอสงวนสิทธิที่จะปรับปรุงหลักเกณฑ์ฯ ดังกล่าวนั้นโดยเป็นไปในลักษณะที่ไม่ด้อยกว่าหลักเกณฑ์เดิมที่กำหนดแต่ยังคงวัตถุประสงค์และกรอบการลงทุนเพื่อการลงทุนที่เกี่ยวข้องกับความยั่งยืน โดยถือประโยชน์ของผู้ถือหน่วยลงทุนเป็นสำคัญ ทั้งนี้ บริษัทจัดการจะแจ้งรายละเอียดของการปรับเปลี่ยนหลักเกณฑ์ฯ ข้างต้นให้ผู้ถือหน่วยลงทุน และ/หรือผู้ลงทุนทราบล่วงหน้าไม่น้อยกว่า 3 วันทำการ

วันที่ 30 มิถุนายน 2567

เรียน ท่านผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุน

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ทาลิส จำกัด (บริษัทฯ) ขอนำเสนอรายงานผลการดำเนินงานสำหรับรอบระยะเวลา 6 เดือน (18 ธันวาคม 2566 – 31 พฤษภาคม 2567) ของกองทุนเปิด MEGA 20 ไทยเพื่อความยั่งยืนมายังผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุนทุกท่าน

ภาวะเศรษฐกิจและผลประกอบการของบริษัทจดทะเบียนมีแนวโน้มฟื้นตัว โดยระยะกลางถึงยาวจะมีแรงผลักดันหลักจากภาคการท่องเที่ยวและการลงทุนโดยตรงจากต่างประเทศของกลุ่มบริษัทที่ต้องการกระจายฐานการผลิตเพื่อลดความเสี่ยงทางภูมิรัฐศาสตร์ ในขณะที่อัตราดอกเบี้ยนโยบายของไทยก็ยังคงอยู่ในระดับที่ต่ำ ทำให้ต้นทุนทางการเงินของบริษัทจดทะเบียนยังไม่เป็นภาระในการฟื้นตัวของธุรกิจ นอกจากนี้ นโยบายสนับสนุนภาคเศรษฐกิจของรัฐบาลมีโอกาสทำให้ตลาดหุ้นไทยมีการปรับตัวในทิศทางที่ดีในช่วง 1-2 ปีข้างหน้าได้ บริษัทฯ เชื่อว่าในภาวะการณ์เช่นนี้ การลงทุนในตราสารทุนยังสามารถให้ผลตอบแทนที่ดีได้ในระยะยาว อย่างไรก็ตาม ในระยะสั้นตลาดหุ้นอาจมีความผันผวนจากปัจจัยภายในและภายนอกประเทศที่เข้ามากระทบบ้าง ทั้งนี้ เพื่อสร้างผลตอบแทนการลงทุนที่ดีในระยะยาว กองทุนเปิด MEGA 20 ไทยเพื่อความยั่งยืน มีหลักเกณฑ์การคัดเลือกหลักทรัพย์ ตามหลักเกณฑ์การคัดเลือกที่บริษัทจัดการกำหนด (Rules-based Approach) โดยเชื่อว่าการลงทุนในบริษัทที่ได้รับการประเมินยอมรับว่ามีความโดดเด่นด้านความยั่งยืน (ESG) จะเป็นแรงขับเคลื่อนให้มีกิจกรรมที่คำนึงถึงปัจจัยด้าน ESG มากขึ้น ส่งผลให้เกิดระบบนิเวศที่ยั่งยืนต่อระบบเศรษฐกิจไทย จนกระทั่งบรรลุเป้าหมายการพัฒนาที่ยั่งยืน และสามารถสร้างผลตอบแทนที่ยั่งยืนให้แก่ผู้ถือหุ้นในระยะยาว

ณ วันที่ 31 พฤษภาคม 2567 กองทุนเปิด MEGA 20 ไทยเพื่อความยั่งยืน มีมูลค่าทรัพย์สินสุทธิ 18,607,149.95 บาท และมูลค่าหน่วยลงทุน 9.2999 บาท โดยมีอัตราผลตอบแทนนับตั้งแต่จัดตั้งกองทุนลดลงร้อยละ 7.00

บริษัทฯ ขอขอบพระคุณท่านผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุนทุกท่านที่เชื่อมั่นและให้ความไว้วางใจ บริษัทฯ จะบริหารการลงทุนด้วยความรอบคอบระมัดระวัง ภายใต้กฎระเบียบต่าง ๆ และจรรยาบรรณวิชาชีพ เพื่อผลประโยชน์สูงสุดของท่านผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุนทุกท่านเป็นสำคัญ

ขอแสดงความนับถือ

คณะผู้จัดการกองทุน

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ทาลิส จำกัด

รายงานการวิเคราะห์ของบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ทาลิส จำกัด ในฐานะบริษัทจัดการ กองทุนเปิด MEGA 20 ไทยเพื่อความยั่งยืน

ภาวะตลาดหุ้น

SET Index เริ่มฟื้นตัวได้ดีขึ้นภายหลังการทำการจุดต่ำสุดใหม่ของปี 2566 ในช่วงกลางเดือนธันวาคม เนื่องจากธนาคารกลางสหรัฐ ประกาศคงอัตราดอกเบี้ยนโยบายที่ระดับ 5.25-5.50% พร้อมกับมุมมองในเรื่องนโยบายดอกเบี้ยในเชิงที่ผ่อนคลายมากขึ้น โดยส่งสัญญาณลดอัตราดอกเบี้ยในปี 2567 มากกว่า 3 ครั้ง และในปี 2568 จะปรับลดลงอัตราดอกเบี้ยอีก 4 ครั้ง ทั้งนี้ ดัชนีค่าเงินดอลลาร์ฯ (Trade-weighted US Dollar Index) ที่อ่อนค่าแรง ได้สนับสนุนให้ Fund Flow ต่างชาติกลับเข้าสู่สินทรัพย์เสี่ยง ประกอบกับเริ่มมีแรงซื้อเก็งกำไรหุ้นที่เป็นกลุ่มเป้าหมายของกองทุน THAIESG ที่มีลักษณะเป็นกองทุนที่เน้นลงทุนหุ้น ESG หรือหุ้นยั่งยืน ทำให้ SET Index สามารถปรับตัวขึ้นมาขึ้นเหนือระดับ 1,400 จุดได้ อย่างไรก็ตาม ความคาดหวังที่เฟดจะดำเนินนโยบายการเงินที่ผ่อนคลายได้ลดลงอย่างรวดเร็ว หลังตัวเลขเศรษฐกิจของสหรัฐฯ ยังอยู่ในเกณฑ์ดี ส่งผลให้ดัชนีค่าเงินดอลลาร์ฯ กลับมาแข็งค่าขึ้น ประกอบกับปัจจัยภายในประเทศจากตัวเลขคาดการณ์เศรษฐกิจไทยปี 2566 จากประมาณการของกระทรวงการคลังที่มีแนวโน้มจะออกมาต่ำกว่าเป้าเดิม อีกทั้งมาตรการ Digital Wallet อาจล่าช้าออกไปจากกำหนดการเดิม ทำให้มีกระแสกดดันต้องการให้ ธปท. ปรับลดอัตราดอกเบี้ยนโยบายเพื่อกระตุ้นเศรษฐกิจ ส่งผลให้นักลงทุนต่างชาติยังขายหุ้นไทยอย่างต่อเนื่อง

ในช่วงเดือนมกราคม ปี 2567 ที่ผ่านมา January Effect สำหรับตลาดหุ้นไทยในปีนี้เกิดขึ้นไม่กี่ปีก่อน โดยตลอดทั้งเดือนมีการปรับตัวลงจากแรงขายในหุ้นขนาดใหญ่ โดยเฉพาะหุ้นกลุ่มธนาคารที่ได้แรงกดดันจากความกังวลดอกเบี้ยไทยเริ่มมีโอกาที่จะปรับลดลง และการทยอยปรับลด Target Price ลงจากโบรกเกอร์ต่างประเทศ รวมถึงผลกระทบจากกระแสความเสียงการผิดนัดชำระหนี้ของบริษัทขนาดใหญ่บางแห่งที่กลับเข้ามาในตลาด ทั้งนี้ นักลงทุนต่างชาติยังมีการขายหุ้นอย่างต่อเนื่อง โดยประเทศไทยเป็นประเทศเดียวในภูมิภาคที่มีกระแสเงินไหลออก สะท้อนถึงปัจจัยกดดันเฉพาะตัวของตลาดหุ้นไทย อาทิเช่น ตัวเลขเศรษฐกิจที่มีแนวโน้มเติบโตต่ำกว่าคาดการณ์ ผลประกอบการบริษัทจดทะเบียนฯ ที่อาจจะออกมาน่าผิดหวัง โครงการกระตุ้นเศรษฐกิจที่ส่อแววล่าช้า รวมถึงขนาดของวงเงินที่ใช้มีความเสี่ยงที่จะปรับลดลง ความเชื่อมั่นต่อเศรษฐกิจไทยมีน้อยลง หลังรัฐบาลและ ธปท. มีมุมมองที่ต่างกันต่อเศรษฐกิจ โดยรัฐบาลแสดงความกังวลต่อภาวะเงินฝืดรวมทั้งระดับอัตราดอกเบี้ยที่สูงเกินไป แต่ฝั่ง ธปท. แลงลงว่าเศรษฐกิจไทยขณะนี้ไม่เกิดสภาวะเงินฝืดและดอกเบี้ยนโยบายอยู่ในระดับที่เหมาะสม โดยที่ดอกเบี้ยนโยบายของไทยอยู่ในระดับต่ำที่สุดแห่งหนึ่งของโลก อย่างไรก็ตาม ปัจจัยที่จะเป็นแรงบวกให้กับตลาดหุ้นไทยจะมาจากจำนวนนักท่องเที่ยวจีนมีแนวโน้มสดใสมากขึ้น หลังมาตรการฟรีวีซ่าลาว ไทย-จีน ที่เริ่มตั้งแต่ 1 มีนาคม 2567 ส่งผลให้ตั้งแต่ช่วงมีนาคมที่ผ่านมาจำนวนนักท่องเที่ยวจีนฟื้นตัวได้ค่อนข้างดีเมื่อเทียบกับปีก่อน และทางการเงินได้ประกาศมาตรการสนับสนุนตลาดหุ้นภายในประเทศ รวมทั้งการปรับลดสัดส่วนเงินสำรองภาคธนาคาร (Reserve Requirement Ratio) ลง คาดว่าจะส่งผลให้ตลาดหุ้นจีนและตลาดหุ้นที่เชื่อมโยงสามารถฟื้นตัวในระดับหนึ่ง

ช่วงไตรมาส 2 ในปี 2567 ตลาดหุ้นไทยมีความผันผวนค่อนข้างมาก โดยในช่วงครึ่งแรกของเดือนเมษายน 2567 ตลาดหุ้นได้ปรับตัวขึ้นค่อนข้างดี จากข่าวโครงการขนาดใหญ่ เช่น สถาบันเท็งครบวงจร (Entertainment Complex) โครงการดิจิทัล วอลเลต รวมถึงมาตรการกระตุ้นภาคอสังหาริมทรัพย์ อย่างไรก็ตาม ในช่วงท้ายของเดือนนั้น ตลาดได้ปรับตัวลดลงจากการขายทำกำไร และความกังวลในด้านความขัดแย้งระหว่างอิหร่าน-อิสราเอล โดยดัชนีมีการพยายามปรับตัวขึ้นในช่วงต้นของเดือนพฤษภาคม โดยปัจจัยบวกในประเทศมาจากผลประกอบการของบริษัทจดทะเบียนฯ ส่วนใหญ่ออกมาดีกว่าคาด รวมถึงตลาดหุ้นในต่างประเทศสามารถปรับตัวขึ้นได้เนื่องจากเครื่องชี้วัดทางเศรษฐกิจออกมามีความดีเกินคาด รวมถึงผลประกอบการของบริษัทจดทะเบียนฯ ในประเทศสหรัฐอเมริกา และประเทศจีน อย่างไรก็ตาม ครึ่งเดือนหลังตลาดหุ้นโลกปรับตัวลง โดยมีปัจจัยกดดันจากรายงานดัชนี Flash PMI ภาคการผลิตและภาคการบริการเดือนพฤษภาคมของสหรัฐฯ ที่ออกมา 50.9/54.8 มากกว่าตลาดคาดและมากกว่าเดือนก่อนที่อยู่ระดับ 50/51.3 ประกอบกับการส่งสัญญาณของคณะกรรมการ FED ที่ออกมาส่งสัญญาณว่ามีโอกาสที่จะชะลอการปรับลดอัตราดอกเบี้ย จนกว่าจะแน่ใจว่าเงินเฟ้อสหรัฐฯ ลงสู่เป้าหมายระยะยาวที่ 2% ทำให้นักลงทุนปรับมุมมองการปรับลดอัตราดอกเบี้ยของ FED ปีนี้เหลือ 1 ครั้งในเดือนพฤศจิกายน

แม้ว่าตลาดหุ้นประเทศไทยจะต้องเผชิญกับปัจจัยกดดันอย่างต่อเนื่อง แต่ในระยะยาว บลจ.ทาลิส เชื่อว่าเศรษฐกิจไทยและผลประกอบการของบริษัทจดทะเบียนยังมีโอกาสเติบโตต่อเนื่องในช่วง 1-2 ปีข้างหน้า โดยระยะกลางถึงยาวจะมีแรงผลักดันหลักจากภาคการท่องเที่ยวและการลงทุนโดยตรงจากต่างประเทศของกลุ่มบริษัทที่ต้องการกระจายฐานการผลิตเพื่อลดความเสี่ยงทางภูมิรัฐศาสตร์ ภาคนาครของประเทศไทยก็ยังคงมีความแข็งแกร่งทั้งในแง่ของสภาพคล่องและเงินทุนสำรอง และพร้อมที่จะสนับสนุนการฟื้นตัวของเศรษฐกิจประเทศ นอกจากนี้ นโยบายสนับสนุนภาคเศรษฐกิจของรัฐบาลก็มีโอกาสทำให้ตลาดหุ้นไทยมีการปรับตัวในทิศทางที่ดีในช่วง 1-2 ปีข้างหน้าได้

รายงานการจัดการกองทุนเพื่อความยั่งยืนตามหลักสากล

กองทุนเปิด MEGA 20 ไทยเพื่อความยั่งยืน มีนโยบายลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งหุ้นของบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย และ/หรือตลาดหลักทรัพย์เอ็ม เอ ไอ (“บริษัทจดทะเบียนฯ”) ที่ได้รับการคัดเลือกจากตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยหรือองค์กรหรือสถาบันอื่นที่สำนักงาน ก.ล.ต. ยอมรับว่ามีความโดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อม (Environment) หรือด้านความยั่งยืน (Environmental, Social and Governance: ESG) โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน โดยมีหลักเกณฑ์การคัดเลือกหลักทรัพย์ ตามหลักเกณฑ์การคัดเลือกที่บริษัทจัดการกำหนด (Rules-based Approach) โดยเชื่อว่าการลงทุนในบริษัทที่ได้รับการประเมินยอมรับว่ามีความโดดเด่นด้านความยั่งยืน (ESG) จะเป็นแรงขับเคลื่อนให้มีกิจกรรมที่คำนึงถึงปัจจัยด้าน ESG มากขึ้น ส่งผลให้เกิดระบบนิเวศที่ยั่งยืนต่อระบบเศรษฐกิจไทย

ทั้งนี้ บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนรวม ทาลิส จำกัด มีการบริหารจัดการกองทุนให้สอดคล้องกับนโยบายการลงทุนที่มุ่งเน้นความยั่งยืน (Sustainability) ตามหลักสากล และเป็นไปตามแนวปฏิบัติ ที่ น.ป. 2/2565 เรื่อง แนวทางปฏิบัติในการเปิดเผยข้อมูลของกองทุนรวมเพื่อความยั่งยืน

- **ปัญหาหรือเหตุการณ์ร้ายแรงที่เกิดขึ้น และการเปลี่ยนแปลงการลงทุนในทรัพย์สินที่ได้ลงทุนไปแล้ว:**
กองทุนไม่พบปัญหาหรือเหตุการณ์ร้ายแรง ในช่วงระหว่างรอบระยะเวลา 6 เดือนที่ผ่านมา ที่มีผลต่อการลงทุนอย่างมีนัยสำคัญ
- **ลักษณะ เหตุผล และความจำเป็นในการพบปะผู้บริหารของกิจการ หรือผู้ออกตราสารที่กองทุนไปลงทุน:**
กองทุนเน้นลงทุนในหลักทรัพย์ของบริษัทที่ได้รับการประเมินผลการดำเนินงานด้านความยั่งยืน (ESG Rating) จาก SET ในระดับตั้งแต่ AA ขึ้นไป โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน โดยมีกลยุทธ์การลงทุนแบบ Positive Screening อย่างเป็นหลักเกณฑ์ (Rule-based Investment Strategy) ที่เป็นการกำหนดหลักเกณฑ์ เงื่อนไข รวมถึงขั้นตอนการคัดเลือกหลักทรัพย์ เพื่อเข้าลงทุนไว้ล่วงหน้า โดยบริษัทจัดการมีการเข้าพบปะผู้บริหารของบริษัทจดทะเบียนที่ทำการลงทุนอย่างสม่ำเสมอ เพื่อติดตามผลการดำเนินงานของบริษัทจดทะเบียน รวมถึงสอบถามแนวทางการดำเนินงาน และกลยุทธ์ของบริษัทในอนาคต ซึ่งอาจรวมถึงนโยบายด้านความยั่งยืนในระยะยาว และเป็นการติดตามบริษัทจดทะเบียนที่อาจมีประเด็นในด้านสังคม สิ่งแวดล้อม และการกำกับดูแลกิจการที่ดี เพื่อนำมาช่วยประเมินความเหมาะสมต่อสถานการณ์การลงทุนในแต่ละขณะ โดยบริษัทจัดการจะดำเนินการเพื่อประโยชน์ของผู้ถือหน่วยลงทุนหรือลดความเสี่ยงของกองทุนเป็นสำคัญ
- **ความเสี่ยงที่เกี่ยวข้องกับความยั่งยืน และการนำปัจจัยความเสี่ยงดังกล่าวมาประกอบการตัดสินใจลงทุน:**
กองทุนเน้นลงทุนในหลักทรัพย์ของบริษัทที่ได้รับการประเมินผลการดำเนินงานด้านความยั่งยืน (ESG Rating) จาก SET ในระดับตั้งแต่ AA ขึ้นไป ซึ่งข้อมูลอาจไม่มีการปรับปรุงให้เป็นปัจจุบันได้ทันทีเมื่อมีเหตุการณ์เกี่ยวกับ ESG มากระทบกับบริษัทนั้นในเชิงลบ กองทุนมีนโยบายมุ่งเน้นลงทุนในหุ้นของบริษัทจดทะเบียนฯ ที่เห็นความสำคัญและดำเนินธุรกิจที่มีความยั่งยืนในระยะยาว (Sustainability) จึงอาจมีความ

เสี่ยงจากการกระจุกตัวในทรัพย์สินที่เกี่ยวข้องกับความยั่งยืน และการไม่สามารถซื้อหรือขายหลักทรัพย์บางตัวได้ในราคาหรือช่วงเวลาที่เหมาะสมด้วยเงื่อนไขด้านความยั่งยืนที่กองทุนกำหนด นอกจากนี้ กองทุนมีการจำกัดสัดส่วนการลงทุนของแต่ละหมวดอุตสาหกรรม (sector) ไว้ไม่เกินกว่าร้อยละ 30 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน ดังนั้น กองทุนอาจมีการลงทุนกระจุกตัวในหมวดอุตสาหกรรมใดอุตสาหกรรมหนึ่งในบางขณะได้ ทั้งนี้ หากเมื่อพิจารณาจากเหตุการณ์เกี่ยวกับ ESG มากระทบกับบริษัทนั้นในเชิงลบ ณ ขณะนั้นหรือที่อาจเกิดขึ้น หรือข้อมูลจากแหล่งที่เชื่อถือได้ หรือที่บริษัทจัดการคาดการณ์ว่าอาจส่งผลกระทบทางลบต่อราคาในทิศทางที่จะทำให้ราคาตราสารทุนของบริษัทนั้นลดลงอย่างมาก หรือปัจจัยทางการเงิน ผู้จัดการกองทุนอาจมีการพิจารณาปรับเปลี่ยนรายชื่อหลักทรัพย์ของบริษัทใดบริษัทหนึ่งหรือหลายบริษัทจากรายชื่อหลักทรัพย์ที่กองทุนลงทุนหรือจะเข้าลงทุน ให้มีความเหมาะสมตามสภาวะการณ์ในแต่ละขณะได้ โดยจะคำนึงถึงประโยชน์ของผู้ถือหน่วยลงทุนเป็นสำคัญ

ผลการดำเนินงานของกองทุนเปิด MEGA 20 ไทยเพื่อความยั่งยืน (MEGA20THAIESG)

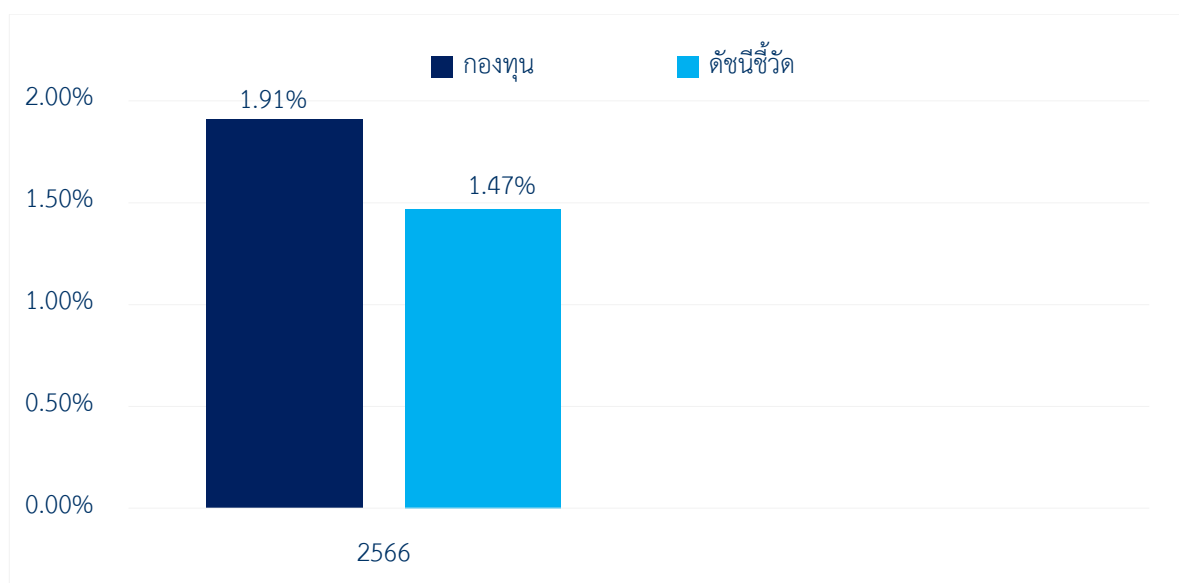
ตารางแสดงผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปึกหมุด

ผลการดำเนินงานย้อนหลัง ¹								
กองทุน	% ตามช่วงเวลา			% ต่อปี				
	Year to date	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี	3 ปี	5 ปี	10 ปี	ตั้งแต่จัดตั้ง (18 ธ.ค. 66)
MEGA20THAIESG	-8.74	-4.14	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	-7.00
Benchmark ²	-3.78	-0.91	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	-2.36
ความผันผวนของผลการดำเนินงาน	10.69	10.53	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	10.45
ความผันผวนของ Benchmark ²	10.61	10.40	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	10.29

หมายเหตุ: ¹เป็นข้อมูล ณ วันที่ 31 พฤษภาคม 2567 คุณสามารถดูข้อมูลที่เป็นปัจจุบันได้ที่ www.talisam.co.th

²ดัชนีผลตอบแทนรวม SETESG (SETESG TRI)

ผลการดำเนินงานแบบย้อนหลังตามปีปฏิทิน



หมายเหตุ: ปีที่เริ่มต้นกองทุน ผลการดำเนินงานกองทุนและดัชนีชี้วัดจะแสดงตั้งแต่วันที่จดทะเบียนถึงสิ้นปีปฏิทิน มีระยะเวลาไม่ถึง 1 ปี จึงไม่มีค่า Peer avg ในระยะเวลาดังกล่าว

ผลการดำเนินงานในอดีต / ผลการเปรียบเทียบผลการดำเนินงานที่เกี่ยวข้องกับผลิตภัณฑ์ในตลาดทุน มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

เอกสารการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวมฉบับนี้ได้จัดทำขึ้นตามมาตรฐานการวัดและนำเสนอผลการดำเนินงานของกองทุนรวมของสมาคมบริษัทจัดการลงทุน



ความเห็นของผู้ดูแลผลประโยชน์

วันที่ 20 มิถุนายน 2567

เรียน ผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุนกองทุนเปิด MEGA 20 ไทยเพื่อความยั่งยืน

ธนาคารกรุงเทพ จำกัด (มหาชน) ในฐานะผู้ดูแลผลประโยชน์ ได้ดูแลการจัดการกองทุนเปิด MEGA 20 ไทยเพื่อความยั่งยืน ซึ่งจัดการโดยบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ทาลิส จำกัด สำหรับระยะเวลาตั้งแต่วันที่ 18 ธันวาคม 2566 ถึงวันที่ 31 พฤษภาคม 2567 แล้ว

ธนาคารฯ เห็นว่าบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ทาลิส จำกัด ได้ปฏิบัติหน้าที่ในการจัดการกองทุนเปิด MEGA 20 ไทยเพื่อความยั่งยืน เหมาะสมตามสมควรแห่งวัตถุประสงค์ที่ได้กำหนดไว้ในโครงการ และภายใต้พระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535

(นางฤดี ลีโทชลิต)

ธนาคารกรุงเทพ จำกัด (มหาชน)

ในฐานะผู้ดูแลผลประโยชน์

งบแสดงฐานะทางการเงิน*
ณ วันที่ 31 พฤษภาคม 2567

	บาท
สินทรัพย์	
เงินลงทุนตามมูลค่ายุติธรรม	17,432,036.40
(ราคาทุน วันที่ 31 พฤษภาคม 2567 เท่ากับ 19,183,091.13 บาท)	
เงินสดและเงินฝากธนาคาร	1,211,698.93
ลูกหนี้จากการลงทุน	
จากเงินปันผลและดอกเบี้ย	3,237.61
ค่าใช้จ่ายรอการตัดบัญชี	2,244.84
รวมสินทรัพย์	18,649,217.78
หนี้สิน	
ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย	
ค่าธรรมเนียมการจัดการค้างจ่าย	25,944.95
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ค้างจ่าย	345.92
ค่าธรรมเนียมทะเบียนค้างจ่าย	1,210.79
ค่าธรรมเนียมวิชาชีพค้างจ่าย	13,318.18
ภาษีเงินได้ค้างจ่าย	485.64
หนี้สินอื่น	762.35
รวมหนี้สิน	42,067.83
สินทรัพย์สุทธิ	18,607,149.95
สินทรัพย์สุทธิ:	
ทุนที่ได้รับจากผู้ถือหน่วยลงทุน	20,007,772.92
กำไร(ขาดทุน)สะสม	
บัญชีปรับสมดุล	42,473.43
กำไร (ขาดทุน) สะสมจากการดำเนินงาน	(1,443,096.40)
สินทรัพย์สุทธิ	18,607,149.95
มูลค่าสินทรัพย์สุทธิต่อหน่วย	9.2999
จำนวนหน่วยลงทุนที่จำหน่ายแล้วทั้งหมด	2,000,777.2866

หมายเหตุ : * งบการเงินนี้ยังไม่ได้ผ่านการสอบทานหรือรับรองจากผู้สอบบัญชี

งบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน*

ณ วันที่ 31 พฤษภาคม 2567

การแสดงรายละเอียดเงินลงทุนในการจัดกลุ่มตามประเภทของเงินลงทุนและตามประเภทของอุตสาหกรรม

ชื่อหลักทรัพย์	จำนวนหน่วย	มูลค่ายุติธรรม (บาท)	ร้อยละของ มูลค่าเงินลงทุน
หลักทรัพย์จดทะเบียน			
หุ้นสามัญ			
ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย			
ธนาคาร		5,084,174.00	29.17
ธนาคารกสิกรไทย จำกัด (มหาชน)	9,100	1,192,100.00	6.84
บริษัท เอสซีบี เอกซ์ จำกัด (มหาชน)	10,800	1,144,800.00	6.57
บริษัท ทีสโກไฟแนนเชียลกรุ๊ป จำกัด (มหาชน)	5,500	537,625.00	3.08
ธนาคารทหารไทยธนชาต จำกัด (มหาชน)	637,100	1,076,699.00	6.18
ธนาคารกรุงเทพ จำกัด (มหาชน)	8,300	1,132,950.00	6.50
พาณิชย์		3,850,282.40	22.09
บริษัท โสม โปรดัคส์ เซ็นเตอร์ จำกัด (มหาชน)	110,600	1,028,580.00	5.90
บริษัท ซีพี ออลล์ จำกัด (มหาชน)	20,800	1,196,000.00	6.86
บริษัท เซ็นทรัล รีเทล คอร์ปอเรชั่น จำกัด (มหาชน)	34,000	1,037,000.00	5.95
บริษัท สยามโกลบอลเฮ้าส์ จำกัด (มหาชน)	35,464	588,702.40	3.38
พลังงานและสาธารณูปโภค		2,017,520.00	11.57
บริษัท บางจาก คอร์ปอเรชั่น จำกัด (มหาชน)	13,200	504,900.00	2.90
บริษัท ผลิตไฟฟ้า จำกัด (มหาชน)	4,900	509,600.00	2.92
บริษัท พลังงานบริสุทธิ์ จำกัด (มหาชน)	43,800	1,003,020.00	5.75
เงินทุนและหลักทรัพย์		571,875.00	3.28
บริษัท บัตรกรุงไทย จำกัด (มหาชน)	12,500	571,875.00	3.28
เทคโนโลยีสารสนเทศและการสื่อสาร		1,116,500.00	6.40
บริษัท แอดวานซ์ อินโฟร์ เซอร์วิส จำกัด (มหาชน)	5,500	1,116,500.00	6.40
การแพทย์		1,039,500.00	5.96
บริษัท กรุงเทพดุสิตเวชการ จำกัด (มหาชน)	38,500	1,039,500.00	5.96
ขนส่งและโลจิสติกส์		543,220.00	3.12
บริษัท ทางด่วนและรถไฟฟ้ากรุงเทพ จำกัด (มหาชน)	69,200	543,220.00	3.12
อาหารและเครื่องดื่ม		558,600.00	3.20
บริษัท โอสดสภา จำกัด (มหาชน)	24,500	558,600.00	3.20

งบประกอบรายละเอียดเงินลงทุน*

ณ วันที่ 31 พฤษภาคม 2567

การแสดงรายละเอียดเงินลงทุนใช้การจัดกลุ่มตามประเภทของเงินลงทุนและตามประเภทของอุตสาหกรรม

ชื่อหลักทรัพย์	จำนวนหน่วย	มูลค่ายุติธรรม (บาท)	ร้อยละของ มูลค่าเงินลงทุน
วัสดุก่อสร้าง		991,200.00	5.69
บริษัท ปูนซิเมนต์ไทย จำกัด(มหาชน)	4,200	991,200.00	5.69
พัฒนาอสังหาริมทรัพย์		1,659,165.00	9.52
บริษัท ดับบลิวเอชเอ คอร์ปอเรชั่น จำกัด (มหาชน)	112,200	611,490.00	3.51
บริษัท เซ็นทรัลพัฒนา จำกัด (มหาชน)	18,300	1,047,675.00	6.01
รวมหลักทรัพย์จดทะเบียน		17,432,036.40	100.00
รวมเงินลงทุน (ราคาทุน 19,183,091.13 บาท)		17,432,036.40	100.00

หมายเหตุ : * งบการเงินนี้ยังไม่ได้ผ่านการสอบทานหรือรับรองจากผู้สอบบัญชี

งบกำไรขาดทุน*

สำหรับระยะเวลา 6 เดือน ตั้งแต่วันที่ 18 ธันวาคม 2566 (วันจดทะเบียนจัดตั้งกองทุน) ถึง 31 พฤษภาคม 2567

	บาท
รายได้จากการลงทุน	
รายได้เงินปันผล	483,809.46
รายได้ดอกเบี้ย	3,675.65
รวมรายได้	487,485.11
ค่าใช้จ่าย	
ค่าธรรมเนียมการจัดการ	129,624.71
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์	1,728.31
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียน	6,049.22
ค่าธรรมเนียมวิชาชีพ	13,318.18
ค่านายหน้า	23,089.36
ค่าใช้จ่ายอื่น	6,090.46
รวมค่าใช้จ่าย	179,900.24
รายได้ (ขาดทุน) สุทธิ	307,584.87
รายการกำไร (ขาดทุน) สุทธิจากเงินลงทุน	
รายการกำไร (ขาดทุน) สุทธิที่เกิดขึ้นจากเงินลงทุน	924.81
รายการกำไร (ขาดทุน) สุทธิที่ยังไม่เกิดขึ้นจากเงินลงทุน	(1,751,054.73)
รวมรายการกำไร(ขาดทุน)สุทธิจากเงินลงทุนที่เกิดขึ้นและที่ยังไม่เกิดขึ้น	(1,750,129.92)
การเพิ่มขึ้น(ลดลง)ในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงานก่อนภาษีเงินได้	(1,442,545.05)
หัก ภาษีเงินได้	(551.35)
การเพิ่มขึ้น(ลดลง)ในสินทรัพย์สุทธิจากการดำเนินงานหลังหักภาษีเงินได้	(1,443,096.40)

หมายเหตุ : * งบการเงินนี้ยังไม่ได้ผ่านการสอบทานหรือรับรองจากผู้สอบบัญชี

รายละเอียดการลงทุน การกู้ยืมเงินและการก่อภาระผูกพัน

ข้อมูล ณ วันที่ 31 พฤษภาคม 2567

รายละเอียดการลงทุน	อันดับความน่าเชื่อถือ		มูลค่ายุติธรรม	%NAV
	ของตราสาร	ผู้ออก/ค้ำประกัน		
หลักทรัพย์หรือทรัพย์สินในประเทศ			18,646,972.94	100.21
เงินฝากธนาคาร				
ธนาคาร				
เงินฝากธนาคารกรุงเทพ จำกัด (มหาชน)	AA+(tha)		1,214,936.54	6.53
หุ้นสามัญ				
เกษตรและอุตสาหกรรมอาหาร				
อาหารและเครื่องดื่ม				
บริษัท โอเอสสุภา จำกัด (มหาชน)			558,600.00	3.00
ทรัพยากร				
พลังงานและสาธารณูปโภค				
บริษัท บางจาก คอร์ปอเรชั่น จำกัด (มหาชน)			504,900.00	2.71
บริษัท ผลิตไฟฟ้า จำกัด (มหาชน)			509,600.00	2.74
บริษัท พลังงานบริสุทธิ์ จำกัด (มหาชน)			1,003,020.00	5.39
เทคโนโลยี				
เทคโนโลยีสารสนเทศและการสื่อสาร				
บริษัท แอดวานซ์ อินโฟร์ เซอร์วิส จำกัด (มหาชน)			1,116,500.00	6.00
ธุรกิจการเงิน				
เงินทุนและหลักทรัพย์				
บริษัท บัตรกรุงไทย จำกัด (มหาชน)			571,875.00	3.07
ธนาคาร				
ธนาคารกรุงเทพ จำกัด (มหาชน)			1,132,950.00	6.09
ธนาคารกสิกรไทย จำกัด (มหาชน)			1,192,100.00	6.41
ธนาคารทหารไทยชนชาติ จำกัด (มหาชน)			1,076,699.00	5.79
บริษัท ทีเอสโก้ไฟแนนเชียลกรุ๊ป จำกัด (มหาชน)			537,625.00	2.89
บริษัท เอสซีบี เอกซ์ จำกัด (มหาชน)			1,144,800.00	6.15
บริการ				
การแพทย์				
บริษัท กรุงเทพดุสิตเวชการ จำกัด(มหาชน)			1,039,500.00	5.59

รายละเอียดการลงทุน	อันดับความน่าเชื่อถือ		มูลค่ายุติธรรม	%NAV
	ของตราสาร	ผู้ออก/ค้ำประกัน		
ขนส่งและโลจิสติกส์				
บริษัท ทางด่วนและรถไฟฟ้ากรุงเทพ จำกัด (มหาชน)			543,220.00	2.92
พาณิชย์				
บริษัท ซีพี ออลล์ จำกัด (มหาชน)			1,196,000.00	6.43
บริษัท เซ็นทรัล รีเทล คอร์ปอเรชั่น จำกัด (มหาชน)			1,037,000.00	5.57
บริษัท สยามโกลบอลเฮ้าส์ จำกัด (มหาชน)			588,702.40	3.16
บริษัท โฮม โปรดักส์ เซ็นเตอร์ จำกัด (มหาชน)			1,028,580.00	5.53
อสังหาริมทรัพย์และก่อสร้าง				
พัฒนาอสังหาริมทรัพย์				
บริษัท เซ็นทรัลพัฒนา จำกัด (มหาชน)			1,047,675.00	5.63
บริษัท ดับบลิวเอชเอ คอร์ปอเรชั่น จำกัด (มหาชน)			611,490.00	3.29
วัสดุก่อสร้าง				
บริษัท ปูนซิเมนต์ไทย จำกัด (มหาชน)			991,200.00	5.33
สินทรัพย์อื่นหรือหนี้สินอื่น			(39,822.99)	(0.21)
มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ			18,607,149.95	100.00

รายงานสรุปเงินลงทุนในตราสารแห่งหนี้ เงินฝาก หรือตราสารกึ่งหนี้กึ่งทุน

ข้อมูล ณ วันที่ 31 พฤษภาคม 2567

กลุ่มของตราสาร	มูลค่าตามราคาตลาด	%NAV
(ก) ตราสารภาครัฐ ได้แก่ ตัวแลกเงิน พันธบัตรรัฐบาล พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย พันธบัตร หรือ ตราสารแห่งหนี้ที่กองทุนเพื่อการฟื้นฟูและพัฒนา	-	-
(ข) ตราสารที่ธนาคารที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้น ธนาคารพาณิชย์ หรือบริษัทเงินทุนเป็นผู้ออก ผู้รับรอง ผู้รับอวัล ผู้สลับหลัง หรือผู้ค้ำประกัน	1,214,936.54	6.53
(ค) ตราสารที่มีบริษัทที่ได้รับ rating ในระดับ investment grade เป็นผู้ออก ผู้รับรอง ผู้รับอวัล ผู้สลับหลัง หรือผู้ค้ำประกัน	-	-
(ง) ตราสารที่มีอันดับความน่าเชื่อถืออยู่ในอันดับต่ำกว่าอันดับที่สามารถลงทุนได้ (investment grade) หรือตราสารที่ไม่ได้จัดอันดับความน่าเชื่อถือ	-	-

รายละเอียดตัวตราสารและอันดับความน่าเชื่อถือของตราสารแห่งหนี้ เงินฝาก หรือตราสารกึ่งหนี้กึ่งทุนที่กองทุนลงทุนหรือมีไว้เป็นรายตัว

ประเภท	ผู้ออก	วันครบกำหนด	อันดับความน่าเชื่อถือ		มูลค่าที่ตราไว้	มูลค่ายุติธรรม
			ตราสาร	ผู้ออก/ค้ำประกัน		
เงินฝากธนาคาร	ธนาคารกรุงเทพ จำกัด (มหาชน)			AA+(tha)	-	1,214,936.54

สัดส่วนเงินลงทุนขั้นสูงต่อมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุนที่บริษัทจัดการตั้งไว้ในแผนการลงทุนสำหรับกลุ่มตราสาร

ตาม (ง) เท่ากับ 15% NAV

คำอธิบายการจัดอันดับความน่าเชื่อถือของสถาบันจัดอันดับความน่าเชื่อถือ

บริษัท ฟิทช์ เรทติ้งส์ (ประเทศไทย) จำกัด

อันดับความน่าเชื่อถือระยะยาวสำหรับประเทศไทย

- AAA(tha) แสดงถึงอันดับเครดิตขั้นสูงสุดของอันดับเครดิตภายในประเทศสำหรับประเทศไทย โดยอันดับเครดิตนี้จะให้กับผู้ออกตราสารหนี้หรือตัวตราสารหนี้ ที่คาดว่าจะมีความเสี่ยงของการผิดนัดชำระหนี้ต่ำที่สุดเมื่อเปรียบเทียบกับผู้ออกตราสารหนี้หรือตัวตราสารหนี้อื่นๆ ในประเทศไทย
- AA(tha) อันดับเครดิตภายในประเทศ 'AA(tha)' จะให้กับผู้ออกตราสารหนี้หรือตัวตราสารหนี้ ที่คาดว่าจะมีความเสี่ยงของการผิดนัดชำระหนี้ที่ต่ำมากเมื่อเปรียบเทียบกับผู้ออกตราสารหนี้หรือตัวตราสารหนี้อื่นๆ ในประเทศไทย โดยความเสี่ยงของการผิดนัดชำระหนี้สำหรับอันดับเครดิตภายในประเทศที่ระดับ 'AA(tha)' จะแตกต่างจากความเสี่ยงของการผิดนัดชำระหนี้ของผู้ออกตราสารหนี้หรือตัวตราสารหนี้ที่ได้รับอันดับเครดิตภายในประเทศในลำดับสูงสุดเพียงเล็กน้อย
- A(tha) อันดับเครดิตภายในประเทศ 'A(tha)' จะให้กับผู้ออกตราสารหนี้หรือตัวตราสารหนี้ ที่คาดว่าจะมีความเสี่ยงของการผิดนัดชำระหนี้ที่ต่ำเมื่อเปรียบเทียบกับผู้ออกตราสารหนี้หรือตัวตราสารหนี้อื่นๆ ในประเทศไทย อย่างไรก็ตาม การเปลี่ยนแปลงของสถานการณ์หรือสภาพทางเศรษฐกิจ อาจมีผลกระทบต่อความสามารถในการชำระหนี้ได้ตรงตามกำหนดของตราสารทางการเงินเหล่านี้ มากกว่าตราสารอื่นที่ได้รับการจัดอันดับเครดิตที่สูงกว่า
- BBB(tha) อันดับเครดิตภายในประเทศ 'BBB(tha)' จะให้กับผู้ออกตราสารหนี้หรือตัวตราสารหนี้ ที่คาดว่าจะมีความเสี่ยงของการผิดนัดชำระหนี้ปานกลางเมื่อเปรียบเทียบกับผู้ออกตราสารหนี้หรือตัวตราสารหนี้อื่นๆ ในประเทศไทย อย่างไรก็ตาม การเปลี่ยนแปลงของสถานการณ์หรือสภาพทางเศรษฐกิจ จะมีผลกระทบต่อความสามารถในการชำระหนี้ได้ตรงตามกำหนดเวลาของตราสารทางการเงินเหล่านี้ มากกว่าตราสารหนี้อื่นที่ได้รับการจัดอันดับเครดิตที่สูงกว่า

อันดับความน่าเชื่อถือระยะสั้นสำหรับประเทศไทย

- F1(tha) แสดงถึงระดับความสามารถสูงสุดในการชำระหนี้ได้ตรงตามกำหนดเวลาที่ระบุไว้ในข้อผูกพันทางการเงิน เมื่อเปรียบเทียบกับผู้ออกตราสารหนี้หรือตัวตราสารหนี้อื่นๆ ในประเทศไทย ภายใต้ระบบการจัดอันดับเครดิตภายในประเทศซึ่งกำหนดโดยฟิทช์ อันดับเครดิตในระดับนี้จะให้กับผู้ออกตราสารหนี้หรือตัวตราสารหนี้ ที่มีความเสี่ยงของการผิดนัดชำระหนี้ต่ำที่สุดเมื่อเปรียบเทียบกับผู้ออกตราสารหนี้หรือตัวตราสารหนี้อื่นๆ ในประเทศไทย ในกรณีที่สภาพคล่องอยู่ในระดับที่แข็งแกร่งเป็นพิเศษจะมีสัญลักษณ์ "+" แสดงไว้เพิ่มเติมจากอันดับเครดิตที่ให้ไว้
- F2(tha) แสดงถึงระดับความสามารถในการชำระหนี้ได้ตรงตามกำหนดเวลาที่ระบุไว้ในข้อผูกพันทางการเงินในระดับที่ดี เมื่อเปรียบเทียบกับผู้ออกตราสารหนี้หรือตัวตราสารหนี้อื่นๆ ในประเทศไทย อย่างไรก็ตาม ระดับของความน่าเชื่อถือดังกล่าวยังไม่อาจเทียบเท่ากับกรณีที่ได้รับการจัดอันดับเครดิตที่สูงกว่า
- F3(tha) 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 18 ธันวาคม 2566 (วันจดทะเบียนจัดตั้งกองทุน) ถึง 31 พฤษภาคม 2567

ค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม * (Fund's Direct Expenses)	จำนวนเงิน หน่วย : พันบาท	ร้อยละของ มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ
ค่าธรรมเนียมการจัดการ (Management Fee)	129.62	0.73
ค่าธรรมเนียมผู้ดูแลผลประโยชน์ (Trustee Fee)	1.73	0.01
ค่าธรรมเนียมนายทะเบียนหน่วย (Registrar Fee)	6.05	0.03
ค่าใช้จ่ายอื่นๆ (Other Expenses)	19.41	0.11
รวมค่าใช้จ่ายทั้งหมด (Total Fund's Direct Expenses)**	156.81	0.88

* ค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายที่หักจากกองทุนรวมได้รวมภาษีมูลค่าเพิ่มแล้ว

** ไม่รวมค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์และค่าธรรมเนียมต่างๆ ที่เกิดขึ้นจากการซื้อขายหลักทรัพย์และภาษีเงินได้จากการลงทุนในตราสารหนี้

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุนของกองทุน (Portfolio Turnover Ratio : “PTR”)

สำหรับระยะเวลา 6 เดือน ตั้งแต่วันที่ 18 ธันวาคม 2566 (วันจดทะเบียนจัดตั้งกองทุน) ถึง 31 พฤษภาคม 2567

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

$$\text{PTR} = \frac{62,999.90}{17,650,131.44}$$

$$\text{PTR} = 0.00$$

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

ค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์

สำหรับระยะเวลา 6 เดือน ตั้งแต่วันที่ 18 ธันวาคม 2566 (วันจดทะเบียนจัดตั้งกองทุน) ถึง 31 พฤษภาคม 2567

ลำดับ	ชื่อบริษัทนายหน้า	ค่านายหน้า(บาท)	อัตราส่วนค่านายหน้า แต่ละรายต่อค่า นายหน้าทั้งหมด
1	บริษัทหลักทรัพย์ กรุงศรี พัฒนสิน จำกัด (มหาชน)	6,487.56	30.06%
2	บริษัทหลักทรัพย์ กรุงศรี จำกัด (มหาชน)	4,740.83	21.97%
3	บริษัทหลักทรัพย์ เคจีไอ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)	3,982.74	18.46%
4	บริษัทหลักทรัพย์ หยวนต้า (ประเทศไทย) จำกัด	1,775.90	8.23%
5	บริษัทหลักทรัพย์ เอเซีย พลัส จำกัด	1,276.41	5.91%
6	บริษัทหลักทรัพย์ ทิสโก้ จำกัด	1,028.95	4.77%
7	บริษัทหลักทรัพย์ บัวหลวง จำกัด (มหาชน)	637.67	2.96%
8	บริษัทหลักทรัพย์ ดาโอ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)	581.57	2.70%
9	บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)	566.06	2.62%
10	บริษัทหลักทรัพย์ ซีจีเอส อินเตอร์เนชั่นแนล (ประเทศไทย) จำกัด **	501.11	2.32%
รวม*		21,578.80	100.00%

* ค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ยังไม่รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม

** บริษัทหลักทรัพย์ ซีจีเอส ซีไอเอ็มบี (ประเทศไทย) จำกัด ชื่อย่อ CGSCIMB ได้มีการเปลี่ยนชื่อเป็น บริษัทหลักทรัพย์ ซีจีเอส อินเตอร์เนชั่นแนล (ประเทศไทย) จำกัด ชื่อย่อ CGSI โดยมีผลตั้งแต่วันที่ 12 กุมภาพันธ์ 2567 เป็นต้นไป

การรับผลประโยชน์ตอบแทนเนื่องจากการที่กองทุนใช้บริการบุคคลอื่น (Soft Commission)

สำหรับระยะเวลา 6 เดือน ตั้งแต่วันที่ 18 ธันวาคม 2566 (วันจดทะเบียนจัดตั้งกองทุน) ถึง 31 พฤษภาคม 2567

ชื่อย่อ	บริษัทนายหน้าที่ให้ผลประโยชน์	การรับทวิจ้ย รวมทั้งข้อมูล ข่าวสารอื่น ๆ	จัดสรร/ จัดเก็บค่าธรรมเนียมบริษัท	การได้รับสิทธิ ในการจองหุ้น	การได้รับระบบ ข้อมูลราคาซื้อขาย หลักทรัพย์
ASP	บล. เอเชีย พลัส จำกัด	/	/		
BLS	บล. บัวหลวง จำกัด (มหาชน)	/	/		
CGSI	บล.ซีจีเอส อินเตอร์เนชั่นแนล (ประเทศไทย) จำกัด *	/	/	/	
KCS	บล. กรุงศรี พัฒนสิน จำกัด (มหาชน)	/	/		
DAOLSEC	บล. ดาโอ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)	/	/		
DBSV	บล. ดีบีเอส วิกเคอร์ส (ประเทศไทย) จำกัด	/	/		
FSS	บล. ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)	/	/		
INVX	บล. อินโนเวสต์ เอ็กซ์ จำกัด	/	/		
KGI	บล. เคจีไอ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)	/	/		/
KKPS	บล. เกียรตินาคินภัทร จำกัด (มหาชน)	/	/		
KSS	บล. กรุงศรี จำกัด (มหาชน)	/	/		
MST	บล. เมย์แบงก์ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)	/	/		/
TISCO	บล. ทิสโก้ จำกัด	/	/		
TNS	บล. ธนชาด จำกัด (มหาชน)	/	/		/
UOBKH	บล. ยูโอบี เคย์เฮียน (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)	/			
PST	บล. ฟิลลิป (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)	/			
YUANTA	บล. หยวนต้า (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)	/	/		

* บริษัทหลักทรัพย์ ซีจีเอส ซีไอเอ็มบี (ประเทศไทย) จำกัด ชื่อย่อ CGSCIMB ได้มีการเปลี่ยนชื่อเป็น บริษัทหลักทรัพย์ ซีจีเอส อินเตอร์เนชั่นแนล (ประเทศไทย) จำกัด ชื่อย่อ CGSI โดยมีผลตั้งแต่วันที่ 12 กุมภาพันธ์ 2567 เป็นต้นไป

เงื่อนไขและหลักเกณฑ์การรับผลประโยชน์ตอบแทน

บริษัทจัดการอาจรับผลประโยชน์ตอบแทนเพื่อกองทุนจากบุคคลที่เป็นผู้ให้บริการอันเนื่องมาจากการใช้บริการของบุคคลดังกล่าวในการจัดการกองทุนได้ แต่ต้องเป็นไปตามหลักเกณฑ์ดังต่อไปนี้

1. ผลประโยชน์ตอบแทนที่รับไว้นั้นต้องเป็นทรัพย์สินที่มีมูลค่าในทางเศรษฐกิจและต้องเกี่ยวกับบทบาทโดยตรงของความเป็นกองทุนตามกฎหมายว่าด้วยหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ และ
2. ต้องไม่มีพฤติกรรมที่แสดงให้เห็นว่าบริษัทจัดการใช้บริการของบุคคลนั้นบ่อยครั้งเกินความจำเป็นเพื่อให้กองทุนได้รับประโยชน์จากบุคคลดังกล่าว (Churning)

ในการจัดสรรผลประโยชน์ตามวรรคหนึ่งให้แก่กองทุนที่อยู่ภายใต้การบริหารจัดการของบริษัทจัดการ บริษัทต้องกระทำด้วยความเป็นธรรมและคำนึงถึงลักษณะและประเภทหลักทรัพย์ที่อาจมีไว้ได้ของกองทุนนั้นด้วย

บริษัทจัดการไม่สามารถรับผลประโยชน์ตอบแทนเพื่อประโยชน์ของบริษัทเองได้ เนื่องจากเป็นข้อห้ามตามกฎหมายและเป็นเรื่องที่ไม่พึงกระทำโดยวิชาชีพ เว้นแต่เป็นการรับผลประโยชน์ที่บริษัทจัดการหรือพนักงานของบริษัทจัดการได้รับตามเทศกาลที่เป็นประเพณีนิยมตามแนวทางปฏิบัติที่บริษัทจัดการกำหนดไว้ภายในบริษัทซึ่งลูกค้าสามารถขอข้อมูลแนวทางนี้ได้ที่ www.talisam.co.th

รายงานชื่อบุคคลที่เกี่ยวข้องที่กองทุนเข้าทำธุรกรรม

กองทุนเปิด MEGA 20 ไทยเพื่อความยั่งยืน ไม่มีรายการทำธุรกรรมกับบุคคลที่เกี่ยวข้อง ข้อมูลระหว่างวันที่ 18 ธันวาคม 2566 (วันจดทะเบียนจัดตั้งกองทุน) ถึง 31 พฤษภาคม 2567

รายงานการถือหน่วยลงทุนเกินข้อจำกัดการใช้สิทธิออกเสียง

กองทุนเปิด MEGA 20 ไทยเพื่อความยั่งยืน ไม่มีการถือหน่วยลงทุนเกิน 1 ใน 3 โดยบุคคลใดบุคคลหนึ่ง ข้อมูล ณ วันที่ 31 พฤษภาคม 2567

ผู้ลงทุนสามารถตรวจสอบรายละเอียดการทำธุรกรรมกับบุคคลที่เกี่ยวข้องกับกองทุนรวมและรายงานการถือหน่วยลงทุนเกินข้อจำกัดการใช้สิทธิออกเสียงได้ที่ บริษัทจัดการโดยตรง 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