

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ทาลิส จำกัด

ข้อมูล ณ วันที่ 26 ส.ค. 2569

## กองทุนเปิดทาลิส พันธบัตรรัฐบาลสหรัฐ ระยะสั้น

TLUSGOV

### ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนตราสารหนี้ / กองทุนรวมฟีดเดอร์ (Feeder Fund) / กองทุนรวมที่เน้นลงทุนแบบมีความเสี่ยงต่างประเทศ
- กลุ่ม Global Bond Discretionary F/X Hedge or Unhedge

### นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- ลงทุนในกองทุนต่างประเทศเพียงกองทุนเดียว คือ iShares® 0-3 Month Treasury Bond ETF (กองทุนหลัก) โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV
- กองทุนหลักเป็นกองทุน ETF ภายใต้การบริหารจัดการของ BlackRock Fund Advisors ที่มีวัตถุประสงค์เพื่อสร้างผลตอบแทนการลงทุนให้สอดคล้องกับดัชนี ICE® 0-3 Month US Treasury Securities Index (ดัชนีอ้างอิง) ซึ่งเป็นดัชนีที่วัดผลการดำเนินงานของพันธบัตรรัฐบาลสหรัฐฯ ที่มีอายุคงเหลือ 0-3 เดือน
- กองทุนหลักจะใช้แนวทางการลงทุนแบบการบริหารจัดการเชิงรับ (Passive Management) หรือเป็นกองทุนดัชนี (Indexing) ที่ใช้วิธีการเลียนแบบดัชนี (Replication Methodology) โดยกองทุนจะเข้าลงทุนในหลักทรัพย์ทั้งหมดที่เป็นองค์ประกอบของดัชนีอ้างอิงเท่าที่สามารถจะทำได้
- กองทุนจะไม่ลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivative) เพื่อลดความเสี่ยง (Hedging) ด้านอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ และเพื่อเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน
- กองทุนไทยมุ่งหวังให้ผลประโยชน์การเคลื่อนไหวตามกองทุนหลัก ส่วนกองทุนหลักมุ่งหวังให้ผลประโยชน์การเคลื่อนไหวตามดัชนีชี้วัด (passive management)

### ระดับความเสี่ยง

ต่ำ 1 2 3 4 5 6 7 8 สูง

เสี่ยงปานกลางค่อนข้างต่ำ

ลงทุนในพันธบัตรรัฐบาลเป็นหลัก โดยเฉลี่ยในรอบปีไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV

### ข้อมูลกองทุนรวม

|                                           |                       |
|-------------------------------------------|-----------------------|
| วันจดทะเบียนกองทุน                        | วันที่ 4 กันยายน 2569 |
| นโยบายการจ่ายเงินปันผล                    | ไม่จ่าย               |
| อายุกองทุน                                | ไม่กำหนด              |
| การป้องกันความเสี่ยง FX                   | ไม่ป้องกัน (unhedged) |
| การเรียกเก็บค่าธรรมเนียมตามผลการดำเนินงาน | ไม่มี                 |

### ผู้จัดการกองทุนรวม

นาย ธนบดี รัตนชูวงศ์ (ตั้งแต่วันจดทะเบียน)  
นาย วีระพล สิมะโรจน์ (ตั้งแต่วันจดทะเบียน)

### ดัชนีชี้วัด :

ผลการดำเนินงานของกองทุนรวมหลัก สัดส่วน 100% ปรับด้วยอัตราแลกเปลี่ยนเพื่อคำนวณผลตอบแทนเป็นสกุลเงินบาท ณ วันที่คำนวณผลตอบแทน  
วัตถุประสงค์ในการอ้างอิงดัชนีชี้วัด : เพื่อเปรียบเทียบกับผลการดำเนินงานของกองทุน

### ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (%ต่อปี)

ยังไม่มีข้อมูล

### ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด (%ต่อปี\*)

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

|                          |     |     |     |     |
|--------------------------|-----|-----|-----|-----|
| กองทุน                   | N/A | N/A | N/A | N/A |
| ดัชนีชี้วัด              | N/A | N/A | N/A | N/A |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน | N/A | N/A | N/A | N/A |
| ความผันผวนกองทุน         | N/A | N/A | N/A | N/A |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด    | N/A | N/A | N/A | N/A |

### คำเตือน

การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน

ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวม มิได้เป็นสิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต: ได้รับการรับรองจาก CAC

จัดอันดับกองทุน Morningstar

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

"ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือ  
บริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่อง  
ได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม"



www.talisam.co.th

|                                                                                                                                                                                                  |                                                                                                                                                                                                                              |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <p><b>การซื้อขายหน่วยลงทุน</b></p> <p>วันทำการซื้อ : ทุกวันทำการ</p> <p>เวลาทำการ : 8.30 น. - 15.30 น.</p> <p>การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ : 1,000 บาท</p> <p>การซื้อครั้งถัดไปขั้นต่ำ : 1,000 บาท</p> | <p><b>การขายคืนหน่วยลงทุน</b></p> <p>วันทำการขายคืน : ทุกวันทำการ</p> <p>เวลาทำการ : 8.30 น. - 15.30 น.</p> <p>การขายคืนขั้นต่ำ : ไม่กำหนด</p> <p>ยอดคงเหลือขั้นต่ำ : ไม่กำหนด</p> <p>ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน : T+2*</p> |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

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

**ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)** ค่าธรรมเนียมต่อไปนี้จะส่งผลกระทบต่อผู้ลงทุน เนื่องจากจะทำให้ผลตอบแทนจากการลงทุนลดลง ดังนั้น ผู้ลงทุนควรตรวจสอบทุกครั้งก่อนตัดสินใจลงทุน

| ค่าธรรมเนียม                                                   | สูงสุดไม่เกิน | เก็บจริง |
|----------------------------------------------------------------|---------------|----------|
| การจัดการ                                                      | 2.1400        | 0.0963   |
| ค่าตอบแทนแก่ตัวแทนขายหน่วยลงทุนของกองทุนรวม (trailer fee) : มี |               |          |
| รวมค่าใช้จ่าย                                                  | 4.6010        | 0.2568*  |

หมายเหตุ 1) คำนวณธรรมเนียมหรือค่าใช้จ่ายดังกล่าวได้รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะ หรือภาษีอื่นใดแล้ว 2) ค่าใช้จ่ายรวมที่เรียกเก็บจริง ยังไม่รวมค่าใช้จ่ายอื่น 3) สามารถลดค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวมย้อนหลัง 3 ปี ในหนังสือชี้ชวนส่วนข้อมูลกองทุนรวมได้ที่ [www.talisam.co.th](http://www.talisam.co.th)

4) บริษัทอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ

| ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหุ้นหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย) ผู้ลงทุนจะถูกเรียกเก็บ |                     |                     |
|----------------------------------------------------------------------------------------|---------------------|---------------------|
| ค่าธรรมเนียมต่อไปนี้จะตรงทุกครั้งเมื่อทำการซื้อขายหรือปรับเปลี่ยนหน่วยลงทุน            |                     |                     |
| ค่าธรรมเนียม                                                                           | สูงสุดไม่เกิน       | เก็บจริง            |
| การขาย                                                                                 | 1.50                | ยกเว้น              |
| การรับซื้อคืน                                                                          | 1.50                | ยกเว้น              |
| การปรับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า                                                           | 1.50                | ยกเว้น              |
| การปรับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก                                                            | 1.50                | ยกเว้น              |
| การโอนหน่วย*                                                                           | 100 บาท/1,000 หน่วย | 100 บาท/1,000 หน่วย |

หมายเหตุ (1) ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ซื้อซึ่งได้รับภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะ หรือภาษีอื่นใดแล้ว โดยบริษัทจัดการอาจเรียกเก็บค่าธรรมเนียมจากผู้ลงทุนโดยตรง (2) ค่าธรรมเนียมการขาย/การรับซื้อคืน/การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุน บริษัทจัดการอาจคิดค่าธรรมเนียมดังกล่าวกับผูกลงทุนแต่ละกลุ่มไม่เท่ากัน โดยบริษัทจัดการจะแจ้งให้ผู้ลงทุนทราบรายละเอียดต่อไป (3)\* ค่าธรรมเนียมการโอนหน่วย 100 บาท/1,000 หน่วยลงทุนขั้นต่ำ 500 บาท

| สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน | ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก |
|--------------------------------|-------------------------------|
| breakdown                      | holding                       |

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

## การจัดสรรการลงทุนในต่างประเทศ

| country | % NAV |
|---------|-------|
|---------|-------|

# การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม

| sector | % NAV |
|--------|-------|
|--------|-------|

## การลงทุนในกองทุนอื่นเกินกว่า 20% (กองในประเทศและกองต่างประเทศ)

ชื่อย่อ : iShares® 0-3 Month Treasury Bond ETF

ISIN code : US46436E7186

Bloomberg code : GATX

## คำอธิบาย

**Maximum Drawdown** เพอร์เซ็นต์ผลขาดทุนสูงสุดของกองทุนรวมในระยะเวลา 5 ปีย้อนหลัง (หรือตั้งแต่จัดตั้งกองทุนกรณีที่ยังไม่ครบ 5 ปี) โดยวัดจากระดับ NAV ต่อหน่วยที่จุดสูงสุดไปจนถึงจุดต่ำสุดในช่วงที่ NAV ต่อหน่วยปรับตัวลดลง ค่า Maximum Drawdown เป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงความเสี่ยงที่อาจจะขาดทุนจากการลงทุนในกองทุนรวม

**Recovering Period** ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาดังแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลานานเท่าใด

**FX Hedging** เพอร์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

**อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน** ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตกองทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลาหนึ่ง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์กับผลรวมของมูลค่าการขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 1 ปี ทหารด้วยมูลค่า NAV ของกองทุนรวมเฉลี่ยในรอบระยะเวลาเดียวกัน กองทุนรวมที่มีค่า portfolio turnover สูง บ่งชี้ถึงการซื้อขายหลักทรัพย์บ่อยครั้งของผู้จัดการกองทุนและทำให้มีต้นทุนการซื้อขายหลักทรัพย์ที่สูง จึงต้องพิจารณาเปรียบเทียบกับผลการดำเนินงานของกองทุนรวมเพื่อประเมินความคุ้มค่าของการซื้อขายหลักทรัพย์ดังกล่าว

**Sharpe Ratio** อัตราส่วนระหว่างผลตอบแทนส่วนเพิ่มของกองทุนรวมเปรียบเทียบกับความเสี่ยงจากการลงทุน โดยคำนวณจากผลต่างระหว่างอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมกับอัตราผลตอบแทนที่ปราศจากความเสี่ยง (risk-free rate) เปรียบเทียบกับค่าเบี่ยงเบนมาตรฐาน (standard deviation) ของกองทุนรวม ค่า Sharpe Ratio สะท้อนถึงอัตราผลตอบแทนที่กองทุนรวมควรได้รับเพิ่มขึ้นเพื่อชดเชยกับความเสี่ยงที่กองทุนรวมรับมา โดยกองทุนรวมที่มีค่า Sharpe Ratio สูงกว่าจะเป็นกองทุนที่มีประสิทธิภาพในการบริหารจัดการลงทุนที่ดีกว่า เนื่องจากได้รับผลตอบแทนส่วนเพิ่มที่สูงกว่าภายใต้ระดับความเสี่ยงเดียวกัน

**Alpha** ผลตอบแทนส่วนเกินของกองทุนรวมเมื่อเปรียบเทียบกับดัชนีชี้วัด (benchmark) โดยค่า Alpha ที่สูง หมายถึง กองทุนสามารถสร้างผลตอบแทนได้สูงกว่าดัชนีชี้วัด ซึ่งเป็นผลจากประสิทธิภาพของผู้จัดการกองทุนในการคัดเลือกหรือหาจังหวะเข้าลงทุนในหลักทรัพย์ได้อย่างเหมาะสม

**Beta** ระดับและทิศทางการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุน โดยเปรียบเทียบกับอัตราการเปลี่ยนแปลงของตลาด

Beta น้อยกว่า 1 แสดงว่าหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนน้อยกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด

Beta มากกว่า 1 แสดงว่าหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนมากกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด

**Tracking Error** อัตราผลตอบแทนของกองทุนมีประสิทธิภาพในการเลียนแบบดัชนีชี้วัด โดยหาก tracking error ต่ำ หมายถึงกองทุนรวมมีประสิทธิภาพในการสร้างผลตอบแทนให้ใกล้เคียงกับดัชนีชี้วัด กองทุนรวมที่มีค่า tracking error สูง จะมีอัตราผลตอบแทนโดยเฉลี่ยห่างจากดัชนีชี้วัดมากขึ้น

**Yield to Maturity** อัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในตราสารหนี้โดยถือจนครบกำหนดอายุ ซึ่งคำนวณจากดอกเบี้ยที่จะได้รับในอนาคตตลอดอายุตราสารและเงินต้นที่จะได้รับคืน นำมาคิดลดเป็นมูลค่าปัจจุบัน โดยใช้วัดอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมตราสารหนี้ คำนวณจากค่าเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักของ Yield to Maturity ของตราสารหนี้แต่ละตัวที่กองทุนมีการลงทุน และเนื่องจาก Yield to Maturity มีหน่วยมาตรฐานเป็นเปอร์เซ็นต์ต่อปี จึงสามารถนำไปใช้เปรียบเทียบอัตราผลตอบแทนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีนโยบายถือครองตราสารหนี้จนครบกำหนดอายุและมีลักษณะการลงทุนที่ใกล้เคียงกันได้

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ทาลิส จำกัด

โทรศัพท์: 02 015 0222 [www.talisam.co.th](http://www.talisam.co.th)

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