

กองทุนเปิดทาลิส หุ้นระยะยาว

TLLTFEQ

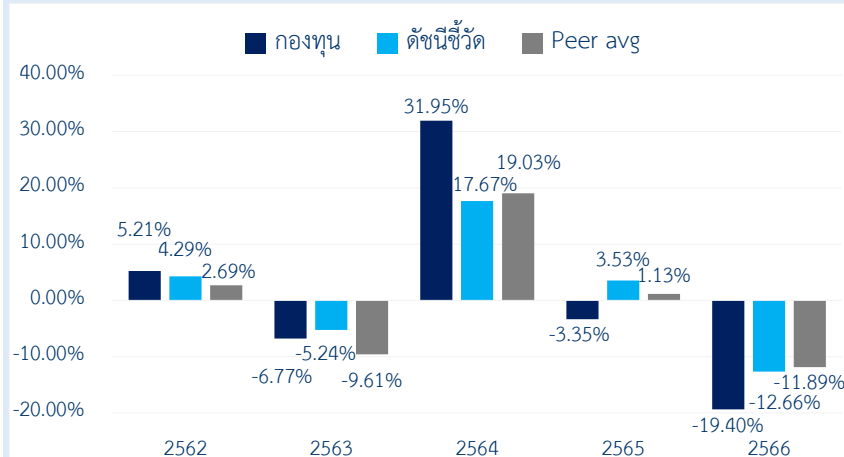
ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมตราสารทุน
- กองทุนรวมหุ้นระยะยาว (Long Term Equity Fund: LTF)
- กลุ่ม Equity General

นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- ลงทุนในหุ้นสามัญของบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย และหรือ MAI ตราสารทุน หน่วยลงทุนของกองทุนรวม ตราสารทุนที่ลงทุนในหุ้นของบริษัทจดทะเบียน กองทุนรวมอสังหาริมทรัพย์ที่อ้างอิงกับ ผลตอบแทนหุ้นหรือกลุ่มหุ้นของบริษัทจดทะเบียน กองทุนรวมดัชนีที่อ้างอิงกับผลตอบแทนหุ้นหรือกลุ่มหุ้นของบริษัทจดทะเบียน หรือสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) ที่อ้างอิงกับผลตอบแทนของหุ้นหรือกลุ่มหุ้นของบริษัทจดทะเบียน
- มุ่งหวังให้ผลประกอบการสูงกว่าดัชนีชี้วัด (Active Management)

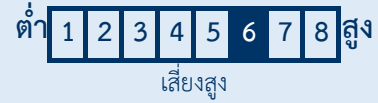
ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (%ต่อปี)



ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปีกumul (%ต่อปี)

	YTD	3 เดือน	6 เดือน	1 ปี ¹
กองทุน	-12.65	-9.30	-12.65	-18.45
ดัชนีชี้วัด	-6.07	-4.53	-6.07	-10.57
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	-6.40	-4.68	-6.40	-10.13
ความผันผวนกองทุน	13.63	13.36	13.63	14.93
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	10.14	10.38	10.14	10.95
	3 ปี ¹	5 ปี ¹	10 ปี ¹	ตั้งแต่จัดตั้ง ¹
กองทุน	-9.02	-5.40	N/A	-2.36
ดัชนีชี้วัด	-3.66	-2.63	N/A	1.13
ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน	-4.17	-3.52	N/A	N/A
ความผันผวนกองทุน	15.83	19.50	N/A	17.22
ความผันผวนดัชนีชี้วัด	11.13	16.76	N/A	14.63

ระดับความเสี่ยง



ลงทุนในตราสารทุน โดยเฉลี่ยในรอบปีไม่น้อยกว่า 65% ของ NAV

ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน	9 พ.ย. 2559
นโยบายการจ่ายเงินปันผล	ไม่จ่าย
อายุกองทุน	ไม่กำหนด

ผู้จัดการกองทุนรวม

นาย วีระพล สิมะโรจน์ (ตั้งแต่ 9 พ.ย. 2559)
 น.ส. ปวีเรศร์ ตั้งอภิชาติเจริญ (ตั้งแต่ 9 พ.ย. 2559)

ดัชนีชี้วัด :

ดัชนีผลตอบแทนรวมตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET TRI) สัดส่วน 100% เพื่อเปรียบเทียบกับผลการดำเนินงานของกองทุน

คำเตือน

- การลงทุนไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีต มิได้เป็นสิ่งยืนยันผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต: ได้รับการรับรองจาก CAC
 จัดอันดับกองทุน Morningstar

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

"ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือ
 บริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่อง
 ได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม"



www.talisam.co.th

การซื้อขายหน่วยลงทุน		ข้อมูลเชิงสถิติ	
วันทำการซื้อ : ทุกวันทำการ	วันทำการขายคืน : ทุกวันทำการ	Maximum Drawdown	-44.66%
เวลาทำการ : 8.30 น. - 15.30 น.	เวลาทำการ : 8.30 น. - 15.30 น.	Recovering Period	11 เดือน 14 วัน
การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ : 1,000 บาท	การขายคืนขั้นต่ำ : ไม่กำหนด	อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน	0.67 เท่า
การซื้อครั้งถัดไปขั้นต่ำ : 1,000 บาท	ยอดคงเหลือขั้นต่ำ : ไม่กำหนด	Sharpe Ratio	-0.64
	ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน : T+3	Alpha	-5.37
		Beta	1.12

หมายเหตุ บริษัทจัดการปิดรับคำสั่งซื้อและ/หรือคำสั่งสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้าจากกองทุนรวมอื่นเป็นการถาวร (ยกเว้นการสับเปลี่ยนเข้าจากกองทุนรวมหุ้นระยะยาวที่ได้ลงทุนก่อนวันที่ 1 มกราคม 2563) โดยได้รับมติเสียงข้างมากจากผู้ถือหน่วยลงทุน มีผลตั้งแต่วันที่ 1 ตุลาคม 2563 เป็นต้นไป

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปีของ NAV)		
ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การจัดการ	3.2100	2.1400
รวมค่าใช้จ่าย	3.8520	2.2645

หมายเหตุ 1) ค่าธรรมเนียมหรือค่าใช้จ่ายดังกล่าวได้รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะ หรือภาษีอื่นใดแล้ว
2) สามารถดูค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวมย้อนหลัง 3 ปี ในหนังสือชี้ชวนข้อมูลกองทุนรวมได้ที่ www.talisam.co.th

ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย)		
ค่าธรรมเนียม	สูงสุดไม่เกิน	เก็บจริง
การขาย	3.00	ยกเว้น
การรับซื้อคืน	3.00	ยกเว้น
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า	ไม่มี	ไม่มี
การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก	ไม่มี	ไม่มี*
การโอนหน่วย	ไม่มี	ไม่มี

หมายเหตุ (1) ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือซื้อได้รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะ หรือภาษีอื่นใดแล้ว โดยบริษัทจัดการอาจเรียกเก็บค่าธรรมเนียมจากผู้ลงทุนโดยตรง (2) ค่าธรรมเนียมการขาย/การรับซื้อคืน/การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนอาจเรียกเก็บจากผู้ถือหน่วยลงทุนแต่ละกลุ่มในอัตราที่ไม่เท่ากัน โดยบริษัทจัดการจะแจ้งรายละเอียดและหลักเกณฑ์ให้ทราบต่อไป (3)* ค่าธรรมเนียมการสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนไปกองทุน LTF ภายใต้การจัดการของบลจ.อื่น : 200 บาทต่อการการโดยเรียกเก็บเป็นเงินสด

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน		ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก	
breakdown	% NAV	holding	% NAV
หุ้นสามัญ	96.63	บริษัท ฮานา ไมโครอิเล็กทรอนิกส์ จำกัด (มหาชน)	6.33
เงินฝากธนาคาร	4.45	บริษัท ซีพี ออลล์ จำกัด (มหาชน)	5.93
สินทรัพย์อื่นหรือหนี้สินอื่น	-1.08	บริษัท แอดวานซ์ อินโฟร์ เซอร์วิส จำกัด (มหาชน)	5.60
		บริษัท คอมเซเว่น จำกัด (มหาชน)	5.55
		ธนาคารกรุงเทพ จำกัด (มหาชน)	5.26

การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม	
sector	% NAV
บริการ	35.79
เทคโนโลยี	33.72
ธุรกิจการเงิน	10.28
อสังหาริมทรัพย์และก่อสร้าง	9.94
เกษตรและอุตสาหกรรมอาหาร	4.98

คำอธิบาย

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

Recovering Period ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาดังแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลานานเท่าใด

FX Hedging เปรอ์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตกองทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลานึง 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 จึงสามารถนำไปใช้เปรียบเทียบกับอัตราผลตอบแทนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีนโยบายถือครองตราสารหนี้จนครบกำหนดอายุและมีลักษณะการลงทุนที่ใกล้เคียงกันได้

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ทาลิส จำกัด

โทรศัพท์: 02 015 0222 www.talisam.co.th

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