

ข้อมูลจากการตรวจสอบบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน โชลาริส จำกัด*
 ในฐานะผู้รับใบอนุญาตประกอบธุรกิจหลักทรัพย์ประเภทการจัดการกองทุนรวมและกองทุนส่วนบุคคล
 เพียงวันที่ 31 มกราคม 2560

ประเด็นจากการตรวจสอบ	การติดตามแก้ไขของบริษัท	การดำเนินการ/สั่งการของสำนักงาน
1. การจัดการความเสี่ยงด้านฐานะการเงิน - ไม่มีประเด็นข้อสังเกต		
2. การจัดการความเสี่ยงด้านกองทุนรวม 2.1 ด้านการจัดการลงทุน บริษัทมีข้อบกพร่องอย่างมากเกี่ยวกับระบบงานในการวิเคราะห์คุณภาพของตราสารหนี้ประเภทที่ไม่มีการจัดอันดับความน่าเชื่อถือ (“ตราสาร unrated”) โดยบริษัทไม่ได้พิจารณาปัจจัยสำคัญที่มีผลต่อความสามารถในการชำระคืนเงินต้นและดอกเบี้ยของผู้ออกตราสาร (“issuer”) ทั้งปัจจัยเชิงคุณภาพ (qualitative) และปัจจัยเชิงปริมาณ (quantitative) เช่น ผลการดำเนินงาน ภาระหนี้สิน นโยบายและกลยุทธ์การประกอบธุรกิจ ประมาณการกระแสเงินสดของ issuer เมื่อครบอายุตราสาร ซึ่งทั้งหมดเป็นประเด็นที่สำนักงานเคยตั้งข้อสังเกตไว้ในการตรวจสอบเมื่อปี 2558 โดยจากการสุ่มตรวจสอบตราสาร unrated ที่กองทุนลงทุนของ issuer จำนวน 9 ราย ซึ่งคิดเป็นมูลค่าเงินลงทุนรวมประมาณ 6,359 ล้านบาท หรือคิดเป็นร้อยละ 49 ของมูลค่ารวมของตราสาร unrated ที่ บลจ. โชลาริส ลงทุน พบว่ามีข้อบกพร่องดังกล่าว (ข้อมูล ณ วันที่ 30 พฤศจิกายน 2559) ทั้งนี้ ณ วันที่ 2 สิงหาคม 2560 ตราสาร unrated ที่ บลจ. โชลาริส ลงทุน และไม่สามารถชำระคืนเงินต้นและดอกเบี้ยให้แก่กองทุนรวมได้ตามกำหนดมีจำนวนถึง 5 issuer มูลค่ารวมประมาณ 5,500 ล้านบาท การกระทำดังกล่าวอาจเข้าข่ายปฏิบัติไม่เป็นไปตามมาตรา 117 แห่งพระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535	บริษัทรับที่จะดำเนินการปรับปรุงแก้ไขตามที่สำนักงานสั่งการ ทั้งนี้ บริษัทไม่มีการลงทุนในตราสาร unrated เพิ่มเติม ตั้งแต่วันที่ 16 ธันวาคม 2559 แล้ว	สั่งการให้บริษัทบริหารจัดการลงทุนด้วยความระมัดระวังและรัดกุมเพิ่มมากขึ้น โดยใช้ความรู้ความสามารถและความชำนาญเยี่ยงผู้ประกอบการวิชาชีพพึงกระทำ เพื่อป้องกันมิให้มีการกระทำที่อาจเข้าข่ายปฏิบัติไม่เป็นไปตามที่กฎหมายกำหนดและก่อให้เกิดความเสียหายต่อผู้ลงทุน
2.2 ด้านลูกค้าสัมพันธ์ - ไม่มีประเด็นข้อสังเกต		
2.3 ด้านการปฏิบัติงาน - ไม่มีประเด็นข้อสังเกต		

ข้อมูล ณ วันที่ 7 มิถุนายน 2562

* ปัจจุบันเปลี่ยนชื่อเป็น บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน อินโนเทค จำกัด