

ภาคผนวก 4-UI

[แนบท้ายประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทน. 87/2558 ซึ่งแก้ไขเพิ่มเติม

โดยประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทน. 47/2567 (ฉบับที่ 29)]

อัตราส่วนการลงทุนของกองทุน UI

อัตราส่วนการลงทุนตามภาคผนวกนี้ใช้สำหรับการลงทุนของกองทุน UI เพื่อให้เป็นไปตามอัตราส่วนการลงทุนในเรื่อง product limit ดังนี้

ข้อ	ประเภทธุรกรรม	อัตราส่วน (% ของ NAV)
1	derivatives	ไม่เกินอัตราที่ระบุไว้ในโครงการ ¹
2	การกู้ยืมเงินหรือการทำ repo เพื่อประโยชน์ในการจัดการลงทุน ²	
3	การขายหลักทรัพย์ที่ต้องยืมหลักทรัพย์มาเพื่อการส่งมอบ (short sale)	
4	คริปโทแอสเซต (แต่ไม่รวมถึงการลงทุนในหน่วย Crypto ETF) โดยพิจารณาจาก net exposure จากการลงทุนดังกล่าว	ไม่เกิน 20%

¹ กองทุน UI จะลงทุนในธุรกรรมตามข้อ 1 - 3 ได้ต่อเมื่อต้องมีการระบุไว้อย่างชัดเจนในโครงการและเป็นไปตามข้อกำหนดในประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยรายละเอียดของโครงการจัดการกองทุนรวม

² เฉพาะการกู้ยืมเงินและการทำ repo เพื่อประโยชน์ในการจัดการลงทุนของกองทุน UI โดยเป็นไปตามเงื่อนไขและอัตราส่วน ($\leq 50\%$ ของ NAV) ที่กำหนดในประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยหลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการในการกู้ยืมเงินและการทำธุรกรรมการขายโดยมีสัญญาซื้อคืนในนามของกองทุนรวม