

ประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน

ที่ ทน. ๙/๒๕๖๘

เรื่อง การลงทุนของกองทุน

(ฉบับที่ ๓๐)

อาศัยอำนาจตามความในมาตรา ๑๖/๖ วรรคสอง (๑) แห่งพระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. ๒๕๓๕ ซึ่งแก้ไขเพิ่มเติมโดยพระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ (ฉบับที่ ๔) พ.ศ. ๒๕๕๑ และมาตรา ๑๑๗ แห่งพระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. ๒๕๓๕ คณะกรรมการกำกับตลาดทุนออกประกาศไว้ ดังต่อไปนี้

ข้อ ๑ ให้เพิ่มความต่อไปนี้เป็น (ข/๑) ของ (๑) ในวรรคหนึ่งของข้อ ๙ แห่งประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทน. ๘๗/๒๕๕๘ เรื่อง การลงทุนของกองทุน ลงวันที่ ๑๗ ธันวาคม พ.ศ. ๒๕๕๘ ซึ่งแก้ไขเพิ่มเติมโดยประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทน. ๔๗/๒๕๖๓ เรื่อง การลงทุนของกองทุน (ฉบับที่ ๑๘) ลงวันที่ ๒๐ กรกฎาคม พ.ศ. ๒๕๖๓

“(ข/๑) กรณีเป็นกองทุนรวมตาม (ก) หรือ (ข) ซึ่งมีได้เป็นกองทุนรวมอีทีเอฟ จะลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมอีทีเอฟที่มีกลยุทธ์ในการบริหารจัดการการลงทุนที่มุ่งหวังผลตอบแทนทวีคูณหรือตรงกันข้ามกับผลตอบแทนรายวันของดัชนีที่กองทุนรวมใช้อ้างอิง (leveraged management หรือ inverse management) หรือหน่วยของกองทุนต่างประเทศที่มีลักษณะในทำนองเดียวกัน ให้กระทำได้ต่อเมื่อได้กำหนดนโยบายการลงทุนของกองทุนรวมไว้ในโครงการว่าบริษัทจัดการกองทุนรวมสามารถลงทุนในทรัพย์สินดังกล่าวเพื่อเป็นเครื่องมือในการบริหารจัดการการลงทุนของกองทุนรวม (portfolio management)

กรณีกองทุนรวมตามวรรคหนึ่งเป็นกองทุนรวมฟิวเจอร์หรือกองทุนรวมหน่วยลงทุน ห้ามกำหนดนโยบายการลงทุนที่มุ่งเน้นลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมอีทีเอฟที่มีกลยุทธ์ในการบริหารจัดการการลงทุนที่มุ่งหวังผลตอบแทนทวีคูณหรือตรงกันข้ามกับผลตอบแทนรายวันของดัชนีที่กองทุนรวมใช้อ้างอิง (leveraged management หรือ inverse management) หรือหน่วยของกองทุนต่างประเทศที่มีลักษณะในทำนองเดียวกัน”

ข้อ ๒ ให้ยกเลิกภาคผนวก ๑ คำศัพท์ ภาคผนวก ๒ การจัดแบ่งประเภทของกองทุน และภาคผนวก ๓ ทรัพย์สินที่กองทุนสามารถลงทุนได้ ท้ายประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทน. ๘๗/๒๕๕๘ เรื่อง การลงทุนของกองทุน ลงวันที่ ๑๗ ธันวาคม พ.ศ. ๒๕๕๘ ซึ่งแก้ไขเพิ่มเติมโดยประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทน. ๔๗/๒๕๖๗ เรื่อง การลงทุนของกองทุน (ฉบับที่ ๒๙) ลงวันที่ ๒๔ ธันวาคม พ.ศ. ๒๕๖๗ และให้ใช้ภาคผนวก ๑ คำศัพท์ ภาคผนวก ๒ การจัดแบ่งประเภทของกองทุน และภาคผนวก ๓ ทรัพย์สินที่กองทุนสามารถลงทุนได้ ท้ายประกาศนี้แทน

ข้อ ๓ ในกรณีที่กองทุนรวมใดมีการลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมอีทีเอฟที่มีกลยุทธ์ในการบริหารจัดการลงทุนที่มุ่งหวังผลตอบแทนวิเศษหรือตรงกันข้ามกับผลตอบแทนรายวันของดัชนีที่กองทุนรวมใช้อ้างอิง (leveraged management หรือ inverse management) หรือหน่วยของกองทุนต่างประเทศที่มีลักษณะในทำนองเดียวกันโดยชอบในวันก่อนวันที่ประกาศนี้มีผลใช้บังคับให้กองทุนรวมดังกล่าวยังสามารถลงทุนในทรัพย์สินนั้นต่อไปได้ โดยบริษัทจัดการกองทุนรวมต้องแก้ไขนโยบายการลงทุนและจัดการลงทุนให้เป็นไปตามประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุนว่าด้วยการลงทุนของกองทุน ซึ่งแก้ไขเพิ่มเติมโดยประกาศนี้ ภายใน ๙๐ วันนับแต่วันที่ประกาศนี้ใช้บังคับ

ข้อ ๔ ประกาศนี้ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่ ๑๖ มีนาคม พ.ศ. ๒๕๖๘ เป็นต้นไป
ประกาศ ณ วันที่ ๒๘ กุมภาพันธ์ พ.ศ. ๒๕๖๘

(นางพรอนงค์ บุชราตระกูล)

เลขาธิการ

สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

ประธานกรรมการ

คณะกรรมการกำกับตลาดทุน