

# ประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน

ที่ ทน. ๑๐/๒๕๖๘

เรื่อง การจัดตั้งกองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนทั่วไปและผู้ลงทุน

ที่มีใช้รายย่อย และการเข้าทำสัญญา

รับจัดการกองทุนส่วนบุคคล

(ฉบับที่ ๑๘)

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 (๗) ในข้อ ๙ แห่งประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุนที่ ทน. ๘๘/๒๕๕๘ เรื่อง การจัดตั้งกองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนทั่วไปและผู้ลงทุนที่มีใช้รายย่อย และการเข้าทำสัญญารับจัดการกองทุนส่วนบุคคล ลงวันที่ ๑๗ ธันวาคม พ.ศ. ๒๕๕๘ ซึ่งแก้ไขเพิ่มเติมโดยประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุนที่ ทน. ๓๕/๒๕๖๖ เรื่อง การจัดตั้งกองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนทั่วไปและผู้ลงทุนที่มีใช้รายย่อย และการเข้าทำสัญญารับจัดการกองทุนส่วนบุคคล (ฉบับที่ ๑๒) ลงวันที่ ๒๓ พฤศจิกายน พ.ศ. ๒๕๖๖

“(๗) กรณีที่เป็นกองทุนรวมอที่เอพที่มีกลยุทธ์ในการบริหารจัดการลงทุนที่มุ่งหวังผลตอบแทนทวีคูณหรือตรงกันข้ามกับผลตอบแทนรายวันของดัชนีที่กองทุนรวมใช้อ้างอิง (leveraged management หรือ inverse management) ตามประกาศการลงทุน บริษัทจัดการกองทุนรวมต้องระบุชื่อของกองทุนรวมให้สะท้อนถึงลักษณะเฉพาะของกลยุทธ์ดังกล่าวดังนี้

(ก) การมุ่งหวังผลตอบแทนเป็นรายวัน (daily)

(ข) การมุ่งหวังผลตอบแทนแบบทวีคูณ (leveraged) หรือตรงกันข้าม (inverse)

กับดัชนีที่ใช้อ้างอิง

(ค) จำนวนผลตอบแทนที่มุ่งหวังเมื่อเทียบกับดัชนีที่ใช้อ้างอิง เช่น หนึ่งเท่า (๑x) หรือสองเท่า (๒x)”

ข้อ ๒ ประกาศนี้ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่ ๑๖ มีนาคม พ.ศ. ๒๕๖๘ เป็นต้นไป  
ประกาศ ณ วันที่ ๒๘ กุมภาพันธ์ พ.ศ. ๒๕๖๘

(นางพรอนงค์ บุชราตระกูล)

เลขาธิการ

สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

ประธานกรรมการ

คณะกรรมการกำกับตลาดทุน