

18 กุมภาพันธ์ 2558

เรียน นายกสมาคมบริษัทจัดการลงทุน

ผู้จัดการ

บริษัทหลักทรัพย์ที่ได้รับใบอนุญาตให้ประกอบธุรกิจหลักทรัพย์ประเภทการจัดการ
กองทุนรวมทุกบริษัท

ผู้ดูแลผลประโยชน์ของกองทุนรวมทุกราย

ที่ กสท.จต.(ว) 5 /2558 เรื่อง ขอความร่วมมือให้กองทุนรวมที่ลงทุนในตราสารทุน
เปิดเผยดัชนีผลตอบแทนรวมเพิ่มเติม

ตามที่ประกาศสมาคมบริษัทจัดการลงทุน ที่ สจก.ร. 4/2544 เรื่อง มาตรฐานการวัด
ผลการดำเนินงานของกองทุนรวม ลงวันที่ 9 พฤศจิกายน 2544 กำหนดมาตรฐานการวัดผลการดำเนินงาน
ของกองทุนรวม รวมทั้งกำหนดตัวชี้วัดผลการดำเนินงาน (“benchmark”) สำหรับกองทุนแต่ละประเภท
โดยกรณีที่เป็นกองทุนรวมที่ลงทุนในตราสารทุนในประเทศให้ใช้ price index เช่น SET Index และ
SET50 Index เป็น benchmark เพื่อเปรียบเทียบผลการดำเนินงาน นั้น

สำนักงานขอเรียนว่า เนื่องจาก benchmark ดังกล่าวคำนวณเฉพาะผลตอบแทน
ที่เกิดจากกำไรส่วนเกินทุนเท่านั้น โดยยังไม่รวมเงินปันผล ในขณะที่ผลตอบแทนจากการลงทุน
ประกอบด้วย กำไรส่วนเกินทุนและเงินปันผล ส่งผลให้การเปรียบเทียบผลการดำเนินงานของ
กองทุนรวม ซึ่งประกอบด้วยกำไรส่วนเกินทุนและเงินปันผลกับ benchmark ดังกล่าว อาจไม่สะท้อน
ความสามารถของผู้จัดการกองทุนในการบริหารจัดการอย่างแท้จริง

ดังนั้น เพื่อให้ผู้ลงทุนได้มีข้อมูล benchmark ที่สะท้อนผลตอบแทนทั้งกำไรส่วนเกินทุน
และเงินปันผล สำนักงานจึงขอความร่วมมือให้กองทุนรวมที่ลงทุนในตราสารทุนในประเทศ และ
กองทุนรวมที่ลงทุนโดยตรงในตราสารทุนต่างประเทศ เปิดเผยดัชนีผลตอบแทนรวม (TRI) ควบคู่ไปด้วย
โดยให้รวมถึงการเปรียบเทียบผลการดำเนินงานในหนังสือชี้ชวนส่วนสรุปข้อมูลสำคัญ (factsheet) และ
การเปิดเผยข้อมูลในเอกสารอื่นที่มีการแสดงผลการดำเนินงานและ benchmark ของกองทุนด้วย ทั้งนี้
เริ่มตั้งแต่การจัดทำข้อมูลเดือนมิถุนายน 2558 เป็นต้นไป

จึงเรียนมาเพื่อโปรดทราบและถือปฏิบัติ

ขอแสดงความนับถือ



(นายวรพล โสคติยานุรักษ์)

เลขาธิการ

ฝ่ายจดทะเบียนหลักทรัพย์-ตราสารหนี้และตราสารอื่น

โทรศัพท์ 0-2263-6033

โทรสาร 0-2263-6293