

ประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน

ที่ ทน. 14/2560

เรื่อง การลงทุนของกองทุน

(ฉบับที่ 4)

อาศัยอำนาจตามความในมาตรา 16/6 แห่งพระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535 ซึ่งแก้ไขเพิ่มเติมโดยพระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ (ฉบับที่ 4) พ.ศ. 2551 และมาตรา 98(5) มาตรา 109 วรรคหนึ่ง และมาตรา 117 แห่งพระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535 และมาตรา 133 วรรคสอง แห่งพระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535 ซึ่งแก้ไขเพิ่มเติมโดยพระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ (ฉบับที่ 2) พ.ศ. 2542 คณะกรรมการกำกับตลาดทุนออกประกาศไว้ดังต่อไปนี้

ข้อ 1 ให้ยกเลิกบทนิยามคำว่า “กองทุนส่วนบุคคลรายใหญ่” และ “กองทุนส่วนบุคคลรายย่อย” ในข้อ 2 แห่งประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทน. 87/2558 เรื่อง การลงทุนของกองทุน ลงวันที่ 17 ธันวาคม พ.ศ. 2558

ข้อ 2 ให้เพิ่มบทนิยามคำว่า “กองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนสถาบันหรือผู้ลงทุนรายใหญ่พิเศษ” และ “กองทุนส่วนบุคคล” ระหว่างบทนิยามคำว่า “กองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนที่มีใช้รายย่อย” และคำว่า “กองทุนสำรองเลี้ยงชีพ” ในข้อ 2 แห่งประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทน. 87/2558 เรื่อง การลงทุนของกองทุน ลงวันที่ 17 ธันวาคม พ.ศ. 2558

“กองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนสถาบันหรือผู้ลงทุนรายใหญ่พิเศษ” หมายความว่า กองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนสถาบันหรือผู้ลงทุนรายใหญ่พิเศษตามประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ว่าด้วยหลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการจัดตั้งและจัดการของกองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนสถาบันหรือผู้ลงทุนรายใหญ่พิเศษ

“กองทุนส่วนบุคคล” หมายความว่า กองทุนส่วนบุคคลตามกฎหมายว่าด้วยหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ แต่ไม่รวมถึงกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ

ข้อ 3 ให้เพิ่มความต่อไปนี้เป็น (4) ของข้อ 5 แห่งประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทน. 87/2558 เรื่อง การลงทุนของกองทุน ลงวันที่ 17 ธันวาคม พ.ศ. 2558

“(4) ในกรณีที่เป็นการจัดการกองทุนส่วนบุคคล บริษัทจัดการกองทุนส่วนบุคคล ต้องจัดสรรเงินลงทุนให้เหมาะสมกับวัตถุประสงค์ในการลงทุนและความเสี่ยงที่ยอมรับได้ของผู้ลงทุน โดยมีการกระจายความเสี่ยงของทรัพย์สินที่ลงทุนให้สอดคล้องกับข้อมูลเกี่ยวกับทรัพย์สินของผู้ลงทุน (asset profile) ที่บริษัทจัดการกองทุนส่วนบุคคลได้รับจากผู้ลงทุนด้วย”

ข้อ 4 ให้ยกเลิกความในข้อ 9 แห่งประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทน. 87/2558 เรื่อง การลงทุนของกองทุน ลงวันที่ 17 ธันวาคม พ.ศ. 2558 และให้ใช้ความต่อไปนี้เป็น

“ข้อ 9 บริษัทจัดการต้องกำหนดนโยบายการลงทุน และลงทุนตามประเภททรัพย์สิน ภายใต้อัตราส่วนการลงทุนและการคำนวณอัตราส่วนการลงทุน ตามหลักเกณฑ์ดังต่อไปนี้

(1) ในการกำหนดนโยบายการลงทุน บริษัทจัดการต้องดำเนินการดังนี้

(ก) กรณีเป็นกองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนทั่วไป กองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนที่มีใช้รายย่อย หรือกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ ให้มีนโยบายการลงทุนตามการจัดแบ่งประเภทของกองทุน ตามภาคผนวก 2 และต้องจัดการลงทุนให้เป็นไปตามนโยบายดังกล่าวตามที่ระบุไว้ในโครงการ หรือสัญญาบริหารจัดการกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ แล้วแต่กรณี

(ข) กรณีเป็นกองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนสถาบันหรือผู้ลงทุนรายใหญ่พิเศษ ให้มีนโยบายการลงทุนตามที่ระบุไว้ในโครงการ

(ค) กรณีเป็นกองทุนส่วนบุคคล ให้มีนโยบายการลงทุนตามที่ระบุไว้ในสัญญาบริหารจัดการกองทุนส่วนบุคคล

(2) ในส่วนที่เกี่ยวกับทรัพย์สินที่กองทุนสามารถลงทุนได้ บริษัทจัดการต้องจัดการลงทุนเฉพาะทรัพย์สินตามที่กำหนดในภาคผนวก 3 เว้นแต่กรณีเป็นกองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนสถาบัน หรือผู้ลงทุนรายใหญ่พิเศษ หรือกองทุนส่วนบุคคล ให้จัดการลงทุนตามที่กำหนดในข้อ 14 ทั้งนี้ การลงทุนดังกล่าวต้องไม่มีผลกระทบต่อสภาพคล่องโดยรวมในการรับซื้อคืนหน่วยลงทุน หรือการจ่ายเงินให้กับสมาชิกของกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ

(3) ในการลงทุนภายใต้อัตราส่วนการลงทุน บริษัทจัดการต้องดำเนินการดังนี้

(ก) กรณีเป็นกองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนทั่วไป ให้การลงทุนเป็นไปตามอัตราส่วนการลงทุนในภาคผนวก 4-retail MF

(ข) กรณีเป็นกองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนที่มีใช้รายย่อย ให้การลงทุนเป็นไปตามอัตราส่วนการลงทุนในภาคผนวก 4-AI

(ค) กรณีเป็นกองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนสถาบันหรือผู้ลงทุนรายใหญ่พิเศษ ให้การลงทุนเป็นไปตามอัตราส่วนการลงทุนในภาคผนวก 4-UI

(ง) กรณีเป็นกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ ให้การลงทุนเป็นไปตามอัตราส่วนการลงทุนในภาคผนวก 4-PVD

(4) ในการคำนวณอัตราส่วนการลงทุน บริษัทจัดการต้องคำนวณให้เป็นไปตามภาคผนวก 5

ในกรณีเป็นกองทุนรวมสำหรับผู้ลงทุนในต่างประเทศ (Country Fund) บริษัทจัดการสามารถขอผ่อนผันการปฏิบัติตามหลักเกณฑ์เกี่ยวกับอัตราส่วนการลงทุนที่คำนวณตามประเภททรัพย์สิน (product limit) หรืออัตราส่วนการลงทุนที่คำนวณตามความมีส่วนได้เสียในกิจการที่ลงทุน (concentration limit) ตามส่วนที่ 3 และส่วนที่ 4 ของภาคผนวก 4-retail MF หรือส่วนที่ 3 และส่วนที่ 4 ของภาคผนวก 4-AI แล้วแต่กรณี เมื่อมีเหตุจำเป็นและสมควร ต่อสำนักงานได้

ในกรณีเป็นกองทุนสำรองเลี้ยงชีพที่มีหลายนโยบายการลงทุน บริษัทจัดการต้องดำเนินการลงทุนตามวรรคหนึ่ง (3) (ง) และคำนวณอัตราส่วนการลงทุนตามวรรคหนึ่ง (4) แยกตามนโยบายการลงทุนแทนการลงทุนและการคำนวณตามรายกองทุน เว้นแต่เป็นการคำนวณอัตราส่วนการลงทุนที่คำนวณตามความมีส่วนได้เสียในกิจการที่ลงทุน (concentration limit) ตามส่วนที่ 4 ของภาคผนวก 4-PVD ให้คำนวณตามรายกองทุน”

ข้อ 5 ให้ยกเลิกความในข้อ 11 แห่งประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทน. 87/2558 เรื่อง การลงทุนของกองทุน ลงวันที่ 17 ธันวาคม พ.ศ. 2558 และให้ใช้ความต่อไปนี้แทน

“ข้อ 11 ให้สำนักงานมีอำนาจประกาศกำหนดหลักเกณฑ์ในรายละเอียดในการดำเนินการของบริษัทจัดการกองทุนส่วนบุคคลเกี่ยวกับการควบคุมอัตราส่วนการลงทุนสำหรับสมาชิกแต่ละรายของกองทุนสำรองเลี้ยงชีพในกรณีที่กองทุนสำรองเลี้ยงชีพมีนโยบายการลงทุนในลักษณะเดียวกับกองทุนรวมหมวดอุตสาหกรรมหรือกองทุนรวมทรัพย์สินทางเลือก ตามส่วนที่ 3 การกำหนดนโยบายการลงทุนของ PVD ของภาคผนวก 2 หรือมีนโยบายการลงทุนโดยมีอัตราส่วนการลงทุนผ่อนคลายกว่าอัตราส่วนการลงทุนสำหรับกองทุนสำรองเลี้ยงชีพทั่วไปในภาคผนวก 4-PVD”

ข้อ 6 ให้ยกเลิกความในส่วนที่ 2 หลักเกณฑ์เพิ่มเติมสำหรับกองทุนส่วนบุคคลรายใหญ่ ข้อ 14 ของหมวด 2 หลักเกณฑ์การลงทุน แห่งประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทน. 87/2558 เรื่อง การลงทุนของกองทุน ลงวันที่ 17 ธันวาคม พ.ศ. 2558 และให้ใช้ความต่อไปนี้แทน

## “ส่วนที่ 2

หลักเกณฑ์เพิ่มเติมสำหรับกองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนสถาบัน  
หรือผู้ลงทุนรายใหญ่พิเศษ และกองทุนส่วนบุคคล

ข้อ 14 บริษัทจัดการสามารถลงทุนเพื่อกองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนสถาบันหรือผู้ลงทุนรายใหญ่พิเศษ หรือกองทุนส่วนบุคคล ในตราสารทางการเงินหรือธุรกรรมทางการเงินอื่นใดได้ทุกประเภท ในกรณีทรัพย์สินที่มีการลงทุนตามวรรคหนึ่งเป็นทรัพย์สินในประเภทที่กองทุนสามารถลงทุนได้ตามภาคผนวก 3 มิให้นำความในภาคผนวกดังกล่าวในส่วนที่เกี่ยวกับคุณสมบัติเงื่อนไข และหลักเกณฑ์ในการลงทุนมาใช้บังคับ

ในกรณีที่มีการลงทุนตามวรรคหนึ่งเป็นการขายหลักทรัพย์ที่ต้องยึดหลักทรัพย์มาเพื่อการส่งมอบ (short sale) ให้บริษัทจัดการกระทำได้เฉพาะในกรณีที่คู่สัญญาซึ่งเป็นผู้ขายเป็นผู้ลงทุนสถาบันตามข้อ 4(1) ถึง (23) แห่งประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ที่ กจ. 4/2560 เรื่อง การกำหนดบทนิยามผู้ลงทุนสถาบัน ผู้ลงทุนรายใหญ่พิเศษและผู้ลงทุนรายใหญ่ ลงวันที่ 8 กุมภาพันธ์ พ.ศ. 2560 โดยให้บริษัทจัดการปฏิบัติตามหลักเกณฑ์เกี่ยวกับการขายหลักทรัพย์ที่ต้องยึดหลักทรัพย์มาเพื่อการส่งมอบตามที่กำหนดในประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุนว่าด้วยการขายหลักทรัพย์โดยที่บริษัทหลักทรัพย์ยังไม่มีหลักทรัพย์นั้นอยู่ในครอบครอง โดยอนุโลม”

ข้อ 7 ให้เพิ่มความต่อไปนี้เป็นข้อ 15/1 ของหมวด 3 การดำเนินการเมื่อการลงทุนไม่เป็นไปตามหลักเกณฑ์ที่กำหนด แห่งประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทน. 87/2558 เรื่อง การลงทุนของกองทุน ลงวันที่ 17 ธันวาคม พ.ศ. 2558

“ข้อ 15/1 หลักเกณฑ์ในหมวดนี้ไม่ใช้บังคับกับกองทุนส่วนบุคคล หลักเกณฑ์ในข้อ 16 ข้อ 17 ข้อ 18/1 ข้อ 21 ข้อ 22 และข้อ 23 ไม่ใช้บังคับกับกองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนสถาบันหรือผู้ลงทุนรายใหญ่พิเศษ”

ข้อ 8 ให้ยกเลิกความในวรรคหนึ่งของข้อ 16 แห่งประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทน. 87/2558 เรื่อง การลงทุนของกองทุน ลงวันที่ 17 ธันวาคม พ.ศ. 2558 และให้ใช้ความต่อไปนี้แทน

“ข้อ 16 ในกรณีที่บริษัทจัดการได้ลงทุนในทรัพย์สินเพื่อกองทุนรวมตลาดเงินหรือกองทุนสำรองเลี้ยงชีพที่มีนโยบายการลงทุนในลักษณะเดียวกับกองทุนรวมตลาดเงิน โดยมีอายุเฉลี่ยของทรัพย์สินที่ลงทุนซึ่งได้จากการคำนวณค่าตามมาตรฐานสากลไม่เกินกว่า 92 วันตามที่กำหนดในภาคผนวก 2 แต่ต่อมาอายุเฉลี่ยของทรัพย์สินที่ลงทุนดังกล่าวไม่เป็นไปตามหลักเกณฑ์ที่กำหนดดังกล่าวติดต่อกันเป็นระยะเวลา 5 วันทำการ โดยไม่ได้เกิดจากการลงทุนเพิ่ม ให้บริษัทจัดการปฏิบัติดังต่อไปนี้

(1) จัดทำรายงาน โดยระบุอายุเฉลี่ยของทรัพย์สินที่ลงทุนดังกล่าว และสาเหตุที่ไม่สามารถดำรงอายุเฉลี่ยของทรัพย์สินที่ลงทุนดังกล่าวตามที่กำหนดในภาคผนวก 2 รวมทั้งจัดส่งต่อสำนักงาน และผู้ดูแลผลประโยชน์ของกองทุนรวมหรือคณะกรรมการกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ แล้วแต่กรณี ภายในวันทำการถัดจากวันครบระยะเวลาดังกล่าว ตลอดจนจัดเก็บสำเนารายงานดังกล่าวไว้ที่บริษัทจัดการ

(2) ดำเนินการแก้ไขอายุเฉลี่ยของทรัพย์สินที่ลงทุนดังกล่าวภายในโอกาสแรก โดยคำนึงถึงประโยชน์ของผู้ลงทุนเป็นสำคัญ แต่ต้องไม่เกิน 30 วันนับแต่วันครบระยะเวลาดังกล่าว เว้นแต่เป็นกรณีตามวรรคหนึ่ง (2) วรรคสอง

ในกรณีที่มีเหตุสุดวิสัยหรือเหตุจำเป็นอื่นใดทำให้บริษัทจัดการไม่สามารถดำเนินการแก้ไขเพื่อให้การลงทุนเป็นไปตามหลักเกณฑ์ที่กำหนดในวรรคหนึ่ง (2) วรรคหนึ่ง หรือบริษัทจัดการมีความเห็นว่าการดำเนินการดังกล่าวจะไม่เป็นประโยชน์ต่อผู้ลงทุน บริษัทจัดการสามารถใช้ดุลยพินิจดำเนินการตามความเหมาะสมได้โดยไม่ต้องคำนึงถึงประโยชน์ของผู้ลงทุนเป็นสำคัญ และต้องส่งรายงานเกี่ยวกับการดำเนินการของบริษัทจัดการในเรื่องดังกล่าวต่อสำนักงาน ผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุนและผู้ดูแลผลประโยชน์ของกองทุนรวม หรือคณะกรรมการกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ แล้วแต่กรณี ก่อนครบระยะเวลาที่ต้องแก้ไขให้เป็นไปตามหลักเกณฑ์ดังกล่าว ทั้งนี้ ในการจัดส่งรายงานดังกล่าวให้กับผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุน บริษัทจัดการสามารถดำเนินการโดยวิธีการเผยแพร่บนเว็บไซต์ของบริษัทจัดการแทนได้

(3) จัดทำรายงานเมื่อบริษัทจัดการสามารถแก้ไขอายุเฉลี่ยของทรัพย์สินที่ลงทุนดังกล่าวได้ โดยให้ระบุอายุเฉลี่ยของทรัพย์สินที่ลงทุนดังกล่าวของกองทุนรวมและวันที่สามารถแก้ไขได้ และดำเนินการตามวรรคหนึ่ง (1) โดยอนุโลม”

ข้อ 9 ให้ยกเลิกความในข้อ 17 แห่งประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทน. 87/2558 เรื่อง การลงทุนของกองทุน ลงวันที่ 17 ธันวาคม พ.ศ. 2558 และให้ใช้ความต่อไปนี้แทน

“ข้อ 17 ในกรณีที่กองทุนมีการลงทุนเป็นไปตามหลักเกณฑ์ที่กำหนดในประกาศนี้ แต่ต่อมาทรัพย์สินที่ลงทุนมีคุณสมบัติที่เปลี่ยนแปลงไปจนเป็นเหตุให้ขาดคุณสมบัติในการเป็นทรัพย์สินที่กองทุนสามารถลงทุนได้อีกต่อไป บริษัทจัดการต้องดำเนินการดังต่อไปนี้

(1) จัดทำรายงาน โดยระบุรายละเอียดเกี่ยวกับชื่อ จำนวน อัตราส่วนการลงทุน และวันที่ทรัพย์สินขาดคุณสมบัติ และจัดส่งรายงานต่อสำนักงาน รวมทั้งจัดส่งต่อผู้ดูแลผลประโยชน์หรือคณะกรรมการกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ แล้วแต่กรณี ภายในวันทำการถัดจากวันที่เกิดกรณีดังกล่าว ตลอดจนจัดเก็บสำเนารายงานไว้ที่บริษัทจัดการ

(2) จำหน่ายทรัพย์สินที่ขาดคุณสมบัติภายในโอกาสแรกโดยคำนึงถึงประโยชน์ของผู้ลงทุนเป็นสำคัญ แต่ต้องไม่เกินกว่าระยะเวลาดังนี้ เว้นแต่เป็นกรณีตามข้อ 20

(ก) 30 วันนับแต่วันที่ทรัพย์สินนั้นขาดคุณสมบัติ กรณีเป็นกองทุนรวมตลาดเงินหรือกองทุนสำรองเลี้ยงชีพอื่นที่มีนโยบายการลงทุนในลักษณะเดียวกับกองทุนรวมตลาดเงิน

(ข) 90 วันนับแต่วันที่ทรัพย์สินนั้นขาดคุณสมบัติ กรณีเป็นกองทุนรวมหรือกองทุนสำรองเลี้ยงชีพอื่นนอกเหนือจากกองทุนตาม (ก)

(3) เมื่อบริษัทจัดการสามารถจำหน่ายทรัพย์สินที่ขาดคุณสมบัติ หรือทรัพย์สินที่ขาดคุณสมบัติมีคุณสมบัติเปลี่ยนแปลงไปจนเป็นไปตามหลักเกณฑ์ที่กำหนดแล้ว บริษัทจัดการต้องจัดทำรายงานข้อมูลเกี่ยวกับชื่อ จำนวน อัตราส่วนการลงทุนในทรัพย์สินดังกล่าว รวมถึงวันที่ได้จำหน่ายทรัพย์สินนั้นออกไปหรือวันที่ทรัพย์สินมีการเปลี่ยนแปลงคุณสมบัติ แล้วแต่กรณี และให้จัดส่งรายงานต่อสำนักงาน รวมทั้งจัดส่งให้ผู้ดูแลผลประโยชน์หรือคณะกรรมการกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ แล้วแต่กรณี ภายในวันทำการถัดจากวันที่เกิดกรณีดังกล่าว”

ข้อ 10 ให้ยกเลิกความในข้อ 18 แห่งประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทน. 87/2558 เรื่อง การลงทุนของกองทุน ลงวันที่ 17 ธันวาคม พ.ศ. 2558 ซึ่งแก้ไขเพิ่มเติมโดยประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทน. 55/2559 เรื่อง การลงทุนของกองทุน (ฉบับที่ 3) ลงวันที่ 20 ธันวาคม พ.ศ. 2559 และให้ใช้ความต่อไปนี้แทน

“ข้อ 18 ในกรณีที่ทรัพย์สินในขณะที่กองทุนมีการลงทุนเป็นไปตามอัตราส่วนการลงทุนที่กำหนด แต่ต่อมาการลงทุนไม่เป็นไปตามอัตราส่วนการลงทุนเป็นเวลา 5 วันทำการติดต่อกันโดยมิได้เกิดจากการลงทุนเพิ่ม บริษัทจัดการต้องดำเนินการดังต่อไปนี้

(1) จัดทำรายงาน โดยระบุรายละเอียดเกี่ยวกับประเภท จำนวน อัตราส่วนการลงทุน และวันที่การลงทุนไม่เป็นไปตามอัตราส่วนการลงทุน และจัดส่งรายงานต่อสำนักงาน รวมทั้งจัดส่งให้ผู้ดูแลผลประโยชน์หรือคณะกรรมการกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ แล้วแต่กรณี ภายในวันทำการถัดจากวันครบระยะเวลาดังกล่าว ตลอดจนจัดเก็บสำเนารายงานไว้ที่บริษัทจัดการ

(2) ไม่ลงทุนเพิ่มเติมในทรัพย์สินที่เกินอัตราส่วนการลงทุนจนกว่าจะสามารถแก้ไขให้เป็นไปตามอัตราส่วนการลงทุนที่กำหนด

(3) แก้ไขให้เป็นไปตามอัตราส่วนการลงทุนที่กำหนดภายในโอกาสแรกโดยคำนึงถึงประโยชน์ของผู้ลงทุนเป็นสำคัญ แต่ต้องไม่เกินระยะเวลาดังนี้ เว้นแต่เป็นกรณีตามข้อ 20

(ก) 30 วันนับแต่วันสิ้นรอบระยะเวลาบัญชี ในกรณีที่ไม่เป็นไปตามอัตราส่วนการลงทุนที่คำนวณตามประเภททรัพย์สิน สำหรับการลงทุนในเงินฝากหรือตราสารเทียบเท่าเงินฝาก ตั๋วแลกเงินหรือตั๋วสัญญาใช้เงิน ตามภาคผนวก 4-retail MF ส่วนที่ 3 ในข้อ 1 หรืออัตราส่วนการลงทุน

ตามภาคผนวก 4-UI ในข้อ 1 หรืออัตราส่วนการลงทุนตามภาคผนวก 4-AI ส่วนที่ 3 ในข้อ 1 แล้วแต่กรณี

(ข) 90 วันนับแต่วันครบระยะเวลาดังกล่าว สำหรับกรณีอื่นใดนอกเหนือจากกรณีตาม (3) (ก) หรือ (ค) เว้นแต่กรณีเป็นกองทุนรวมตลาดเงิน หรือกองทุนสำรองเลี้ยงชีพที่มีนโยบายการลงทุนในลักษณะเดียวกับกองทุนรวมตลาดเงิน บริษัทจัดการต้องดำเนินการแก้ไขภายใน 30 วันนับแต่วันครบระยะเวลาดังกล่าว

(ค) 180 วันนับแต่วันครบระยะเวลาดังกล่าว สำหรับกรณีกองทุนสำรองเลี้ยงชีพที่การลงทุนไม่เป็นไปตามอัตราส่วนการลงทุนเนื่องจากการลดหรือเพิ่มจำนวนนายจ้างในกองทุนสำรองเลี้ยงชีพจนเป็นเหตุให้นายจ้างรายใดรายหนึ่งมีมูลค่าทรัพย์สินสุทธิในส่วนของนายจ้างรายนั้นเกินกว่าร้อยละ 50 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ

(4) เมื่อบริษัทจัดการสามารถแก้ไขจนเป็นไปตามอัตราส่วนการลงทุนที่กำหนดแล้ว บริษัทจัดการต้องจัดทำรายงานข้อมูลเกี่ยวกับชื่อ จำนวน อัตราส่วนการลงทุนในทรัพย์สินดังกล่าว รวมถึงวันที่สามารถแก้ไขให้เป็นไปตามอัตราส่วนการลงทุน แล้วแต่กรณี และจัดส่งรายงานต่อสำนักงานรวมทั้งจัดส่งต่อผู้ดูแลผลประโยชน์ หรือคณะกรรมการกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ แล้วแต่กรณี ภายในวันทำการถัดจากวันที่มีการแก้ไขจนเป็นไปตามอัตราส่วนการลงทุนนั้น

(5) ในกรณีที่กองทุนมีหุ้นของบริษัทใดโดยไม่เป็นไปตามอัตราส่วนการลงทุนที่คำนวณตามความมีส่วนได้เสียในกิจการที่ลงทุน (concentration limit) ตามที่กำหนดในภาคผนวก 4-retail MF ภาคผนวก 4-AI หรือภาคผนวก 4-PVD แล้วแต่กรณี นอกจากการปฏิบัติตามวรรคหนึ่ง (1) (2) (3) และ (4) แล้ว บริษัทจัดการต้องดำเนินการดังนี้ด้วย

(ก) งดเว้นการใช้สิทธิออกเสียงในหุ้นจำนวนที่เกินอัตราส่วนการลงทุน เว้นแต่กรณีจำเป็นและสมควร โดยได้รับการผ่อนผันจากสำนักงาน

(ข) ลดสัดส่วนการถือหุ้นหรือลดการมีอำนาจควบคุม หรือยื่นคำขอผ่อนผันการทำคำเสนอซื้อ ในกรณีที่ทรัพย์สินเป็นหุ้นของบริษัทจดทะเบียน และการได้มาซึ่งหุ้นของบริษัทดังกล่าวเป็นผลให้กองทุนได้มาหรือเป็นผู้ถือหุ้นของบริษัทนั้นจนถึงหรือข้ามจุดที่ต้องทำคำเสนอซื้อ

ความในวรรคหนึ่งมิให้นำมาใช้กับกองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนทั่วไป หรือกองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนที่มีไร่รายย่อย ที่มีนโยบายการลงทุนในลักษณะของกองทุนรวมฟิเดเคอร์ ในส่วนที่เป็นการลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมหรือหน่วยของกองทุนต่างประเทศที่มีอัตราส่วนการลงทุนที่คำนวณตามความมีส่วนได้เสียในกิจการที่ลงทุน (concentration limit) เป็นไปตามหลักเกณฑ์เกี่ยวกับอัตราส่วนการลงทุนดังกล่าว แต่ต่อมากการลงทุนไม่เป็นไปตามอัตราส่วนการลงทุนนั้นเป็นเวลา 5 วันทำการติดต่อกัน โดยมีได้เกิดจากการลงทุนเพิ่ม โดยให้ดำเนินการตามที่กำหนดในข้อ 18/1 แทน”

ข้อ 11 ให้ยกเลิกความในข้อ 18/1 แห่งประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทน. 87/2558 เรื่อง การลงทุนของกองทุน ลงวันที่ 17 ธันวาคม พ.ศ. 2558 ซึ่งแก้ไขเพิ่มเติมโดย ประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทน. 55/2559 เรื่อง การลงทุนของกองทุน (ฉบับที่ 3) ลงวันที่ 20 ธันวาคม พ.ศ. 2559 และให้ใช้ความต่อไปนี้เป็นแทน

“ข้อ 18/1 ในกรณีการลงทุนของกองทุนตามข้อ 18 วรรคสอง ในส่วนที่เป็นการลงทุน ในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมหรือหน่วยของกองทุนต่างประเทศที่มีอัตราส่วนการลงทุนที่คำนวณ ตามความมีส่วนได้เสียในกิจการที่ลงทุน (concentration limit) เป็นไปตามหลักเกณฑ์เกี่ยวกับอัตราส่วน การลงทุนดังกล่าว แต่ต่อมาการลงทุนไม่เป็นไปตามอัตราส่วนการลงทุนนั้นเป็นเวลา 5 วันทำการ ติดต่อกัน โดยมีได้เกิดจากการลงทุนเพิ่ม ให้บริษัทจัดการดำเนินการดังต่อไปนี้

(1) จัดทำรายงาน โดยระบุรายละเอียดเกี่ยวกับประเภท จำนวน อัตราส่วนการลงทุน และวันที่การลงทุนไม่เป็นไปตามอัตราส่วนการลงทุน และจัดส่งรายงานต่อสำนักงานและผู้ดูแล ผลประโยชน์ ภายในวันทำการถัดจากวันครบระยะเวลาดังกล่าว ตลอดจนจัดเก็บสำเนารายงานไว้ที่ บริษัทจัดการ

(2) แก้ไขให้เป็นไปตามอัตราส่วนการลงทุนดังกล่าวภายในโอกาสแรกโดยคำนึงถึง ประโยชน์ของผู้ลงทุนเป็นสำคัญ แต่ต้องไม่เกินระยะเวลา 90 วันนับแต่วันครบระยะเวลาดังกล่าว

(3) เมื่อบริษัทจัดการแก้ไขให้เป็นไปตามอัตราส่วนการลงทุนที่กำหนดแล้ว ให้จัดทำรายงานข้อมูลเกี่ยวกับชื่อ จำนวน อัตราส่วนการลงทุนในทรัพย์สินดังกล่าว รวมถึงวันที่สามารถ แก้ไขได้ และจัดส่งรายงานต่อสำนักงานและผู้ดูแลผลประโยชน์ ภายในวันทำการถัดจากวันที่มีการแก้ไข จนเป็นไปตามอัตราส่วนการลงทุนนั้น

(4) ในกรณีที่เป็นการลงทุนรวมฟิเดอริ์ซึ่งบริษัทจัดการไม่สามารถดำเนินการตาม (2) ห้ามมิให้บริษัทจัดการเสนอขายหน่วยลงทุนของกองทุนรวมนั้นเพิ่มเติมจนกว่าจะเป็นไปตามอัตราส่วน การลงทุนตามที่หลักเกณฑ์กำหนด”

ข้อ 12 ให้ยกเลิกความในข้อ 21 แห่งประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทน. 87/2558 เรื่อง การลงทุนของกองทุน ลงวันที่ 17 ธันวาคม พ.ศ. 2558 และให้ใช้ความต่อไปนี้เป็นแทน

“ข้อ 21 ในกรณีที่กองทุนมีสัดส่วนการลงทุนไม่เป็นไปตามนโยบายการลงทุน ตามการจัดแบ่งประเภทของกองทุน บริษัทจัดการต้องดำเนินการดังต่อไปนี้

(1) จัดทำรายงานเกี่ยวกับการลงทุนที่ไม่เป็นไปตามนโยบายการลงทุน พร้อมทั้ง เหตุผลที่ทำให้มีการลงทุนไม่เป็นไปตามนโยบายการลงทุน และจัดส่งรายงานต่อสำนักงาน รวมทั้ง จัดส่งต่อผู้ดูแลผลประโยชน์หรือคณะกรรมการกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ แล้วแต่กรณี ภายในวันทำการ ถัดจากวันที่ไม่เป็นไปตามนโยบายการลงทุน ตลอดจนจัดเก็บสำเนารายงานไว้ที่บริษัทจัดการ



(2) ดำเนินการแก้ไขให้สัดส่วนการลงทุนของกองทุนเป็นไปตามนโยบายการลงทุน หรือดำเนินการเปลี่ยนแปลงประเภทของกองทุน ทั้งนี้ ตามหลักเกณฑ์ที่กำหนดในข้อ 22 สำหรับ กรณีของกองทุนรวม และข้อ 23 สำหรับกรณีของกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ”

ข้อ 13 ให้ยกเลิกความในข้อ 23 แห่งประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทน. 87/2558 เรื่อง การลงทุนของกองทุน ลงวันที่ 17 ธันวาคม พ.ศ. 2558 และให้ใช้ความต่อไปนี้แทน

“ข้อ 23 บริษัทจัดการต้องดำเนินการแก้ไขให้สัดส่วนการลงทุนของกองทุนสำรอง เลี้ยงชีพ เป็นไปตามนโยบายการลงทุนตามการจัดแบ่งประเภทของกองทุนภายใน 90 วันนับแต่วันที่ สัดส่วนการลงทุนไม่เป็นไปตามนโยบายการลงทุน เว้นแต่บริษัทจัดการจะได้รับความเห็นชอบจาก คณะกรรมการกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ ให้เปลี่ยนแปลงนโยบายการลงทุนภายในกำหนดเวลาดังกล่าว

ในกรณีที่บริษัทจัดการได้รับความเห็นชอบจากคณะกรรมการกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ ตามวรรคหนึ่งแล้ว ให้บริษัทจัดการแจ้งการเปลี่ยนแปลงนโยบายการลงทุนและการได้รับความยินยอม ดังกล่าวให้สมาชิกของกองทุนสำรองเลี้ยงชีพทราบด้วย”

ข้อ 14 ให้ยกเลิกภาคผนวก 1 ภาคผนวก 2 ภาคผนวก 3 ภาคผนวก 4-AI ภาคผนวก 4-PVD และภาคผนวก 5 ท้ายประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทน. 87/2558 เรื่อง การลงทุน ของกองทุน ลงวันที่ 17 ธันวาคม พ.ศ. 2558 ซึ่งแก้ไขเพิ่มเติมโดยประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทน. 55/2559 เรื่อง การลงทุนของกองทุน (ฉบับที่ 3) ลงวันที่ 20 ธันวาคม พ.ศ. 2559 และให้ใช้ ภาคผนวก 1 ภาคผนวก 2 ภาคผนวก 3 ภาคผนวก 4-AI และภาคผนวก 5 ท้ายประกาศนี้แทน

ข้อ 15 ให้ยกเลิกภาคผนวก 4-retail MF-PF ท้ายประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทน. 87/2558 เรื่อง การลงทุนของกองทุน ลงวันที่ 17 ธันวาคม พ.ศ. 2558 ซึ่งแก้ไขเพิ่มเติมโดย ประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทน. 55/2559 เรื่อง การลงทุนของกองทุน (ฉบับที่ 3) ลงวันที่ 20 ธันวาคม พ.ศ. 2559

ข้อ 16 ให้เพิ่มภาคผนวก 4-retail MF และภาคผนวก 4-UI ท้ายประกาศนี้เป็น  
ภาคผนวก 4-retail MF และภาคผนวก 4-UI ท้ายประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทน. 87/2558  
เรื่อง การลงทุนของกองทุน ลงวันที่ 17 ธันวาคม พ.ศ. 2558

ข้อ 17 ประกาศนี้ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 1 มีนาคม พ.ศ. 2560 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 20 กุมภาพันธ์ พ.ศ. 2560

(นายพี สุจริตกุล)

เลขาธิการ

สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

ประธานกรรมการ

คณะกรรมการกำกับตลาดทุน