

คณะกรรมการกำกับตลาดทุน

ประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน

ที่ ทน. 47 /2563

เรื่อง การลงทุนของกองทุน

(ฉบับที่ 18)

อาศัยอำนาจตามความในมาตรา 16/6 วรรคสอง (1) แห่งพระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535 ซึ่งแก้ไขเพิ่มเติมโดยพระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ (ฉบับที่ 4) พ.ศ. 2551 และมาตรา 117 แห่งพระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535 และมาตรา 133 วรรคสอง แห่งพระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535 ซึ่งแก้ไขเพิ่มเติมโดยพระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ (ฉบับที่ 2) พ.ศ. 2542 คณะกรรมการกำกับตลาดทุนออกประกาศไว้ดังต่อไปนี้

ข้อ 1 ให้เพิ่มความต่อไปนี้เป็นบทนิยามคำว่า “กองทุนรวมที่เน้นลงทุนในตราสารหนี้ที่มีความเสี่ยงสูงเพื่อแก้ปัญหาสภาพคล่อง เนื่องจากสถานการณ์โรคโควิด 19” ระหว่างบทนิยามคำว่า “กองทุนสำรองเลี้ยงชีพ” และคำว่า “การลงทุน” ในข้อ 2 แห่งประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทน. 87/2558 เรื่อง การลงทุนของกองทุน ลงวันที่ 17 ธันวาคม พ.ศ. 2558 ซึ่งแก้ไขเพิ่มเติมโดยประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทน. 45/2562 เรื่อง การลงทุนของกองทุน (ฉบับที่ 13) ลงวันที่ 20 มิถุนายน พ.ศ. 2562

“กองทุนรวมที่เน้นลงทุนในตราสารหนี้ที่มีความเสี่ยงสูงเพื่อแก้ปัญหาสภาพคล่อง เนื่องจากสถานการณ์โรคโควิด 19” หมายความว่า กองทุนรวมที่เน้นลงทุนในตราสารหนี้ที่มีความเสี่ยงสูงเพื่อแก้ปัญหาสภาพคล่อง เนื่องจากสถานการณ์โรคโควิด 19 ตามประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุนว่าด้วยหลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการจัดตั้งและจัดการกองทุนรวมที่เน้นลงทุนในตราสารหนี้ที่มีความเสี่ยงสูงเพื่อแก้ปัญหาสภาพคล่อง เนื่องจากสถานการณ์โรคโควิด 19”

ข้อ 2 ให้ยกเลิกความในวรรคหนึ่งของข้อ 9 แห่งประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทน. 87/2558 เรื่อง การลงทุนของกองทุน ลงวันที่ 17 ธันวาคม พ.ศ. 2558 ซึ่งแก้ไขเพิ่มเติมโดยประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทน. 25/2563 เรื่อง การลงทุนของกองทุน (ฉบับที่ 17) ลงวันที่ 26 มีนาคม พ.ศ. 2563 และให้ใช้ความต่อไปนี้เป็นแทน

“ข้อ 9 บริษัทจัดการต้องกำหนดนโยบายการลงทุน และลงทุนตามประเภททรัพย์สิน ภายใต้อัตราส่วนการลงทุนและการคำนวณอัตราส่วนการลงทุน ตามหลักเกณฑ์ดังต่อไปนี้

(1) ในการกำหนดนโยบายการลงทุน บริษัทจัดการต้องดำเนินการดังนี้

(ก) กรณีเป็นกองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนทั่วไป กองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนที่มีโช้ยรายย่อย กองทุนสำรองเลี้ยงชีพ หรือกองทุนรวมที่เน้นลงทุนในตราสารหนี้ที่มีความเสี่ยงสูงเพื่อแก้ปัญหาสภาพคล่อง เนื่องจากสถานการณ์โรคโควิด 19 ให้มีนโยบายการลงทุนตามการจัดแบ่งประเภทของกองทุนตามภาคผนวก 2 และต้องจัดการลงทุนให้เป็นไปตามนโยบายดังกล่าวตามที่ระบุไว้ในโครงการหรือสัญญาบริหารจัดการกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ แล้วแต่กรณี

(ข) กรณีเป็นกองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนสถาบันหรือผู้ลงทุนรายใหญ่พิเศษ ให้มีนโยบายการลงทุนตามที่ระบุไว้ในโครงการ

(ค) กรณีเป็นกองทุนส่วนบุคคล ให้มีนโยบายการลงทุนตามที่ระบุไว้ในสัญญาบริหารจัดการกองทุนส่วนบุคคล

(2) ในส่วนที่เกี่ยวกับทรัพย์สินที่กองทุนสามารถลงทุนได้ บริษัทจัดการต้องจัดการลงทุนเฉพาะทรัพย์สินตามที่กำหนดในภาคผนวก 3 เว้นแต่กรณีเป็นกองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนสถาบันหรือผู้ลงทุนรายใหญ่พิเศษ หรือกองทุนส่วนบุคคล ให้จัดการลงทุนตามที่กำหนดในข้อ 14 ทั้งนี้ การลงทุนดังกล่าวต้องไม่มีผลกระทบต่อสภาพคล่องโดยรวมในการรับซื้อคืนหน่วยลงทุนหรือการจ่ายเงินให้กับสมาชิกของกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ

(3) ในการลงทุนภายใต้อัตราส่วนการลงทุน บริษัทจัดการต้องดำเนินการดังนี้

(ก) กรณีเป็นกองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนทั่วไป หรือกองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนที่เป็นกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ ให้การลงทุนเป็นไปตามอัตราส่วนการลงทุนในภาคผนวก 4-retail MF

(ข) กรณีเป็นกองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนที่มีโช้ยรายย่อย ให้การลงทุนเป็นไปตามอัตราส่วนการลงทุนในภาคผนวก 4-AI

(ค) กรณีเป็นกองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนสถาบันหรือผู้ลงทุนรายใหญ่พิเศษ ให้การลงทุนเป็นไปตามอัตราส่วนการลงทุนในภาคผนวก 4-UI

(ง) กรณีเป็นกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ ให้การลงทุนเป็นไปตามอัตราส่วนการลงทุนในภาคผนวก 4-PVD

(จ) กรณีเป็นกองทุนรวมวายุภักษ์ ให้การลงทุนเป็นไปตามอัตราส่วนการลงทุนในภาคผนวก 4-VAYU

(ฉ) กรณีเป็นกองทุนรวมที่เน้นลงทุนในตราสารหนี้ที่มีความเสี่ยงสูงเพื่อแก้ปัญหาสภาพคล่อง เนื่องจากสถานการณ์โรคโควิด 19 ให้การลงทุนเป็นไปตามอัตราส่วนการลงทุนในภาคผนวก 4-HYB

(4) ในการคำนวณอัตราส่วนการลงทุน บริษัทจัดการต้องคำนวณให้เป็นไปตาม ภาคผนวก 5”

ข้อ 3 ให้เพิ่มความต่อไปนี้เป็นข้อ 15/2 แห่งประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทน. 87/2558 เรื่อง การลงทุนของกองทุน ลงวันที่ 17 ธันวาคม พ.ศ. 2558

“ข้อ 15/2 หลักเกณฑ์ในหมวดนี้ไม่ใช้บังคับกับกองทุนรวมที่เน้นลงทุนในตราสารหนี้ที่มีความเสี่ยงสูงเพื่อแก้ปัญหาสภาพคล่อง เนื่องจากสถานการณ์โรคโควิด 19

ในกรณีที่การลงทุนของกองทุนรวมที่เน้นลงทุนในตราสารหนี้ที่มีความเสี่ยงสูง เพื่อแก้ปัญหาสภาพคล่อง เนื่องจากสถานการณ์โรคโควิด 19 ไม่เป็นไปตามนโยบายการลงทุนหรือ ไม่เป็นไปตามอัตราส่วนการลงทุนของกองทุนรวมที่เน้นลงทุนในตราสารหนี้ที่มีความเสี่ยงสูงเพื่อแก้ปัญหา สภาพคล่อง เนื่องจากสถานการณ์โรคโควิด 19 โดยไม่ได้เกิดจากการลงทุนเพิ่ม บริษัทจัดการจะลงทุน เพิ่มเติมในทรัพย์สินที่เกินอัตราส่วนการลงทุนหรือเสนอขายหน่วยลงทุนของกองทุนรวมเพิ่มเติมไม่ได้ จนกว่าจะสามารถแก้ไขให้เป็นไปตามอัตราส่วนการลงทุนที่กำหนด”

ข้อ 4 ให้ยกเลิกภาคผนวกดังต่อไปนี้ และให้ใช้ภาคผนวก 1 ภาคผนวก 2 ภาคผนวก 3 และภาคผนวก 5 ท้ายประกาศนี้แทน

(1) ภาคผนวก 1 ท้ายประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทน. 87/2558 เรื่อง การลงทุนของกองทุน ลงวันที่ 17 ธันวาคม พ.ศ. 2558 ซึ่งแก้ไขเพิ่มเติมโดยประกาศคณะกรรมการ กำกับตลาดทุน ที่ ทน. 25/2563 เรื่อง การลงทุนของกองทุน (ฉบับที่ 17) ลงวันที่ 26 มีนาคม พ.ศ. 2563

(2) ภาคผนวก 2 ท้ายประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทน. 87/2558 เรื่อง การลงทุนของกองทุน ลงวันที่ 17 ธันวาคม พ.ศ. 2558 ซึ่งแก้ไขเพิ่มเติมโดยประกาศคณะกรรมการ กำกับตลาดทุน ที่ ทน. 3/2563 เรื่อง การลงทุนของกองทุน (ฉบับที่ 16) ลงวันที่ 21 มกราคม พ.ศ. 2563

(3) ภาคผนวก 3 และภาคผนวก 5 ท้ายประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทน. 87/2558 เรื่อง การลงทุนของกองทุน ลงวันที่ 17 ธันวาคม พ.ศ. 2558 ซึ่งแก้ไขเพิ่มเติมโดย ประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทน. 20/2562 เรื่อง การลงทุนของกองทุน (ฉบับที่ 12) ลงวันที่ 10 เมษายน พ.ศ. 2562

ข้อ 5 ให้เพิ่มภาคผนวก 4-HYB ที่แนบท้ายประกาศนี้ เป็นภาคผนวก 4-HYB
ท้ายประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทน. 87/2558 เรื่อง การลงทุนของกองทุน ลงวันที่
17 ธันวาคม พ.ศ. 2558

ข้อ 6 ประกาศนี้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 1 สิงหาคม พ.ศ. 2563 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 20 กรกฎาคม พ.ศ. 2563



(นางสาวรีนวดี สุวรรณมงคล)

เลขาธิการ

สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

ประธานกรรมการ

คณะกรรมการกำกับตลาดทุน