

๑ ธันวาคม 2563

เรียน นายกสมาคมบริษัทจัดการลงทุน
ผู้จัดการ
บริษัทหลักทรัพย์ที่ได้รับใบอนุญาตให้ประกอบธุรกิจหลักทรัพย์ประเภท
การจัดการกองทุนรวม

ที่ นจ.ว) 12 /2563 เรื่อง การปรับปรุงแบบรายงานเกี่ยวกับการจัดทำและจัดส่งข้อมูล
การจัดการกองทุนรวม

ด้วยสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ (“สำนักงาน ก.ล.ต.”) ได้ออกประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ สน. 67/2563 เรื่อง หลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการจัดการกองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนทั่วไป กองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนที่มีรายย่อย กองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนสถาบัน และกองทุนส่วนบุคคล (ฉบับที่ 23) ลงวันที่ 30 ตุลาคม พ.ศ. 2563 เพื่อปรับปรุงแบบรายงานที่ใช้ในการติดตามความเสี่ยงของกองทุนรวมให้สอดคล้องกับมาตรฐานสากล และเป็นไปตามแนวทางการพัฒนาข้อมูลภาพรวมการติดตามความเสี่ยง systemic risk ของกองทุน รวมถึง การลดความซ้ำซ้อนของแบบรายงาน เพื่อลดภาระแก่บริษัทจัดการกองทุนรวม (“บริษัทจัดการ”) โดยการปรับปรุงแบบรายงานข้อมูลการจัดการกองทุนรวม มีรายละเอียด ดังนี้

1. ยกเลิกรายงานการขายและรับซื้อคืนหน่วยลงทุนรายเดือน เพื่อลดความซ้ำซ้อน และลดภาระของบริษัทจัดการ คงเหลือรายงานการขายและรับซื้อคืนหน่วยลงทุนของแต่ละกองทุนรวมเปิด เป็นรายวันตามรูปแบบที่สำนักงานกำหนด โดยให้จัดส่งภายในวันทำการถัดไปเช่นเดิม

2. ปรับปรุงรายละเอียดของแบบรายงานพอร์ตการลงทุนของกองทุนรวมให้มีข้อมูลที่จำเป็นเพิ่มเติม ดังนี้

(ก) เพิ่มข้อมูลสินทรัพย์สภาพคล่องให้สอดคล้องกับหลักเกณฑ์การดำรงสภาพคล่องของกองทุนรวมที่ได้ปรับปรุงแล้ว

(ข) เพิ่มข้อมูลฐานะการลงทุน (exposure) และข้อมูลค่าความเสี่ยง Value at Risk (VaR) เพื่อให้มีความครบถ้วนเพียงพอต่อการติดตาม leverage และความเสี่ยงของกองทุน ซึ่งเป็นไปตามมาตรฐานสากลในด้านการติดตามและประเมินความเสี่ยง systemic risk ที่อาจเกิดจากธุรกิจจัดการลงทุน

(ค) เพิ่มข้อมูลมูลค่าการลงทุนในหลักทรัพย์และตราสารอนุพันธ์ในสกุลเงินต่างประเทศ เพื่อรองรับการรวมศูนย์การส่งรายงานที่บริษัทจัดการนำส่งธนาคารแห่งประเทศไทยให้ส่งไปยังสำนักงาน ก.ล.ต. เพียงแห่งเดียว ซึ่งจะช่วยลดความซ้ำซ้อนและลดภาระของบริษัทจัดการ

3. ประกาศมีผลใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 1 กุมภาพันธ์ พ.ศ. 2564 เพื่อให้บริษัทจัดการมีระยะเวลาเพียงพอในการจัดเตรียมระบบและทดสอบการนำส่งรายงานผ่านระบบอิเล็กทรอนิกส์ของสำนักงาน ก.ล.ต. โดยบริษัทจัดการสามารถทดสอบการนำส่งได้ในช่วงวันที่ 4 มกราคม พ.ศ. 2564 ถึง 30 มกราคม พ.ศ. 2564

ทั้งนี้ สำนักงาน ก.ล.ต. ขอเสนอชื่อเจ้าหน้าที่ ผู้ประสานงาน ได้แก่ นายทันตทัต พิทักษ์ศักดิ์พงศ์ โทรศัพท์ 0-2263-6517 email : tantatat@sec.or.th และ นายพรพงษ์ ศักดาพัฒน์ โทรศัพท์ 0-2033-4652 email : pornpong@sec.or.th

จึงเรียนมาเพื่อ โปรดดำเนินการ

ขอแสดงความนับถือ



(นางสุวิรัตน์ สุรเดชะ)

ผู้อำนวยการฝ่ายนโยบายธุรกิจจัดการลงทุน

เลขานุการ^{แทน}

- สิ่งที่ส่งมาด้วย
1. ภาพถ่ายประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ สน. 67/2563 เรื่อง หลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการจัดการกองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนทั่วไป กองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนที่มีใช้รายย่อย กองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนสถาบัน และกองทุนส่วนบุคคล (ฉบับที่ 23) ลงวันที่ 30 ตุลาคม พ.ศ. 2563
 2. สรุปรายละเอียดการปรับปรุงแบบรายงานทั้งหมด
 3. รูปแบบรายงานที่ส่งผ่านระบบ OFAR และ Validation Message
 4. วิธีการจัดทำและส่งรายงาน
 5. ประเด็นคำถาม-คำตอบที่พบบ่อย (FAQ)

ฝ่ายนโยบายธุรกิจจัดการลงทุน

โทรศัพท์/โทรสาร 0-2263-6517