

ประกาศแนวปฏิบัติ

ที่ นป. 2/2564

เรื่อง แนวทางปฏิบัติในการบริหารและจัดการความเสี่ยงด้านสภาพคล่อง
สำหรับบริษัทจัดการกองทุนรวม

ตามที่ประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทน. 11/2564 เรื่อง หลักเกณฑ์
การจัดการกองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนทั่วไป กองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนที่มีรายได้ย่อย กองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุน
ประเภทสถาบัน และกองทุนส่วนบุคคล ลงวันที่ 29 มกราคม พ.ศ. 2564 และที่แก้ไขเพิ่มเติม
("ประกาศ ที่ ทน. 11/2564") กำหนดหลักเกณฑ์เกี่ยวกับการบริหารและจัดการความเสี่ยง
ด้านสภาพคล่องของกองทุนรวมนั้น

เพื่อประโยชน์ในการปฏิบัติตามข้อกำหนดข้างต้นของบริษัทจัดการกองทุนรวม
สำนักงานโดยอาศัยอำนาจตามข้อ 9/1 แห่งประกาศ ที่ ทน. 11/2564 จึงกำหนดแนวทางปฏิบัติ
สำหรับบริษัทจัดการกองทุนรวมในการบริหารและจัดการความเสี่ยงด้านสภาพคล่องไว้ดังต่อไปนี้

ข้อ 1 เพื่อประโยชน์ในการปฏิบัติตามหลักเกณฑ์ที่กำหนดในประกาศนี้ ให้ใช้
บทนิยามตามภาคผนวกแนบท้ายประกาศนี้ และคำศัพท์ตามภาคผนวกของประกาศคณะกรรมการกำกับ
ตลาดทุนว่าด้วยการลงทุนของกองทุนประกอบการพิจารณาการปฏิบัติตามหลักเกณฑ์ดังกล่าวด้วย

ข้อ 2 ประกาศนี้ให้ใช้สำหรับกองทุนรวมเปิด

ข้อ 3 บริษัทจัดการกองทุนรวมควรกำหนดแนวทางการดำเนินการในรายละเอียด
เกี่ยวกับการบริหารและจัดการความเสี่ยงด้านสภาพคล่องที่มีประสิทธิภาพ มีขั้นตอนการดำเนินการ
มีคู่มือในเรื่องที่เกี่ยวข้องรวมถึงขั้นตอนกระบวนการในการประสานงานทั้งภายในและภายนอก
อย่างเหมาะสม มีการซักซ้อมการดำเนินการตามแนวทางดังกล่าวอย่างสม่ำเสมอ เพื่อมั่นใจได้ว่า
การดำเนินการดังกล่าวสามารถใช้ในการบริหารและจัดการความเสี่ยงด้านสภาพคล่องที่ปรากฏขึ้น
ได้อย่างรวดเร็วและมีประสิทธิภาพ โดยไม่ก่อให้เกิดความเสี่ยงที่อาจลุกลามไปสู่ความเสี่ยงเชิงระบบ
ทั้งนี้ ตามแนวทางปฏิบัติในภาคผนวกแนบท้ายประกาศแนวปฏิบัตินี้

ข้อ 4 ในกรณีที่บริษัทจัดการปฏิบัติตามแนวทางปฏิบัตินี้จนครบถ้วน สำนักงาน
จะพิจารณาว่าบริษัทจัดการได้ปฏิบัติตามประกาศ ที่ ทน. 11/2564 ในส่วนที่เกี่ยวกับการกำหนด
แนวทางการบริหารและจัดการความเสี่ยงด้านสภาพคล่อง ทั้งนี้ หากบริษัทจัดการดำเนินการต่างจาก

แนวทางปฏิบัตินี้ บริษัทจัดการมีภาระที่จะต้องพิสูจน์ให้เห็นได้ว่าการดำเนินการนั้นยังคงอยู่ภายใต้
หลักการและข้อกำหนดของประกาศ ที่ ทน. 11/2564 ในส่วนที่เกี่ยวกับแนวทางการบริหารและจัดการ
ความเสี่ยงด้านสภาพคล่อง

ข้อ 5 ประกาศนี้ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 1 กรกฎาคม พ.ศ. 2564 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 22 มิถุนายน พ.ศ. 2564

(นางสาวรีนวดิ สุวรรณมงคล)

เลขาธิการ

สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์