

14 ธันวาคม 2564

เรียน นายกสมาคมบริษัทจัดการลงทุน
นายกสมาคมบริษัทหลักทรัพย์ไทย
นายกสมาคมประกันชีวิตไทย
ประธานสมาคมธนาคารไทย
ประธานสมาคมธนาคารนานาชาติ
ประธานชมรมคัสโตเดียน
ผู้จัดการ

บริษัทหลักทรัพย์ที่ประกอบธุรกิจหลักทรัพย์ประเภทจัดการกองทุนรวม
บริษัทหลักทรัพย์ที่ได้รับใบอนุญาตให้ประกอบธุรกิจหลักทรัพย์ประเภทการเป็น
นายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ การค้าหลักทรัพย์ และการจัดจำหน่ายหลักทรัพย์
ที่เป็นหน่วยลงทุน
ผู้ดูแลผลประโยชน์ของกองทุนรวม

ที่ นจ.ว) 12 /2564 เรื่อง นำส่งภาพถ่ายประกาศและซักซ้อมความเข้าใจใน
การขยายระยะเวลาการดำเนินการเกี่ยวกับการบริหารและจัดการความเสี่ยง
ด้านสภาพคล่องของกองทุนรวม

ตามที่สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์
("สำนักงาน ก.ล.ต.") ได้ออกประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุนที่ ทน. 49/2564 เรื่อง
หลักเกณฑ์การจัดการกองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนทั่วไป กองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนที่มีใช้รายย่อย
กองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนประเภทสถาบัน และกองทุนส่วนบุคคล ลงวันที่ 22 มิถุนายน พ.ศ. 2564
("ประกาศที่ ทน.49/2564") โดยกำหนดให้บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ("บริษัทจัดการ")
มีแนวทางการบริหารและจัดการความเสี่ยงด้านสภาพคล่องตามหลักเกณฑ์ข้อ 9/1 และ
มีเครื่องมือการบริหารและจัดการความเสี่ยงด้านสภาพคล่องตามหลักเกณฑ์ข้อ 25/1
แห่งประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุนที่ ทน. 11/2564 เรื่อง หลักเกณฑ์การจัดการกองทุนรวม
เพื่อผู้ลงทุนทั่วไป กองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนที่มีใช้รายย่อย กองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนประเภทสถาบัน
และกองทุนส่วนบุคคล ลงวันที่ 29 มกราคม พ.ศ.2564 ("ประกาศที่ ทน.11/2564") ภายใน
วันที่ 1 มกราคม พ.ศ. 2565 โดยมีรายละเอียดเป็นไปตามหลักเกณฑ์แนวปฏิบัติการใช้เครื่องมือ
บริหารความเสี่ยงสภาพคล่อง (Liquidity Risk Management Tools Guideline) ที่สมาคม
บริษัทจัดการลงทุน ("ประกาศสมาคมฯ") กำหนด ซึ่งปัจจุบันประกาศสมาคมฯ อยู่ระหว่าง
การพิจารณาของสำนักงาน นั้น

สำนักงาน ก.ล.ต. ตระหนักถึงความจำเป็นที่บริษัทจัดการต้องใช้ระยะเวลาพิจารณารายละเอียดอย่างถี่ถ้วน รวมถึงต้องขออนุมัติจากคณะกรรมการบริษัทในการดำเนินการเรื่องดังกล่าวเพื่อให้เป็นไปตามที่ประกาศที่ ทน.11/2564 กำหนด ดังนั้น สำนักงาน ก.ล.ต. จึงออกประกาศเพื่อให้บริษัทจัดการมีเวลาเพียงพอในการดำเนินการ และขอชักชวนความเข้าใจ ดังนี้

1. ขยายระยะเวลาการกำหนดแนวทางการบริหารและจัดการความเสี่ยงด้านสภาพคล่องตามหลักเกณฑ์ที่กำหนดในข้อ 9/1 ประกาศที่ ทน. 11/2564 โดยให้บริษัทจัดการดำเนินการภายในวันที่ 1 กุมภาพันธ์ พ.ศ. 2565

2. ขยายระยะเวลาการจัดให้มีเครื่องมือการบริหารและจัดการความเสี่ยงด้านสภาพคล่องของกองทุนรวมตามหลักเกณฑ์ที่กำหนดในข้อ 25/1 ประกาศที่ ทน. 11/2564 โดยให้บริษัทจัดการดำเนินการภายในวันที่ 1 กรกฎาคม พ.ศ. 2565

จึงเรียนมาเพื่อโปรดทราบและถือปฏิบัติ ทั้งนี้ สำนักงาน ก.ล.ต. ขอเสนอชื่อเจ้าหน้าที่สำหรับติดต่อสอบถามคือ นายพิศุทธิ์ บุญวัฒน์สุนทร เจ้าหน้าที่บริหาร ฝ่ายนโยบายธุรกิจจัดการลงทุน โทรศัพท์ 0-2033-9914 อีเมล pisut@sec.or.th และ นายพรพงศ์ ศักดาพัฒน์ ผู้ช่วยผู้อำนวยการ ฝ่ายนโยบายธุรกิจจัดการลงทุน โทรศัพท์ 0-2033-4652 อีเมล pompong@sec.or.th

ขอแสดงความนับถือ

(นางสุรียรัตน์ สุรเดชะ)

ผู้อำนวยการฝ่ายนโยบายธุรกิจจัดการลงทุน
เลขาธิการแทน

สิ่งที่ส่งมาด้วย ภาพถ่ายประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทน. 69/2564 เรื่อง ขยายระยะเวลาการดำเนินการเกี่ยวกับการบริหารและจัดการความเสี่ยงด้านสภาพคล่องของกองทุนรวม ลงวันที่ 14 ธันวาคม พ.ศ. 2564

ฝ่ายนโยบายธุรกิจจัดการลงทุน
โทรศัพท์/โทรสาร 0-2033-9914