

**หัวข้อ : เครื่องมือบริหารความเสี่ยงสภาพคล่องของกองทุนรวม
กองทุนมีเครื่องมือบริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่อง ดังนี้**

1. เครื่องมือการกำหนดให้ผู้ลงทุนเป็นผู้รับภาระค่าใช้จ่าย

● 1.1 ค่าธรรมเนียมการรักษาสภาพคล่อง (liquidity fee)

○ กองทุนรวมทั่วไป

อัตราค่าธรรมเนียมการรักษาสภาพคล่องไม่เกินร้อยละ ของมูลค่าหน่วยลงทุน

โปรดระบุรายละเอียดเกี่ยวกับการใช้ liquidity fee เช่น เงื่อนไขการใช้ liquidity fee ร่วมกับเครื่องมืออื่น การกำหนดค่าธรรมเนียมแบบตามลำดับขั้น เป็นต้น

Text box สำหรับระบุรายละเอียดเพิ่มเติม โดยไม่จำกัดจำนวนตัวอักษร

○ กองทุนรวม feeder fund และ fund of funds

เมื่อกองทุนปลายทางมีการใช้ liquidity fee บริษัทจัดการจะพิจารณา
ดำเนินการให้สอดคล้องกับกองทุนปลายทาง

รายละเอียดเพิ่มเติม

Text box สำหรับระบุรายละเอียดเพิ่มเติม โดยไม่จำกัดจำนวนตัวอักษร

● 1.2 การปรับมูลค่าทรัพย์สินสุทธิด้วยสูตรการคำนวณที่สะท้อนต้นทุนในการซื้อขาย
ทรัพย์สินของกองทุนรวม (swing pricing)

○ กองทุนรวมทั่วไป

อัตราสูงสุดไม่เกินร้อยละ ของมูลค่าหน่วยลงทุน ด้วยวิธี

○ Full swing pricing

○ Partial swing pricing

โปรดระบุหลักการ swing factor และ threshold พอสังเขป รวมถึงเงื่อนไขการใช้
swing pricing ร่วมกับเครื่องมืออื่น

Text box สำหรับระบุรายละเอียดเพิ่มเติม โดยไม่จำกัดจำนวนตัวอักษร

○ กองทุนรวม feeder fund และ fund of funds

เมื่อกองทุนปลายทางมีการใช้ swing pricing บริษัทจัดการจะพิจารณา
ดำเนินการให้สอดคล้องกับกองทุนปลายทาง

รายละเอียดเพิ่มเติม

Text box สำหรับระบุรายละเอียดเพิ่มเติม โดยไม่จำกัดจำนวนตัวอักษร

● 1.3 ค่าธรรมเนียมการซื้อขายหน่วยลงทุนที่สะท้อนต้นทุนในการซื้อขายทรัพย์สินของกองทุนรวม (Anti-Dilution Levies – ADLs)

○ กองทุนรวมทั่วไป

อัตราสูงสุดไม่เกินร้อยละ ของมูลค่าหน่วยลงทุน

โปรดระบุหลักการ ADLs factor วิธีการเรียกเก็บ และ threshold พอสังเขป รวมถึงเงื่อนไขการใช้ ADLs ร่วมกับเครื่องมืออื่น

Text box สำหรับระบุรายละเอียดเพิ่มเติม โดยไม่จำกัดจำนวนตัวอักษร

○ กองทุนรวม feeder fund และ fund of funds

เมื่อกองทุนปลายทางมีการใช้ ADLs บริษัทจัดการจะพิจารณาดำเนินการให้สอดคล้องกับกองทุนปลายทาง

รายละเอียดเพิ่มเติม

Text box สำหรับระบุรายละเอียดเพิ่มเติม โดยไม่จำกัดจำนวนตัวอักษร

2. การกำหนดเงื่อนไขหรือข้อจำกัดในการรับคำสั่งขายคืนหน่วยลงทุน

● 2.1 ระยะเวลาที่ต้องแจ้งล่วงหน้าก่อนการขายคืนหน่วยลงทุน (notice period)

○ กองทุนรวมทั่วไป

เมื่อผู้ถือหน่วยลงทุนต้องการไถ่ถอนหน่วยลงทุนมูลค่าเกินกว่า บาท

จะต้องแจ้งบริษัทจัดการล่วงหน้าเป็นเวลา วันทำการ

โปรดระบุเงื่อนไขการใช้ notice period ร่วมกับเครื่องมืออื่น หรือเงื่อนไขอื่นที่เกี่ยวข้อง

Text box สำหรับระบุรายละเอียดเพิ่มเติม โดยไม่จำกัดจำนวนตัวอักษร

○ กองทุนรวม feeder fund และ fund of funds

เมื่อกองทุนปลายทางมีการใช้ notice period บริษัทจัดการจะพิจารณาดำเนินการให้สอดคล้องกับกองทุนปลายทาง

รายละเอียดเพิ่มเติม

Text box สำหรับระบุรายละเอียดเพิ่มเติม โดยไม่จำกัดจำนวนตัวอักษร

● 2.2 เพดานการขายคืนหน่วยลงทุน (redemption gate)

○ กองทุนรวมทั่วไป

เพดานการขายคืนหน่วยลงทุนไม่ต่ำกว่าร้อยละ ของมูลค่า

ทรัพย์สินสุทธิของกองทุนรวม โดยบริษัทจัดการจะใช้เพดานการขายคืน

หน่วยลงทุนไม่เกิน วันทำการ ในทุกรอบเวลา วัน

โปรดระบุสาระสำคัญเกี่ยวกับการใช้ redemption gate เช่น pro-rata เงื่อนไขการใช้ร่วมกับเครื่องมืออื่น เงื่อนไขการเปลี่ยนแปลงแนวทางการดำเนินการระหว่างการทำ redemption gate หรือเงื่อนไขที่ผู้ถือหน่วยลงทุนสามารถยกเลิกคำสั่งขายคืนหน่วยลงทุนได้ (ถ้ามี) เป็นต้น

Text box สำหรับบรรยายละเอียดเพิ่มเติม โดยไม่จำกัดจำนวนตัวอักษร

○ กองทุนรวม feeder fund และ fund of funds

เมื่อกองทุนปลายทางมีการใช้ redemption gate บริษัทจัดการจะพิจารณาดำเนินการให้สอดคล้องกับกองทุนปลายทาง

รายละเอียดเพิ่มเติม

Text box สำหรับบรรยายละเอียดเพิ่มเติม โดยไม่จำกัดจำนวนตัวอักษร

3. การไม่ขายหรือไม่รับซื้อคืนหน่วยลงทุนตามคำสั่งที่รับไว้แล้วหรือจะหยุดรับคำสั่งซื้อหรือคำสั่งขายคืนหน่วยลงทุน (suspension of dealings)

บริษัทจัดการกองทุนรวมสามารถดำเนินการได้สูงสุดไม่เกิน วันทำการ เว้นแต่จะได้รับการผ่อนผันเวลาดังกล่าวจากสำนักงาน ก.ล.ต. โดยบริษัทจัดการกองทุนรวมพิจารณาแล้ว มีความเชื่อโดยสุจริตและสมเหตุสมผลว่าจำเป็นต้องระงับการซื้อขายหน่วยลงทุนโดยได้รับความเห็นชอบจากผู้ดูแลผลประโยชน์ กรณีเกิดเหตุตามประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์กำหนด

บริษัทจัดการกองทุนรวมจะไม่ขายหรือไม่รับซื้อคืนหน่วยลงทุนตามคำสั่งที่รับไว้แล้วหรือจะหยุดรับคำสั่งซื้อหรือคำสั่งขายคืนหน่วยลงทุน (suspension of dealings) ได้ด้วยเหตุอื่นใดดังต่อไปนี้ ซึ่งไม่เกินกว่ากรณีที่ประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์กำหนด

1. เป็นการไม่ขายหน่วยลงทุนตามคำสั่งซื้อหน่วยลงทุนที่รับไว้แล้ว หรือเป็นการหยุดรับคำสั่งซื้อหน่วยลงทุนแก่ผู้ลงทุนเฉพาะราย เนื่องจากปรากฏข้อเท็จจริง ดังนี้

(ก) บริษัทจัดการกองทุนรวมมีเหตุอันควรสงสัยว่าผู้ลงทุนรายนั้น ๆ มีส่วนเกี่ยวข้องกับการกระทำอย่างใดอย่างหนึ่งดังนี้

(1) การกระทำที่เป็นความผิดมูลฐานหรือความผิดฐานฟอกเงินตามกฎหมายเกี่ยวกับการป้องกันและปราบปรามการฟอกเงิน ไม่ว่าจะเป็กฎหมายไทยหรือกฎหมายต่างประเทศ

(2) การให้การสนับสนุนทางการเงินแก่การก่อการร้าย

(3) การกระทำที่เป็นการปฏิบัติตามคำสั่งเกี่ยวกับการยึดหรืออายัดทรัพย์สินโดยบุคคลผู้มีอำนาจตามกฎหมาย

(ข) บริษัทจัดการกองทุนรวมไม่สามารถดำเนินการรู้จักลูกค้า และตรวจสอบเพื่อทราบข้อเท็จจริงเกี่ยวกับลูกค้าได้ในสาระสำคัญ

2. อยู่ในระหว่างดำเนินการเปลี่ยนให้บริษัทจัดการกองทุนรวมรายอื่นเข้าบริหารจัดการกองทุนรวมภายใต้การจัดการของตนอันเนื่องมาจากการที่บริษัทจัดการกองทุนรวมรายเดิมไม่สามารถดำรงความเพียงพอของเงินกองทุนได้ตามประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยการดำรงเงินกองทุนของผู้ประกอบธุรกิจจัดการ

กองทุนรวม การจัดการกองทุนส่วนบุคคล การเป็นนายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์และการค้า
หลักทรัพย์และการจัดจำหน่ายหลักทรัพย์ที่เป็นหน่วยลงทุน และการเป็นผู้จัดการเงินทุน
สัญญาซื้อขายล่วงหน้า ซึ่งให้กระทำได้ไม่เกิน 3 วันทำการ

3. อยู่ในระหว่างดำเนินการเพื่อเลิกกองทุนรวม ในกรณีที่ปรากฏข้อเท็จจริง
ซึ่งบริษัทจัดการกองทุนรวมพิจารณาแล้วมีความเชื่อโดยสุจริตและสมเหตุสมผลว่าจะมีการ
ขายคืนหน่วยลงทุน ในกรณีใดกรณีหนึ่ง ดังต่อไปนี้ และการเลิกกองทุนรวมจะเป็นประโยชน์
ต่อผู้ถือหน่วยลงทุนโดยรวม

(ก) มีการขายคืนหน่วยลงทุนสุทธิ ณ วันใดวันหนึ่งเกินกว่า 2 ใน 3 ของจำนวน
หน่วยลงทุนที่จำหน่ายได้แล้วทั้งหมด

(ข) มียอดรวมการขายคืนหน่วยลงทุนสุทธิในช่วงระยะเวลา 5 วันทำการ
ซื้อขายหน่วยลงทุนใดติดต่อกันคิดเป็นจำนวนเกินกว่า 2 ใน 3 ของจำนวนหน่วยลงทุนที่
จำหน่ายได้แล้วทั้งหมด ทั้งนี้ กรณีที่เป็นกองทุนรวมที่มีกำหนดระยะเวลาการรับซื้อคืนหน่วย
ลงทุนเป็นช่วง (interval fund) การพิจารณาระยะเวลาการขายคืนหน่วยลงทุน ให้พิจารณา
จากเฉพาะในช่วงระยะเวลาเดียวกัน ซึ่งกองทุนรวมเปิดให้รับซื้อคืนหน่วยลงทุนเท่านั้น

ทั้งนี้ บริษัทจัดการกองทุนรวมจะไม่ดำเนินการตามข้อ 3 วรรคหนึ่ง หากบริษัท
จัดการกองทุนรวมพิจารณาแล้ว มีความเชื่อโดยสุจริตและสมเหตุสมผลว่าการเลิกกองทุน
รวมจะไม่เป็นประโยชน์ต่อผู้ถือหน่วยลงทุนที่เหลืออยู่เนื่องจากกองทุนรวมยังคงมีทรัพย์สิน
คงเหลือที่มีคุณภาพและมีสภาพคล่องอย่างเพียงพอ และผู้ถือหน่วยลงทุนที่เหลืออยู่จะไม่ได้
รับผลกระทบจากการขายคืนนั้น

หมายเหตุ :

1. บริษัทจัดการไม่จำเป็นต้องระบุ side pocket ในโครงการจัดการกองทุนรวม เนื่องจากเป็นปฏิบัติตามประกาศ
ซึ่งบริษัทจัดการสามารถดำเนินการได้อยู่แล้ว
2. ในขั้นตอนจัดทำระบบจะไม่มีตัวเลขแสดงลำดับข้อ เพื่อให้สอดคล้องกับส่วนอื่นของโครงการและง่ายต่อการ
แก้ไขระบบครั้งถัดไป (ถ้ามี)